

国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

2024 年中期报告

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:上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 08 月 30 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08月23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2024年01月01日起至2024年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	6
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.....	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	10
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.....	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
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.....	14
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	14

§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58
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	58
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	59
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	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59

§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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	61
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	62
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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.....	62
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	63
10.8 其他重大事件.....	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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.....	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	国泰君安沪深 300 指数增强发起	
基金主代码	018257	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 04 月 19 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	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	789,049,978.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C
下属分级基金的交易代码	018257	018258
报告期末下属分级基金的份额总额	219,751,080.07 份	569,298,898.80 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，在力求对沪深 300 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	<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%，在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。如果标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。</p> <p>本基金的投资策略包括股票投资策略、债券投资策略、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略、资产支持证券投资策略、参与股指期货交易策略、参与国债期货交易策略、融资及转融通证券出借业务投资策略。</p>
业绩比较基准	沪深 300 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。
--	--

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	朱萍
	联系电话	021-38676022	021-31888888
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		95521	95528
传真		021-38871190	021-63602540
注册地址		上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室	上海市中山东一路 12 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	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		200120	200126
法定代表人		陶耿	张为忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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

§ 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（2024 年 01 月 01 日-2024 年 06 月 30 日）
---------------	--

	国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C
本期已实现收益	4,678,978.68	5,059,941.15
本期利润	2,791,659.33	-7,699,289.33
加权平均基金份额本期利润	0.0239	-0.0372
本期加权平均净值利润率	2.60%	-4.06%
本期基金份额净值增长率	4.41%	4.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-16,917,768.90	-46,335,064.89
期末可供分配基金份额利润	-0.0770	-0.0814
期末基金资产净值	202,833,311.17	522,963,833.91
期末基金份额净值	0.9230	0.9186
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-7.70%	-8.14%

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

国泰君安沪深 300 指数增强发起 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	-2.30%	0.52%	-3.14%	0.46%	0.84%	0.06%
过去三个月	0.59%	0.72%	-2.03%	0.72%	2.62%	0.00%
过去六个月	4.41%	0.90%	0.88%	0.85%	3.53%	0.05%
过去一年	-5.40%	0.85%	-9.38%	0.83%	3.98%	0.02%
自基金合同生效起至今	-7.70%	0.83%	-16.00%	0.83%	8.30%	0.00%

国泰君安沪深 300 指数增强发起 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	-2.33%	0.52%	-3.14%	0.46%	0.81%	0.06%

过去三个月	0.48%	0.71%	-2.03%	0.72%	2.51%	-0.01%
过去六个月	4.21%	0.90%	0.88%	0.85%	3.33%	0.05%
过去一年	-5.77%	0.85%	-9.38%	0.83%	3.61%	0.02%
自基金合同生效起至今	-8.14%	0.83%	-16.00%	0.83%	7.86%	0.00%

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

国泰君安沪深300指数增强发起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

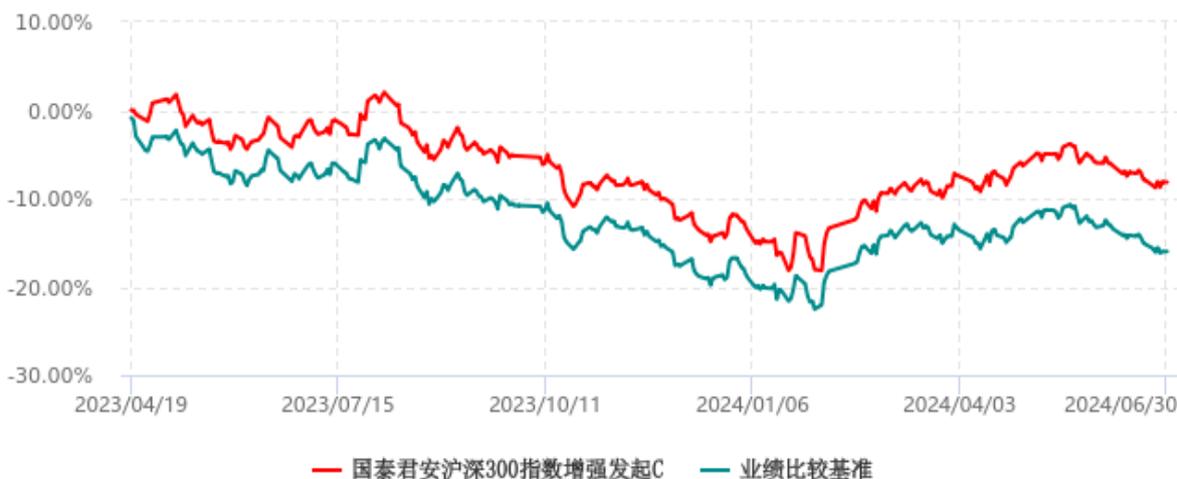
(2023年04月19日-2024年06月30日)



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。

国泰君安沪深300指数增强发起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

(2023年04月19日-2024年06月30日)



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。

§ 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 2024 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 53 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，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。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。	2023-04-19	-	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。

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，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% 的次數为 2 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 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

上半年，市场风险偏好降至冰点，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。这不仅反映了投资者对确定性资产的强烈需求，也揭示了市场在动荡时期的价值回归趋势。同时，今年两市跑赢沪深 300 指数的公司不足 15%，而跑赢中证 500 的公司也不到 1/4，整体市场平均涨跌幅超过 20%，显示出明显的亏钱效应，这对以分散化持股为主要投资风格的量化策略并不友好。

从沪深 300 指数当前的估值水平来看，截至二季度末其加权 PE 和整体 PE 均在 12 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 35%，而用整体 PB 估值的话，则历史分位数更低，处于历史分位数 7% 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。我们认为做为一个大盘成长和大盘价值股的代表，沪深 300 指数从长期来看依然有其特殊的配置价值。

随着我国积极的财政政策适度加力，高水平对外开放政策不断延续，以及消费需求仍处于充分释放阶段，未来市场具备回升条件，我们预计，未来市场板块轮动速度仍然较快。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，但也充分证明量化模型在大盘股上也可以做出较为稳定的 Alpha。量化投资的逻辑自成体系，尽量不要受市场“宏大叙事”的印象，从投资理念和投资逻辑来讲保持自洽和一致。过去一段时间当中，市场的小盘股呈现出了较大的波动性，而以博取 Alpha 为主的大盘宽基增强型产品相比之下呈现出更高的性价比和更优的投资体验感。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，通过机器学习模型有针对性地有效选择因子，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沪深 300 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。我们认为沪深 300 指数当前依然处于历史低估阶段，是中国核心资产的最好代表，在复杂的经济环境下体现出了较为稳定的盈利能力，也是最注重股东回报的一类上市公司，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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安沪深 300 指数增强发起 A 基金份额净值为 0.9230 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.41%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%；截至报告期末国泰君安沪深 300 指数增强发起 C 基金份额净值为 0.9186 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.21%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，A 股权益市场估值仍然处于历史底部位置，A 股指数具有较高的配置性价比，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。海外方面，美联储降息预期再次扩张，引来美元指数和美债利率的进一步走弱，人民币汇率回升，有助于海外资金加速回流 A 股。国内方面，监管层面对股票市场的非常态波动采取了积极行动，“国九条”的实施与打击财务造假举措的不断推进，短期内对中小市值公司确实造成一定情绪面的冲击，但长远来看，这些措施犹如“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，在提升上市公司质量和注重投资者回报的同时，为投资者创造更加透明和公平的投资环境。审视当下的行情，诚然目前市场依然处于风险偏好较低的缩量博弈阶段，市场信心的恢复尚需时日，但是我们认为大多数股票的市场化“出清”较为彻底，过去多年的下跌对当下复杂经济环境和国际政治形势的估值消化已经较为充分，“磨底”的煎熬并不妨碍我们对于下半年主要股票宽基指数的行情变得积极乐观起来。

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规定，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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用。

§ 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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的托管过程中，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、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由上海国泰君安证券资产管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	54,604,553.92	9,173,073.58
结算备付金		6,705,619.84	890,661.07
存出保证金		1,122,867.90	249,729.48
交易性金融资产	6.4.7.2	676,005,165.05	140,626,531.14
其中：股票投资		676,005,165.05	140,626,531.14
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,990,480.28	170,134.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		741,428,686.99	151,110,129.60
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
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		14,719,101.79	21,276.29
应付管理人报酬		572,076.10	123,205.59
应付托管费		85,811.39	18,480.84
应付销售服务费		162,775.11	30,261.14
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	91,777.52	30,004.76
负债合计		15,631,541.91	223,228.62
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	789,049,978.87	170,985,415.82
未分配利润	6.4.7.8	-63,252,833.79	-20,098,514.84
净资产合计		725,797,145.08	150,886,900.98
负债和净资产总计		741,428,686.99	151,110,129.60

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 789,049,978.87 份。其中国泰君安沪深 300 指数增强发起 A 基金份额净值 0.9230 元，基金份额总额 219,751,080.07 份；国泰君安沪深 300 指数增强发起 C 基金份额净值 0.9186 元，基金份额总额 569,298,898.80 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-2,794,087.24	-327,283.04
1. 利息收入		38,828.62	1,542.40
其中：存款利息收入	6.4.7.9	38,828.62	1,542.40
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,420,109.16	-35,539.25
其中：股票投资收益	6.4.7.10	4,256,215.39	-202,615.44
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	764,645.25	-
股利收益	6.4.7.12	6,399,248.52	167,076.19
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	-14,646,549.83	-293,324.69
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	393,524.81	38.50
减：二、营业总支出		2,113,542.76	48,735.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,448,976.35	31,897.33
2. 托管费	6.4.10.2.2	217,346.44	4,784.63

3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	367, 682. 99	4, 952. 27
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, 118. 49	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 15	75, 418. 49	7, 101. 44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4, 907, 630. 00	-376, 018. 71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4, 907, 630. 00	-376, 018. 71
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4, 907, 630. 00	-376, 018. 71

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	170, 985, 415. 82	-20, 098, 514. 84	150, 886, 900. 98
二、本期期初净资产	170, 985, 415. 82	-20, 098, 514. 84	150, 886, 900. 98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	618, 064, 563. 05	-43, 154, 318. 95	574, 910, 244. 10
（一）、综合收益总额	-	-4, 907, 630. 00	-4, 907, 630. 00
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	618, 064, 563. 05	-38, 246, 688. 95	579, 817, 874. 10
其中：1. 基金申购款	741, 254, 520. 41	-47, 815, 491. 89	693, 439, 028. 52
2. 基金赎回款	-123, 189, 957. 36	9, 568, 802. 94	-113, 621, 154. 42
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净	-	-	-

资产减少以“-”号填列)			
四、本期期末净资产	789,049,978.87	-63,252,833.79	725,797,145.08
项 目	上年度可比期间 2023 年 04 月 19 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	15,019,999.00	-	15,019,999.00
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	10,514,196.04	-631,276.30	9,882,919.74
(一)、综合收益总额	-	-376,018.71	-376,018.71
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	10,514,196.04	-255,257.59	10,258,938.45
其中: 1. 基金申购款	10,527,116.77	-255,461.72	10,271,655.05
2. 基金赎回款	-12,920.73	204.13	-12,716.60
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	25,534,195.04	-631,276.30	24,902,918.74

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:

陶耿	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

国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 (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 [2023] 568 号《关于准予国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准, 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《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式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 15,019,999.00 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 (2023) 第 0237 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 19 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 15,019,999.00 份, 无认购资金利息折合基金份额。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, 基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式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。本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 15,019,000.00 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式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、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%，投资于沪深 300 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沪深 300 指数收益率 \times 95%+同期银行活期存款利率(税后) \times 5%。

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》、《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》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 2024 年 01 月 01 日至 2024 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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 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、会计估计与最近一期年度会计报告所采用的会计政策、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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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[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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
活期存款	33,750,788.52
等于：本金	33,748,032.49
加：应计利息	2,756.03
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	20,853,765.40
等于：本金	20,852,238.92
加：应计利息	1,526.48
减：坏账准备	-
合计	54,604,553.92

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	693,196,565.52	-	676,005,165.05	-17,191,400.47
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	693,196,565.52	-	676,005,165.05	-17,191,400.47

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 2024 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	9,347,975.60	0.00	-	-
—股指期货	9,347,975.60	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	9,347,975.60	-	-	-

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
IF2407	IF2407	9	9,279,900.00	-68,075.60
合计				-68,075.60
减：可抵销期货暂收款				-68,075.60
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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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 2024 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	17,146.89
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	59,672.34
预提审计费	14,918.54
其他应付	39.75
合计	91,777.52

6.4.7.7 实收基金

国泰君安沪深 300 指数增强发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	64,205,788.82	64,205,788.82
本期申购	188,678,219.89	188,678,219.89
本期赎回(以“-”号填列)	-33,132,928.64	-33,132,928.64

本期末	219,751,080.07	219,751,080.07
-----	----------------	----------------

国泰君安沪深 300 指数增强发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	106,779,627.00	106,779,627.00
本期申购	552,576,300.52	552,576,300.52
本期赎回（以“-”号填列）	-90,057,028.72	-90,057,028.72
本期末	569,298,898.80	569,298,898.80

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

国泰君安沪深 300 指数增强发起 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	-4,494,688.53	-2,953,381.84	-7,448,070.37
本期期初	-4,494,688.53	-2,953,381.84	-7,448,070.37
本期利润	4,678,978.68	-1,887,319.35	2,791,659.33
本期基金份额交易产生的变动数	-8,084,919.38	-4,176,438.48	-
			12,261,357.86
其中：基金申购款	-9,323,328.78	-5,438,028.83	-
			14,761,357.61
基金赎回款	1,238,409.40	1,261,590.35	2,499,999.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,900,629.23	-9,017,139.67	-
			16,917,768.90

国泰君安沪深 300 指数增强发起 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	-7,743,293.30	-4,907,151.17	-
			12,650,444.47
本期期初	-7,743,293.30	-4,907,151.17	-
			12,650,444.47
本期利润	5,059,941.15	-12,759,230.48	-7,699,289.33
本期基金份额交易产生的变动数	-20,324,692.81	-5,660,638.28	-
			25,985,331.09
其中：基金申购款	-24,838,526.00	-8,215,608.28	-
			33,054,134.28
基金赎回款	4,513,833.19	2,554,970.00	7,068,803.19

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-23,008,044.96	-23,327,019.93	46,335,064.89

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	20,358.15
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	12,397.40
结算备付金利息收入	6,073.07
其他	-
合计	38,828.62

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,200,054,532.72
减：卖出股票成本总额	1,194,776,458.75
减：交易费用	1,021,858.58
买卖股票差价收入	4,256,215.39

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	821,724.85
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	34,320.72
减：交易费用	22,758.88
合计	764,645.25

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,399,248.52
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	6,399,248.52
----	--------------

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-14,529,607.98
——股票投资	-14,529,607.98
——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	-116,941.85
——权证投资	-
————期货投资	-116,941.85
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	-14,646,549.83

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	393,524.81
合计	393,524.81

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	14,918.54
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	827.61
合计	75,418.49

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
上海浦东发展银行股份有限公司(以下 简称“浦东发展银行”)	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

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 04 月 19 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 06 月 30 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	2,944,285,987.6 0	100.00%	130,138,275.3 4	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 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	232,970.38	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）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	9,279.10	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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,448,976.35	31,897.33
其中：应支付销售机构的客户维护费	281,489.37	24.92
应支付基金管理人的净管理费	1,167,486.98	31,872.41

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管	217,346.44	4,784.63

费		
---	--	--

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C	合计
国泰君安证券	-	108,582.39	108,582.39
国泰君安资管	-	222,685.75	222,685.75
合计	-	331,268.14	331,268.14
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C	合计
国泰君安证券	-	19.72	19.72
国泰君安资管	-	4,315.86	4,315.86
合计	-	4,335.58	4,335.58

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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。

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

国泰君安沪深 300 指数增强发起 A

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2023 年 04 月 19 日）持有的基金份额	-	10,009,000.00
报告期初持有的基金份额	30,972,312.37	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	20,963,312.37	-
报告期末持有的基金份额	10,009,000.00	10,009,000.00
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	4.55%	85.19%

国泰君安沪深 300 指数增强发起 C

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2023 年 04 月 19 日）持有的基金份额	-	5,010,000.00
报告期初持有的基金份额	5,010,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,010,000.00	5,010,000.00
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	0.88%	36.34%

注：1. 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。2. 报告期末持有的本基金份额占基金分类份额比例，比例的分母采用各自类别的份额计算。

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至
-------	--	---------------------------------------

			2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦东发展银行	33,750,788.52	20,358.15	1,695,654.55	687.57
国泰君安证券	20,853,765.40	12,397.40	107,768.98	854.83

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2. 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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 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
603350	C 安乃达	2024 年 06 月 26 日	-	新股未上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-
301580	爱迪特	2024 年 06 月 19 日	1-6 个月（含）	网下新股限售	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301392	汇成真空	2024 年 05 月	1-6 个月	网下新股	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-

		月 28 日	(含)	限售						
688691	灿芯半导体股份	2024 年 04 月 02 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	19.86	42.51	211	4,190.46	8,969.61	-
301539	宏鑫科技	2024 年 04 月 03 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688709	成都华微	2024 年 01 月 31 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	15.69	18.79	303	4,754.07	5,693.37	-
688530	欧莱新材	2024 年 04 月 29 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
001389	广合科技	2024 年 03 月 26 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	17.43	34.56	159	2,771.37	5,495.04	-
603381	永臻股份	2024 年 06 月 19 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688584	上海合晶硅材料	2024 年 02 月 01 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	22.66	15.89	233	5,279.78	3,702.37	-
603344	星德胜科技	2024 年 03 月 13 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	19.18	22.66	81	1,553.58	1,835.46	-
603375	盛景微电子	2024 年 01 月 17 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	38.18	38.90	43	1,641.74	1,672.70	-

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

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

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上海浦东发展银行股份有限公司，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 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2023 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 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司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、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 2024 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	54,604,553.92	-	-	-	54,604,553.92
结算备付金	6,705,619.84	-	-	-	6,705,619.84
存出保证金	1,122,867.90	-	-	-	1,122,867.90
交易性金融资产	-	-	-	676,005,165.05	676,005,165.05
应收申购款	-	-	-	2,990,480.28	2,990,480.28
资产总计	62,433,041.66	-	-	678,995,645.33	741,428,686.99
负债					
应付赎回款	-	-	-	14,719,101.79	14,719,101.79
应付管理人报酬	-	-	-	572,076.10	572,076.10
应付托管费	-	-	-	85,811.39	85,811.39
应付销售服务费	-	-	-	162,775.11	162,775.11
其他负债	-	-	-	91,777.52	91,777.52
负债总计	-	-	-	15,631,541.91	15,631,541.91

利率敏感度 缺口	62,433,041.6 6	-	-	663,364,103.4 2	725,797,145.0 8
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	9,173,073.58	-	-	-	9,173,073.58
结算备付金	890,661.07	-	-	-	890,661.07
存出保证金	249,729.48	-	-	-	249,729.48
交易性金融 资产	-	-	-	140,626,531.1 4	140,626,531.1 4
应收申购款	-	-	-	170,134.33	170,134.33
资产总计	10,313,464.1 3	-	-	140,796,665.4 7	151,110,129.6 0
负债					
应付赎回款	-	-	-	21,276.29	21,276.29
应付管理人 报酬	-	-	-	123,205.59	123,205.59
应付托管费	-	-	-	18,480.84	18,480.84
应付销售服 务费	-	-	-	30,261.14	30,261.14
其他负债	-	-	-	30,004.76	30,004.76
负债总计	-	-	-	223,228.62	223,228.62
利率敏感度 缺口	10,313,464.1 3	-	-	140,573,436.8 5	150,886,900.9 8

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 2024 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% (2023 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 (2023 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 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 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	676,005,165.05	93.14	140,626,531.14	93.20
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	676,005,165.05	93.14	140,626,531.14	93.20

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

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	35,900,712.02	-
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-35,900,712.02	-

注：于 2023 年 12 月 31 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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	675,916,579.98	140,626,531.14
第二层次	21,608.56	-
第三层次	66,976.51	-
合计	676,005,165.05	140,626,531.14

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	676,005,165.05	91.18
	其中：股票	676,005,165.05	91.18
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	61,310,173.76	8.27
8	其他各项资产	4,113,348.18	0.55
9	合计	741,428,686.99	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	1,686,682.00	0.23
B	采矿业	35,749,310.00	4.93
C	制造业	288,077,917.03	39.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,550,044.00	4.35
E	建筑业	21,570,848.00	2.97
F	批发和零售业	56,704.59	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	9,477,272.00	1.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,358,967.40	2.39
J	金融业	131,613,636.96	18.13
K	房地产业	2,172,480.00	0.30

L	租赁和商务服务业	7,280,085.00	1.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	616,104.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	547,210,050.98	75.39

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	-	-
B	采矿业	4,201,033.00	0.58
C	制造业	89,704,487.95	12.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,225,243.00	1.00
E	建筑业	68,200.00	0.01
F	批发和零售业	3,002,227.80	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	9,924,421.70	1.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,958,972.62	1.37
J	金融业	2,931,758.00	0.40
K	房地产业	689,312.00	0.09
L	租赁和商务服务业	1,089,458.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	128,795,114.07	17.75

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	600519	贵州茅台	23,200	34,043,448.00	4.69
2	601318	中国平安	498,500	20,617,960.00	2.84
3	300750	宁德时代	87,989	15,840,659.67	2.18
4	000725	京东方 A	2,754,300	11,265,087.00	1.55
5	000333	美的集团	170,400	10,990,800.00	1.51
6	600809	山西汾酒	48,200	10,164,416.00	1.40
7	601398	工商银行	1,740,100	9,918,570.00	1.37
8	000568	泸州老窖	66,000	9,470,340.00	1.30
9	600036	招商银行	273,900	9,364,641.00	1.29
10	002241	歌尔股份	457,900	8,933,629.00	1.23
11	601166	兴业银行	503,200	8,866,384.00	1.22
12	600030	中信证券	485,500	8,850,665.00	1.22
13	002475	立讯精密	217,400	8,545,994.00	1.18
14	000063	中兴通讯	291,000	8,139,270.00	1.12
15	000858	五粮液	63,500	8,130,540.00	1.12
16	003816	中国广核	1,723,600	7,980,268.00	1.10
17	601668	中国建筑	1,464,600	7,777,026.00	1.07
18	000001	平安银行	737,700	7,487,655.00	1.03
19	601229	上海银行	1,028,096	7,463,976.96	1.03
20	601888	中国中免	116,500	7,280,085.00	1.00
21	601877	正泰电器	380,000	7,242,800.00	1.00
22	600028	中国石化	1,144,600	7,233,872.00	1.00
23	601633	长城汽车	285,100	7,213,030.00	0.99
24	601857	中国石油	687,100	7,090,872.00	0.98
25	600031	三一重工	419,200	6,916,800.00	0.95
26	300408	三环集团	229,300	6,693,267.00	0.92
27	600900	长江电力	231,300	6,689,196.00	0.92
28	601600	中国铝业	858,600	6,551,118.00	0.90
29	000651	格力电器	165,400	6,486,988.00	0.89
30	600690	海尔智家	225,100	6,388,338.00	0.88
31	603501	韦尔股份	62,700	6,230,499.00	0.86

32	600276	恒瑞医药	159,720	6,142,831.20	0.85
33	600015	华夏银行	941,880	6,028,032.00	0.83
34	600019	宝钢股份	892,500	5,935,125.00	0.82
35	601225	陕西煤业	220,400	5,679,708.00	0.78
36	600362	江西铜业	239,600	5,673,728.00	0.78
37	600309	万华化学	69,364	5,608,773.04	0.77
38	600406	国电南瑞	220,340	5,499,686.40	0.76
39	000538	云南白药	102,400	5,237,760.00	0.72
40	601899	紫金矿业	293,800	5,162,066.00	0.71
41	601319	中国人保	987,500	5,085,625.00	0.70
42	601186	中国铁建	583,700	5,002,309.00	0.69
43	601628	中国人寿	148,100	4,598,505.00	0.63
44	002601	龙佰集团	231,500	4,298,955.00	0.59
45	600050	中国联通	902,600	4,242,220.00	0.58
46	601169	北京银行	724,100	4,228,744.00	0.58
47	601898	中煤能源	327,500	4,087,200.00	0.56
48	601988	中国银行	875,700	4,045,734.00	0.56
49	601336	新华保险	133,000	3,993,990.00	0.55
50	601288	农业银行	914,500	3,987,220.00	0.55
51	601658	邮储银行	768,500	3,896,295.00	0.54
52	601939	建设银行	523,900	3,876,860.00	0.53
53	601390	中国中铁	591,800	3,858,536.00	0.53
54	600183	生益科技	183,100	3,856,086.00	0.53
55	600027	华电国际	513,900	3,566,466.00	0.49
56	600011	华能国际	369,400	3,553,628.00	0.49
57	000786	北新建材	115,200	3,416,832.00	0.47
58	600436	片仔癀	15,700	3,252,569.00	0.45
59	600023	浙能电力	451,900	3,213,009.00	0.44
60	600875	东方电气	168,000	3,099,600.00	0.43
61	600332	白云山	104,500	3,064,985.00	0.42
62	601728	中国电信	496,100	3,051,015.00	0.42
63	300433	蓝思科技	164,000	2,993,000.00	0.41
64	601669	中国电建	535,100	2,991,209.00	0.41
65	000807	云铝股份	218,100	2,946,531.00	0.41
66	002001	新和成	151,600	2,910,720.00	0.40
67	600018	上港集团	498,700	2,882,486.00	0.40
68	601816	京沪高铁	524,000	2,813,880.00	0.39
69	603296	华勤技术	49,995	2,761,223.85	0.38
70	600919	江苏银行	365,000	2,711,950.00	0.37
71	000338	潍柴动力	164,660	2,674,078.40	0.37
72	002142	宁波银行	117,800	2,598,668.00	0.36
73	000596	古井贡酒	11,800	2,490,626.00	0.34
74	600795	国电电力	410,000	2,455,900.00	0.34

75	000708	中信特钢	180,900	2,454,813.00	0.34
76	600489	中金黄金	163,500	2,419,800.00	0.33
77	601138	工业富联	88,100	2,413,940.00	0.33
78	002371	北方华创	7,500	2,399,175.00	0.33
79	600760	中航沈飞	58,600	2,349,860.00	0.32
80	601688	华泰证券	184,300	2,283,477.00	0.31
81	600048	保利发展	248,000	2,172,480.00	0.30
82	688036	传音控股	28,365	2,171,057.10	0.30
83	002594	比亚迪	8,500	2,127,125.00	0.29
84	600887	伊利股份	81,800	2,113,712.00	0.29
85	300999	金龙鱼	76,400	2,089,540.00	0.29
86	603195	公牛集团	26,000	2,005,120.00	0.28
87	688363	华熙生物	35,063	1,983,513.91	0.27
88	601800	中国交建	217,200	1,941,768.00	0.27
89	300442	润泽科技	76,600	1,834,570.00	0.25
90	601985	中国核电	168,400	1,795,144.00	0.25
91	601766	中国中车	237,600	1,784,376.00	0.25
92	300498	温氏股份	85,100	1,686,682.00	0.23
93	600886	国投电力	91,000	1,659,840.00	0.23
94	000100	TCL 科技	379,200	1,638,144.00	0.23
95	601601	中国太保	58,700	1,635,382.00	0.23
96	601818	光大银行	480,100	1,521,917.00	0.21
97	603993	XD 洛阳钼业	171,600	1,458,600.00	0.20
98	601238	广汽集团	183,700	1,421,838.00	0.20
99	002352	顺丰控股	39,600	1,413,324.00	0.19
100	601328	交通银行	181,600	1,356,552.00	0.19
101	300059	东方财富	127,500	1,346,400.00	0.19
102	600926	杭州银行	100,900	1,316,745.00	0.18
103	000157	中联重科	147,300	1,131,264.00	0.16
104	600941	中国移动	10,300	1,107,250.00	0.15
105	601699	潞安环能	59,800	1,084,174.00	0.15
106	000938	紫光股份	46,200	1,032,570.00	0.14
107	600372	中航机载	85,558	1,024,129.26	0.14
108	688981	中芯国际	20,600	949,660.00	0.13
109	601006	大秦铁路	132,300	947,268.00	0.13
110	600085	同仁堂	23,900	913,219.00	0.13
111	603019	中科曙光	21,700	900,550.00	0.12
112	601881	中国银河	80,800	877,488.00	0.12
113	601066	中信建投	45,500	875,420.00	0.12
114	600104	上汽集团	61,200	848,232.00	0.12
115	600660	福耀玻璃	17,700	847,830.00	0.12
116	002180	纳思达	29,800	787,316.00	0.11
117	601872	招商轮船	91,500	773,175.00	0.11

118	600188	DR 兖矿能源	30,500	693,265.00	0.10
119	603899	晨光股份	21,900	685,032.00	0.09
120	300919	中伟股份	22,100	684,879.00	0.09
121	688111	金山办公	2,900	659,750.00	0.09
122	600346	恒力石化	44,400	619,380.00	0.09
123	300015	爱尔眼科	59,700	616,104.00	0.08
124	601998	中信银行	90,000	603,000.00	0.08
125	601088	XD 中国神华	12,700	563,499.00	0.08
126	000617	中油资本	96,700	533,784.00	0.07
127	300274	阳光电源	8,420	522,292.60	0.07
128	600016	民生银行	136,000	515,440.00	0.07
129	300896	爱美客	2,900	499,090.00	0.07
130	300760	迈瑞医疗	1,700	494,547.00	0.07
131	600161	天坛生物	19,900	485,560.00	0.07
132	002179	中航光电	12,500	475,625.00	0.07
133	601698	中国卫通	33,300	469,197.00	0.06
134	600025	华能水电	40,000	431,200.00	0.06
135	002410	广联达	44,700	428,226.00	0.06
136	600233	圆通速递	26,900	420,985.00	0.06
137	600999	招商证券	29,600	411,736.00	0.06
138	000800	一汽解放	52,100	407,943.00	0.06
139	600893	航发动力	9,400	343,570.00	0.05
140	603369	今世缘	7,300	337,260.00	0.05
141	600741	华域汽车	20,500	335,790.00	0.05
142	000776	广发证券	25,200	306,684.00	0.04
143	603288	海天味业	8,700	299,889.00	0.04
144	600150	中国船舶	6,600	268,686.00	0.04
145	601919	中远海控	14,600	226,154.00	0.03
146	601808	中海油服	12,400	213,280.00	0.03
147	300033	同花顺	1,800	186,660.00	0.03
148	002841	视源股份	6,100	180,133.00	0.02
149	002736	国信证券	20,500	178,145.00	0.02
150	600905	三峡能源	38,800	169,168.00	0.02
151	603806	福斯特	11,160	164,052.00	0.02
152	600584	长电科技	3,500	110,985.00	0.02
153	600219	南山铝业	20,200	76,962.00	0.01
154	600845	宝信软件	2,100	67,053.00	0.01
155	002938	鹏鼎控股	1,600	63,616.00	0.01
156	600547	山东黄金	2,300	62,974.00	0.01
157	000963	华东医药	2,039	56,704.59	0.01
158	601916	浙商银行	15,700	43,332.00	0.01
159	001289	龙源电力	2,100	36,225.00	0.00
160	002493	荣盛石化	2,600	25,116.00	0.00

161	688009	中国通号	13	78.00	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	002422	科伦药业	214,200	6,496,686.00	0.90
2	002120	韵达股份	528,500	4,090,590.00	0.56
3	002468	申通快递	453,800	3,811,920.00	0.53
4	000830	鲁西化工	322,500	3,737,775.00	0.51
5	002292	奥飞娱乐	530,100	3,169,998.00	0.44
6	000930	中粮科技	625,500	3,146,265.00	0.43
7	600096	云天化	150,700	2,926,594.00	0.40
8	601311	骆驼股份	297,500	2,385,950.00	0.33
9	688586	江航飞机装备	251,800	2,341,740.00	0.32
10	688088	虹软科技	78,866	2,276,072.76	0.31
11	601991	大唐发电	728,300	2,192,183.00	0.30
12	002340	格林美	328,297	2,091,251.89	0.29
13	600612	老凤祥	33,800	1,966,822.00	0.27
14	600006	东风汽车	280,900	1,794,951.00	0.25
15	002897	意华股份	45,800	1,724,828.00	0.24
16	600098	广州发展	250,800	1,605,120.00	0.22
17	603883	老百姓	86,530	1,588,690.80	0.22
18	301260	格力博	116,100	1,581,282.00	0.22
19	688472	阿特斯阳光电力	153,587	1,563,515.66	0.22
20	601231	环旭电子	95,100	1,526,355.00	0.21
21	002519	银河电子	304,100	1,493,131.00	0.21
22	000969	安泰科技	185,500	1,471,015.00	0.20
23	000913	钱江摩托	90,600	1,427,856.00	0.20
24	603198	迎驾贡酒	24,554	1,411,855.00	0.19
25	002284	亚太股份	201,995	1,365,486.20	0.19
26	300660	江苏雷利	52,400	1,337,248.00	0.18
27	002537	海联金汇	255,100	1,318,867.00	0.18
28	603317	天味食品	108,500	1,237,985.00	0.17
29	600468	百利电气	285,900	1,232,229.00	0.17
30	300229	拓尔思	89,599	1,203,314.57	0.17
31	601577	长沙银行	145,800	1,192,644.00	0.16
32	002249	大洋电机	243,867	1,153,490.91	0.16
33	002106	莱宝高科	105,200	1,146,680.00	0.16
34	002550	千红制药	212,600	1,145,914.00	0.16
35	600789	鲁抗医药	163,000	1,141,000.00	0.16

36	603367	辰欣药业	80,700	1,124,958.00	0.15
37	300735	光弘科技	51,800	1,118,880.00	0.15
38	300017	网宿科技	140,400	1,109,160.00	0.15
39	600062	华润双鹤	55,100	1,078,858.00	0.15
40	603939	益丰药房	43,100	1,058,105.00	0.15
41	600602	云赛智联	94,000	1,037,760.00	0.14
42	002078	太阳纸业	74,100	1,033,695.00	0.14
43	600718	东软集团	123,560	1,021,841.20	0.14
44	688249	晶合集成	68,700	1,007,829.00	0.14
45	603055	台华新材	99,400	1,006,922.00	0.14
46	603013	亚普股份	73,300	987,351.00	0.14
47	601038	一拖股份	60,300	953,343.00	0.13
48	002267	陕天然气	125,200	946,512.00	0.13
49	000524	岭南控股	112,300	905,138.00	0.12
50	002020	京新药业	81,900	857,493.00	0.12
51	600308	华泰股份	267,000	838,380.00	0.12
52	300634	彩讯股份	48,500	816,255.00	0.11
53	002032	苏泊尔	15,900	796,590.00	0.11
54	600021	上海电力	80,400	795,156.00	0.11
55	002320	海峡股份	153,300	791,028.00	0.11
56	002563	森马服饰	135,700	788,417.00	0.11
57	300768	迪普科技	66,300	785,655.00	0.11
58	003021	兆威机电	16,800	775,320.00	0.11
59	688380	中微半导	45,700	764,104.00	0.11
60	300684	中石科技	43,100	747,354.00	0.10
61	000960	锡业股份	47,500	735,775.00	0.10
62	000758	中色股份	143,700	729,996.00	0.10
63	600497	驰宏锌锗	134,200	716,628.00	0.10
64	688208	道通科技	29,623	715,099.22	0.10
65	600736	苏州高新	165,700	689,312.00	0.09
66	000636	风华高科	52,500	685,650.00	0.09
67	603766	隆鑫通用	94,900	643,422.00	0.09
68	601666	平煤股份	56,200	629,440.00	0.09
69	002946	新乳业	69,500	608,820.00	0.08
70	000630	铜陵有色	164,900	595,289.00	0.08
71	002907	华森制药	47,000	593,140.00	0.08
72	603056	德邦股份	45,200	592,120.00	0.08
73	002534	西子洁能	57,900	579,579.00	0.08
74	603025	大豪科技	41,500	573,530.00	0.08
75	603229	奥翔药业	56,000	562,800.00	0.08
76	600682	南京新百	110,400	550,896.00	0.08
77	301262	海看股份	24,400	550,220.00	0.08
78	603733	仙鹤股份	30,900	543,222.00	0.07

79	688728	格科微有限公司	44,600	540,106.00	0.07
80	002966	苏州银行	70,900	531,750.00	0.07
81	603517	绝味食品	33,400	514,360.00	0.07
82	603345	安井食品	6,900	512,739.00	0.07
83	300357	我武生物	25,300	511,566.00	0.07
84	600963	岳阳林纸	138,200	507,194.00	0.07
85	600699	均胜电子	34,100	505,362.00	0.07
86	002399	海普瑞	57,700	500,259.00	0.07
87	600578	京能电力	153,700	497,988.00	0.07
88	601187	厦门银行	93,100	496,223.00	0.07
89	002990	盛视科技	23,303	469,089.39	0.06
90	600863	内蒙华电	100,700	467,248.00	0.06
91	600617	国新能源	184,640	461,600.00	0.06
92	688475	萤石网络	13,500	460,485.00	0.06
93	601168	西部矿业	25,300	454,135.00	0.06
94	002202	金风科技	66,200	444,864.00	0.06
95	002539	云图控股	61,700	439,921.00	0.06
96	600210	紫江企业	73,400	390,488.00	0.05
97	600985	淮北矿业	23,200	388,368.00	0.05
98	002237	恒邦股份	33,400	384,434.00	0.05
99	600750	江中药业	16,600	383,626.00	0.05
100	002128	电投能源	17,900	377,690.00	0.05
101	600428	中远海特	61,100	373,932.00	0.05
102	002378	章源钨业	62,400	358,176.00	0.05
103	300973	立高食品	12,700	356,743.00	0.05
104	600335	国机汽车	61,600	355,432.00	0.05
105	600348	华阳股份	35,300	351,588.00	0.05
106	002511	中顺洁柔	50,300	348,076.00	0.05
107	002294	信立泰	12,600	335,538.00	0.05
108	002906	华阳集团	12,500	334,500.00	0.05
109	300233	金城医药	20,600	307,352.00	0.04
110	002351	漫步者	22,700	298,505.00	0.04
111	000975	银泰黄金	18,100	294,849.00	0.04
112	300136	信维通信	15,000	293,700.00	0.04
113	603328	依顿电子	36,400	286,104.00	0.04
114	300463	迈克生物	24,100	274,258.00	0.04
115	001213	中铁特货	67,046	264,831.70	0.04
116	002139	拓邦股份	24,900	264,438.00	0.04
117	300602	飞荣达	15,800	238,738.00	0.03
118	002036	联创电子	34,200	230,850.00	0.03
119	000987	越秀资本	45,100	223,696.00	0.03
120	002612	朗姿股份	15,100	208,682.00	0.03

121	002970	锐明技术	5,700	205,371.00	0.03
122	002558	巨人网络	21,305	201,119.20	0.03
123	000066	中国长城	22,100	193,375.00	0.03
124	002608	江苏国信	24,900	192,975.00	0.03
125	300624	万兴科技	3,619	192,060.33	0.03
126	688150	莱特光电股份	9,800	190,120.00	0.03
127	600517	国网英大	43,600	188,788.00	0.03
128	688313	仕佳光子	19,400	184,688.00	0.03
129	002010	传化智联	48,000	184,320.00	0.03
130	605369	拱东医疗	4,500	179,550.00	0.02
131	600482	中国动力	9,200	179,216.00	0.02
132	603298	杭叉集团	8,800	172,832.00	0.02
133	300034	钢研高纳	10,700	170,023.00	0.02
134	688138	清溢光电	7,900	169,850.00	0.02
135	601069	西部黄金	13,600	158,168.00	0.02
136	603515	欧普照明	9,100	157,794.00	0.02
137	002701	奥瑞金	36,600	152,256.00	0.02
138	601198	东兴证券	18,600	148,056.00	0.02
139	001338	永顺泰	14,700	144,060.00	0.02
140	600761	安徽合力	6,600	142,824.00	0.02
141	002303	美盈森	58,300	140,503.00	0.02
142	300821	东岳硅材	20,300	138,852.00	0.02
143	002536	飞龙股份	14,300	136,136.00	0.02
144	000728	国元证券	22,000	133,320.00	0.02
145	002046	国机精工	12,900	131,193.00	0.02
146	600186	莲花控股	34,700	119,021.00	0.02
147	000738	航发控制	5,900	118,413.00	0.02
148	002245	蔚蓝锂芯	15,100	117,025.00	0.02
149	603658	安图生物	2,500	115,175.00	0.02
150	603496	恒为科技	4,600	112,470.00	0.02
151	600619	海立股份	20,800	107,536.00	0.01
152	600380	健康元	9,000	100,530.00	0.01
153	601101	昊华能源	10,900	100,171.00	0.01
154	688055	昆山龙腾光电	31,218	98,961.06	0.01
155	600596	新安股份	13,000	98,800.00	0.01
156	600566	济川药业	3,100	98,301.00	0.01
157	002185	华天科技	11,700	95,355.00	0.01
158	000060	中金岭南	21,600	91,584.00	0.01
159	688128	中国电器研究 院	5,252	90,386.92	0.01
160	601500	通用股份	15,800	84,372.00	0.01
161	601615	明阳智能	8,500	80,240.00	0.01
162	300383	光环新网	9,300	78,585.00	0.01

163	600038	中直股份	1,800	73,998.00	0.01
164	002140	东华科技	8,800	68,200.00	0.01
165	002557	洽洽食品	2,400	67,656.00	0.01
166	002191	劲嘉股份	18,500	66,785.00	0.01
167	600141	兴发集团	3,500	66,780.00	0.01
168	600703	三安光电	5,600	65,632.00	0.01
169	300048	合康新能	13,500	62,505.00	0.01
170	600299	安迪苏	5,000	48,500.00	0.01
171	002768	国恩股份	2,400	44,880.00	0.01
172	000600	建投能源	5,800	36,540.00	0.01
173	603408	建霖家居	2,700	35,613.00	0.00
174	300390	天华新能	1,700	29,206.00	0.00
175	002274	华昌化工	3,900	28,938.00	0.00
176	000958	电投产融	6,600	24,156.00	0.00
177	000050	深天马 A	3,300	24,024.00	0.00
178	603350	C 安乃达	1,051	21,608.56	0.00
179	603160	汇顶科技	300	20,625.00	0.00
180	002543	万和电气	1,700	16,932.00	0.00
181	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
182	601997	贵阳银行	2,000	10,540.00	0.00
183	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
184	688691	灿芯半导体股份	211	8,969.61	0.00
185	300595	欧普康视	500	7,840.00	0.00
186	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
187	688123	聚辰半导体	113	6,873.79	0.00
188	002423	中粮资本	900	6,741.00	0.00
189	001286	陕西能源	500	5,765.00	0.00
190	688709	成都华微	303	5,693.37	0.00
191	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
192	001389	广合科技	159	5,495.04	0.00
193	000534	万泽股份	500	4,965.00	0.00
194	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
195	688584	上海合晶硅材料	233	3,702.37	0.00
196	688029	南微医学科技	48	2,954.88	0.00
197	603344	星德胜科技	81	1,835.46	0.00
198	603375	盛景微电子	43	1,672.70	0.00
199	688484	南芯科技	45	1,669.50	0.00
200	688122	西部超导	33	1,264.56	0.00
201	688777	中控技术	31	1,168.70	0.00
202	688183	生益电子	47	910.86	0.00
203	688561	奇安信集团	28	661.36	0.00

204	688352	顾中科技	48	547.68	0.00
205	688281	华秦科技实业	6	499.92	0.00
206	688378	奥来德光电	19	445.74	0.00
207	002892	科力尔	40	384.00	0.00
208	688772	珠海冠宇电池	8	119.20	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	600519	贵州茅台	36,170,080.50	23.97
2	601318	中国平安	24,588,513.80	16.30
3	300750	宁德时代	22,743,877.60	15.07
4	600809	山西汾酒	16,182,597.00	10.72
5	000333	美的集团	16,086,646.00	10.66
6	601888	中国中免	14,912,965.00	9.88
7	002475	立讯精密	13,713,665.00	9.09
8	600276	恒瑞医药	13,588,504.00	9.01
9	000858	五粮液	13,453,885.00	8.92
10	600036	招商银行	12,932,395.60	8.57
11	000568	泸州老窖	12,876,218.00	8.53
12	601166	兴业银行	12,563,424.00	8.33
13	000725	京东方 A	12,534,339.00	8.31
14	601398	工商银行	12,093,040.00	8.01
15	000001	平安银行	12,086,031.00	8.01
16	600030	中信证券	11,623,739.00	7.70

			0	
17	600690	海尔智家	11,463,207.0	7.60
			0	
18	603501	韦尔股份	11,245,629.4	7.45
			6	
19	600309	万华化学	11,070,063.6	7.34
			4	
20	688363	华熙生物	10,579,254.1	7.01
			5	
21	601628	中国人寿	10,544,597.0	6.99
			0	
22	600031	三一重工	10,517,219.0	6.97
			0	
23	600028	中国石化	10,180,974.0	6.75
			0	
24	601857	中国石油	10,120,862.0	6.71
			0	
25	000651	格力电器	10,055,319.0	6.66
			0	
26	601601	中国太保	9,995,879.00	6.62
27	601899	紫金矿业	9,811,823.00	6.50
28	003816	中国广核	9,623,358.00	6.38
29	000063	中兴通讯	9,601,229.00	6.36
30	002241	歌尔股份	9,438,166.00	6.26
31	600019	宝钢股份	9,407,741.00	6.23
32	601877	正泰电器	9,275,265.00	6.15
33	601633	长城汽车	9,192,279.74	6.09
34	002422	科伦药业	9,045,986.00	6.00
35	600900	长江电力	8,930,566.00	5.92
36	601229	上海银行	8,856,284.12	5.87
37	601288	农业银行	8,782,824.00	5.82
38	601668	中国建筑	8,753,805.00	5.80
39	000963	华东医药	8,663,859.23	5.74
40	603198	迎驾贡酒	8,612,659.16	5.71
41	601658	邮储银行	8,481,148.00	5.62
42	600406	国电南瑞	8,345,898.60	5.53
43	601225	陕西煤业	8,226,869.00	5.45
44	600362	江西铜业	8,008,893.00	5.31
45	601138	工业富联	7,894,242.00	5.23
46	600887	伊利股份	7,822,510.00	5.18
47	000807	云铝股份	7,816,412.00	5.18
48	300408	三环集团	7,775,917.00	5.15
49	601728	中国电信	7,701,783.00	5.10

50	601600	中国铝业	7,620,150.00	5.05
51	601939	建设银行	7,567,888.00	5.02
52	600015	华夏银行	7,549,723.60	5.00
53	600919	江苏银行	7,517,500.00	4.98
54	300433	蓝思科技	7,506,711.00	4.98
55	601088	XD 中国神华	7,452,143.00	4.94
56	000338	潍柴动力	7,379,422.40	4.89
57	002537	海联金汇	7,372,729.00	4.89
58	601818	光大银行	7,362,848.00	4.88
59	000538	云南白药	7,340,904.60	4.87
60	002120	韵达股份	7,340,693.00	4.87
61	601988	中国银行	7,265,582.00	4.82
62	600489	中金黄金	7,192,639.22	4.77
63	600018	上港集团	7,125,762.00	4.72
64	601390	中国中铁	7,121,746.00	4.72
65	601766	中国中车	7,119,335.00	4.72
66	601186	中国铁建	7,026,894.00	4.66
67	601985	中国核电	6,997,856.00	4.64
68	601319	中国人保	6,964,113.00	4.62
69	600332	白云山	6,870,351.00	4.55
70	000830	鲁西化工	6,838,159.00	4.53
71	600027	华电国际	6,780,314.00	4.49
72	600183	生益科技	6,761,932.00	4.48
73	002601	龙佰集团	6,618,986.00	4.39
74	600011	华能国际	6,463,229.00	4.28
75	002340	格林美	6,448,205.45	4.27
76	600023	浙能电力	6,444,811.00	4.27
77	603345	安井食品	6,359,067.00	4.21
78	600875	东方电气	6,277,036.91	4.16
79	002001	新 和 成	6,251,489.00	4.14
80	601336	新华保险	6,190,981.39	4.10
81	600050	中国联通	6,122,325.00	4.06
82	600760	中航沈飞	5,998,631.00	3.98
83	002468	申通快递	5,987,030.00	3.97
84	002292	奥飞娱乐	5,972,439.00	3.96
85	600436	片仔癀	5,925,828.00	3.93
86	000786	北新建材	5,903,658.00	3.91
87	601169	北京银行	5,868,074.00	3.89
88	601898	中煤能源	5,825,618.00	3.86
89	300999	金龙鱼	5,815,281.00	3.85
90	300760	迈瑞医疗	5,760,121.00	3.82
91	600941	中国移动	5,724,226.00	3.79
92	600096	云天化	5,661,704.00	3.75

93	603296	华勤技术	5,606,476.60	3.72
94	601615	明阳智能	5,494,429.00	3.64
95	002142	宁波银行	5,397,715.00	3.58
96	601328	交通银行	5,344,548.28	3.54
97	300442	润泽科技	5,343,049.00	3.54
98	300498	温氏股份	5,236,762.21	3.47
99	002594	比亚迪	5,218,545.00	3.46
100	603993	XD 洛阳钼业	5,180,250.00	3.43
101	002938	鹏鼎控股	5,084,980.00	3.37
102	601688	华泰证券	5,041,162.00	3.34
103	601991	大唐发电	5,036,527.00	3.34
104	300059	东方财富	4,995,696.00	3.31
105	600795	国电电力	4,971,880.00	3.30
106	002384	东山精密	4,818,165.00	3.19
107	688036	传音控股	4,806,532.38	3.19
108	002249	大洋电机	4,793,050.01	3.18
109	601816	京沪高铁	4,769,934.00	3.16
110	000630	铜陵有色	4,617,474.00	3.06
111	601006	大秦铁路	4,567,426.00	3.03
112	688111	金山办公	4,519,651.88	3.00
113	600188	DR 兖矿能源	4,495,384.00	2.98
114	002352	顺丰控股	4,475,336.00	2.97
115	601669	中国电建	4,412,963.00	2.92
116	300136	信维通信	4,379,015.00	2.90
117	601577	长沙银行	4,355,382.00	2.89
118	300014	亿纬锂能	4,351,922.00	2.88
119	002410	广联达	4,351,014.00	2.88
120	000596	古井贡酒	4,332,014.00	2.87
121	002179	中航光电	4,301,167.00	2.85
122	600048	保利发展	4,201,272.00	2.78
123	000100	TCL 科技	4,165,439.00	2.76
124	600104	上汽集团	4,114,084.00	2.73
125	603228	景旺电子	4,031,005.00	2.67
126	688009	中国通号	4,019,440.18	2.66
127	300233	金城医药	3,950,837.17	2.62
128	688088	虹软科技	3,888,466.85	2.58
129	601238	广汽集团	3,874,191.00	2.57
130	000930	中粮科技	3,840,876.00	2.55
131	600926	杭州银行	3,831,159.00	2.54
132	600660	福耀玻璃	3,829,010.00	2.54
133	688728	格科微有限公司	3,807,006.84	2.52
134	603288	海天味业	3,794,739.00	2.51

135	601800	中国交建	3,791,483.00	2.51
136	000617	中油资本	3,785,057.00	2.51
137	600315	上海家化	3,743,795.00	2.48
138	600602	云赛智联	3,700,819.00	2.45
139	002237	恒邦股份	3,575,731.00	2.37
140	600776	东方通信	3,565,636.00	2.36
141	601607	上海医药	3,367,466.00	2.23
142	603299	苏盐井神	3,276,863.00	2.17
143	002284	亚太股份	3,253,111.00	2.16
144	603019	中科曙光	3,240,598.00	2.15
145	600600	青岛啤酒	3,182,473.00	2.11
146	603317	天味食品	3,178,741.40	2.11
147	000625	长安汽车	3,174,282.00	2.10
148	300229	拓尔思	3,161,189.00	2.10
149	002612	朗姿股份	3,160,825.00	2.09
150	002519	银河电子	3,140,034.00	2.08
151	002897	意华股份	3,127,161.00	2.07
152	000021	深科技	3,123,811.00	2.07
153	001979	招商蛇口	3,094,313.00	2.05
154	002202	金风科技	3,069,181.80	2.03

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	300750	宁德时代	9,294,152.60	6.16
2	601601	中国太保	8,971,596.00	5.95
3	688363	华熙生物	8,501,431.38	5.63
4	000963	华东医药	8,259,206.00	5.47
5	601766	中国中车	7,875,989.00	5.22
6	600276	恒瑞医药	7,827,797.60	5.19
7	002475	立讯精密	7,577,304.00	5.02
8	601888	中国中免	7,209,899.00	4.78
9	601088	XD 中国神华	7,150,630.53	4.74
10	603198	迎驾贡酒	6,966,438.52	4.62
11	600887	伊利股份	6,752,176.00	4.47
12	601985	中国核电	6,715,092.00	4.45
13	601138	工业富联	6,658,596.00	4.41
14	601818	光大银行	6,565,669.00	4.35
15	000338	潍柴动力	6,486,747.00	4.30

16	002938	鹏鼎控股	6,478,933.00	4.29
17	300433	蓝思科技	6,445,441.00	4.27
18	600309	万华化学	6,341,352.00	4.20
19	600690	海尔智家	6,289,698.00	4.17
20	600036	招商银行	6,253,993.00	4.14
21	601628	中国人寿	6,248,977.00	4.14
22	601899	紫金矿业	6,183,775.00	4.10
23	601288	农业银行	6,079,511.00	4.03
24	601615	明阳智能	6,016,889.00	3.99
25	002537	海联金汇	5,989,430.40	3.97
26	601728	中国电信	5,922,255.00	3.92
27	601318	中国平安	5,914,586.00	3.92
28	603993	XD 洛阳钼业	5,856,017.00	3.88
29	002384	东山精密	5,715,117.00	3.79
30	000651	格力电器	5,550,243.00	3.68
31	603345	安井食品	5,546,284.56	3.68
32	000858	五粮液	5,506,560.00	3.65
33	000333	美的集团	5,491,030.00	3.64
34	600489	中金黄金	5,483,409.00	3.63
35	300760	迈瑞医疗	5,259,173.00	3.49
36	601857	中国石油	5,157,067.00	3.42
37	000001	平安银行	5,093,880.00	3.38
38	603501	韦尔股份	4,984,403.30	3.30
39	600519	贵州茅台	4,937,105.00	3.27
40	000100	TCL 科技	4,830,977.00	3.20
41	601328	交通银行	4,798,795.86	3.18
42	601658	邮储银行	4,761,227.00	3.16
43	002001	新和成	4,758,154.00	3.15
44	300014	亿纬锂能	4,681,490.00	3.10
45	601390	中国中铁	4,676,409.00	3.10
46	600941	中国移动	4,671,142.00	3.10
47	603228	景旺电子	4,631,432.00	3.07
48	000807	云铝股份	4,627,785.44	3.07
49	600028	中国石化	4,605,823.00	3.05
50	600809	山西汾酒	4,605,660.00	3.05
51	601939	建设银行	4,581,687.38	3.04
52	600919	江苏银行	4,580,099.00	3.04
53	002415	海康威视	4,486,399.00	2.97
54	000617	中油资本	4,383,292.00	2.91
55	688009	中国通号	4,363,763.92	2.89
56	002179	中航光电	4,343,155.00	2.88
57	688111	金山办公	4,304,928.37	2.85
58	600018	上港集团	4,302,804.00	2.85

59	600875	东方电气	4,300,441.00	2.85
60	603259	药明康德	4,289,701.00	2.84
61	600188	DR 兖矿能源	4,257,141.00	2.82
62	600019	宝钢股份	4,205,614.00	2.79
63	002340	格林美	4,178,385.00	2.77
64	601988	中国银行	4,177,600.00	2.77
65	601998	中信银行	4,156,735.00	2.75
66	300136	信维通信	4,147,959.00	2.75
67	000630	铜陵有色	4,096,757.00	2.72
68	600050	中国联通	4,008,895.00	2.66
69	002142	宁波银行	3,958,506.46	2.62
70	300999	金龙鱼	3,938,520.00	2.61
71	600332	白云山	3,905,745.00	2.59
72	601398	工商银行	3,893,950.00	2.58
73	600104	上汽集团	3,852,844.00	2.55
74	002594	比亚迪	3,845,950.00	2.55
75	601166	兴业银行	3,824,691.00	2.53
76	600150	中国船舶	3,745,456.00	2.48
77	600031	三一重工	3,716,489.00	2.46
78	600900	长江电力	3,694,441.00	2.45
79	300442	润泽科技	3,690,370.00	2.45
80	600023	浙能电力	3,679,611.50	2.44
81	601006	大秦铁路	3,660,134.00	2.43
82	300233	金城医药	3,653,045.00	2.42
83	002410	广联达	3,632,420.00	2.41
84	600760	中航沈飞	3,627,325.00	2.40
85	002916	深南电路	3,625,856.00	2.40
86	002249	大洋电机	3,625,085.00	2.40
87	600315	上海家化	3,578,588.00	2.37
88	000725	京东方 A	3,574,878.00	2.37
89	601607	上海医药	3,545,631.00	2.35
90	600776	东方通信	3,519,722.00	2.33
91	600406	国电南瑞	3,519,291.40	2.33
92	601633	长城汽车	3,512,118.00	2.33
93	300498	温氏股份	3,494,982.00	2.32
94	600183	生益科技	3,492,254.62	2.31
95	600030	中信证券	3,444,859.00	2.28
96	600795	国电电力	3,438,750.00	2.28
97	600027	华电国际	3,422,135.00	2.27
98	600600	青岛啤酒	3,357,355.00	2.23
99	600362	江西铜业	3,340,786.00	2.21
100	603288	海天味业	3,334,897.00	2.21
101	601577	长沙银行	3,291,193.00	2.18

102	002736	国信证券	3,249,432.00	2.15
103	300059	东方财富	3,238,599.00	2.15
104	002601	龙佰集团	3,227,679.00	2.14
105	601688	华泰证券	3,226,765.00	2.14
106	000021	深科技	3,216,684.00	2.13
107	603299	苏盐井神	3,212,774.00	2.13
108	000830	鲁西化工	3,191,170.00	2.11
109	600016	民生银行	3,181,355.80	2.11
110	000625	长安汽车	3,134,738.00	2.08
111	688728	格科微有限公司	3,108,332.52	2.06
112	000568	泸州老窖	3,101,816.00	2.06
113	600660	福耀玻璃	3,069,717.76	2.03
114	002237	恒邦股份	3,066,258.00	2.03
115	001979	招商蛇口	3,046,620.00	2.02
116	002202	金风科技	3,042,401.00	2.02
117	600011	华能国际	3,041,326.00	2.02
118	603296	华勤技术	3,033,027.00	2.01

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	1,744,684,700.64
卖出股票收入（成交）总额	1,200,054,532.72

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

本基金可参与股指期货交易。若本基金参与股指期货交易，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

本基金可参与国债期货交易。若本基金参与国债期货交易，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中国工商银行股份有限公司，2023 年 7 月至 2024 年 6 月期间，其分支行多次因业务违规、报送违规等被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行罚款、警示等；2024 年 3 月因违规办理结汇被国家外汇管理局没收违法所得。

本基金持有的前十名证券发行主体招商银行股份有限公司，2023 年 7 月至 2024 年 6 月期间，其分支行多次因业务违规、报送违规等被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局罚款、警示等

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	1,122,867.90
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,990,480.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,113,348.18

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
国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	7,978	27,544.63	158,666,138.33	72.20%	61,084,941.74	27.80%
国泰君	3,424	166,267.2	333,012,683.5	58.50%	236,286,215.2	41.50%

安沪深 300 指数增强发起 C		0	5		5	
合计	11,402	69,202.77	491,678,821.88	62.31%	297,371,156.99	37.69%

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）。

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	国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	360,444.82	0.1640%
	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C	7,587.03	0.0013%
	合计	368,031.85	0.0466%

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）。

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	10~50
	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	10~50
	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C	0
	合计	10~50

注：同时为基金管理人高级管理人员（含基金投资和研发部门负责人）和基金经理的，其持有份额总量的数量区间分别计算在内。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	15,019,000.00	1.90%	15,019,000.00	1.90%	自基金合同生效日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	190,474.27	0.02%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	177,557.58	0.02%	-	-	-
合计	15,387,031.85	1.94%	15,019,000.00	1.90%	-

注：其他为公司普通员工持有份额，持有期限为不低于 6 个月。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C
基金合同生效日（2023 年 04 月 19 日）基金份额总额	10,009,999.00	5,010,000.00
本报告期期初基金份额总额	64,205,788.82	106,779,627.00
本报告期基金总申购份额	188,678,219.89	552,576,300.52
减：本报告期基金总赎回份额	33,132,928.64	90,057,028.72
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	219,751,080.07	569,298,898.80

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。

§ 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：

2024 年 2 月 28 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高级管理人员变更公告》。自 2024 年 2 月 26 日起叶明同志代为履行公司首席信息官，朱晓力同志不再担任公司首席信息官职务。

2024 年 3 月 20 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基金行业高级管理人员变更公告》。自 2024 年 3 月 18 日起陶耿同志兼任公司财务负责人，叶明同志不再兼任公司财务负责人职务。

2024 年 3 月 20 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基金行业高级管理人员变更公告》。自 2024 年 3 月 18 日起吕巍同志兼任公司首席风险官，叶明同志不再兼任公司首席风险官职务。

2、报告期内，基金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

报告期内，本基金无涉及基金管理人、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

报告期内，本基金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

报告期内，本基金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	交易单	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
-----	-----	------	-----------	----

称	元数量	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	2,944,285,987.60	100.00%	232,970.38	100.00%	-

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	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年第 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	2024-01-22
2	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-01-22
3	上海国泰君安证券资产管理有限公司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、上交所	2024-02-28
4	上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业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、上交所	2024-03-20
5	上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业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、上交所	2024-03-20
6	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-03-29
7	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 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	2024-03-29
8	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-04-18
9	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-04-18
10	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 1 号）	证监会指定网站、公司官网	2024-04-18
11	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年	证监会指定网站、公司官网	2024-04-22

	第 1 季度报告		
12	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年第 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	2024-04-22
13	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-06-28
14	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-06-28

§ 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

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	20240101-20240204	35,982,312.37	-	20,963,312.37	15,019,000.00	1.90%
	2	20240101-20240527	46,412,941.29	48,085,612.95	-	94,498,554.24	11.98%
	3	20240101-20240121, 20240126-20240129	34,714,824.66	-	-	34,714,824.66	4.40%

产品特有风险

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：

(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；

(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；

(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；

(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；

(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。

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、关于准予国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复；
- 2、《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、法律意见书；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

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
二〇二四年八月三十日