

国泰君安中证 500 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:上海银行股份有限公司

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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月29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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	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	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§ 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	14
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	15
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	15
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	15
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
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	66
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	66
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	67
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	67
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	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	67

§ 8 基金份额持有人信息	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
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	69
§ 9 开放式基金份额变动	69
§ 10 重大事件揭示	70
10.1 基金份额持有人大会决议	70
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	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
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	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
10.8 其他重大事件	71
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	72
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	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	国泰君安中证 500 指数增强	
基金主代码	014155	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 15 日	
基金管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,719,506,577.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安中证 500 指数增强 A	国泰君安中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	014155	014156
报告期末下属分级基金的份额总额	1,112,207,130.51 份	607,299,446.57 份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金为增强型股票指数基金，通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。</p>
投资策略	<p>本基金为增强型指数产品，在标的指数成份券权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。</p> <p>股票投资策略为本基金的核心策略，主要包括以下几个方面：</p> <p>1) 行业配置</p> <p>本基金在行业配置方面尽量遵循基准指数的行业市值占比，尽量控制投资组合相对于基准指数的行业暴露带来的风险损失。</p> <p>2) 个股选择</p> <p>本基金根据股票库中可选投资标的期望收益率、流动性和市场风险偏好等要素选择风险收益比最具吸引力的个股，并根据投资标的公司股价主要驱动因素的变化动态调整投资组合，而在投资组合管理层面需要充分考虑其相对于中证 500 指数的风险偏离度。</p> <p>A、股票池的建立</p> <p>考虑到 Alpha 选股模型的强度理论上正比于投资广度的平方根(选股的范围)，本基金在策略选股的覆盖面上尽量保留符合风控和流动性等要求的所有股票。基于这样的理念，模型训练和投资组合</p>

	<p>管理模型覆盖的股票较广，基本上能覆盖市场上六成以上的股票，但是根据可交易性、个股的历史长度以及风控要求，一般情况下会剔除如下股票：上市时间较短的次新股；在过去一段时间流动性和规模综合排名市场排名相对靠后；被交易所标注 ST、即将退市、业绩有连续亏损风险或者被证监会立案调查或者出具警示函等高风险的股票；根据市场政策变化，主要基于流动性考虑需要额外剔除的股票等。</p> <p>B、选股策略</p> <p>本基金通过具有前瞻性、差异性和时效性的研究，致力于通过智能化的模型和全方位覆盖的股票因子特征来捕捉市场短期失效带来的盈利空间。本基金通过对股票库中可选投资标的公司中短期的期望收益率、股票有效流动性、市场风险偏好等核心要素的综合比较，选择风险收益比最具吸引力的个股，并根据投资标的公司股价的中短期主要驱动因素的变化动态调整投资组合构成。本基金的选股策略以低中高等不同调仓频率的多因子选股策略为主，多因子策略投资的详细过程需要分成因子库的维护、股票池的选择、模型的训练和个股信号预测、投资组合生成、策略库的维护和策略配置等几个环节。因子库全方位覆盖股票的日频交易数据相关因子、股票定期报告衍生因子、分析师报告衍生因子、事件驱动合成因子、股票高频交易数据相关因子以及互联网和舆情数据因子等。在多因子模型算法层面，以人工智能选股模型为核心，并基于股票市场的高噪音和时序性的特征，构建多维度阿尔法预测模型。在投资组合层面，均严格控制其相对于基准指数在市场主要风险因子的风险暴露程度，通过配套的风险模型和组合优化模型得到不同调仓频率的投资组合，并在基金中进行相对均衡的配置。</p> <p>本基金的投资策略还包括：债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略和可转换债券、可交换债券的投资策略。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海国泰君安证券资产管理有限公司	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	周直毅
	联系电话	021-38676022	021-68475608
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	custody@boscn.cn
客户服务电话		95521	95594

传真	021-38871190	021-68476936
注册地址	上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号
办公地址	上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号
邮政编码	200120	200120
法定代表人	陶耿	金煜

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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 500 指数增强 A	国泰君安中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	43,144,501.39	27,152,386.55
本期利润	47,592,421.11	31,906,884.57
加权平均基金份额本期利润	0.0494	0.0549
本期加权平均净值利润率	5.13%	5.72%
本期基金份额净值增长率	6.40%	6.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-47,418,330.02	-29,469,710.46
期末可供分配基金份额利润	-0.0426	-0.0485
期末基金资产净值	1,064,788,800.49	577,829,736.11

期末基金份额净值	0.9574	0.9515
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-4.26%	-4.85%

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 500 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	1.13%	0.88%	-0.77%	0.89%	1.90%	-0.01%
过去三个月	-2.61%	0.76%	-5.10%	0.78%	2.49%	-0.02%
过去六个月	6.40%	0.75%	2.20%	0.75%	4.20%	0.00%
过去一年	-1.28%	0.92%	-6.65%	0.91%	5.37%	0.01%
自基金合同生效起至今	-4.26%	1.15%	-17.14%	1.14%	12.88%	0.01%

国泰君安中证 500 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	1.09%	0.88%	-0.77%	0.89%	1.86%	-0.01%
过去三个月	-2.72%	0.75%	-5.10%	0.78%	2.38%	-0.03%
过去六个月	6.19%	0.75%	2.20%	0.75%	3.99%	0.00%
过去一年	-1.67%	0.92%	-6.65%	0.91%	4.98%	0.01%
自基金合同生效起至今	-4.85%	1.14%	-17.14%	1.14%	12.29%	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

国泰君安中证500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
(2021年12月15日-2023年06月30日)



国泰君安中证500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
(2021年12月15日-2023年06月30日)



§ 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。	2021-12-15	-	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。

从中证 500 指数当前的估值水平来看，截至 6 月底其整体 PE 在 23 倍左右，依然处于历史较为低估的水平，在历史上的分位数低于 15%，从业绩的可持续角度来看，估值进一步向下的空间要显著小于向上的空间。今年市场中小市值股票表现优异，支撑了我们之前对中证 500 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。我们认为做为一个价值股和成长股、周期股和非周期股、新兴行业和传统行业均相对均衡的中盘宽基指数，中证 500 指数依然是当前市场环境下进可攻、退可守的选择。

我们预计，未来一年市场依然会保持风格切换较快的特点，且市场热点依然较为分散，相对于主观选股来说，量化投资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。在量化增强层面，我们尽量结合以财务数据为基础的基本面信号和以高频量价为主的技术面信号，通过机器学习模型来进行有效因子的选择和因子之间的轮动，并通过投资组合管理模型严格控制投资组合在主要市场风险和行业上相对于基准指数的暴露程度。今年以来由于估值等大类因子较为显著的改善，使得基本面量化等低频策略相对于高频量价等高换手策略并无劣势，本基金在两者上进行了均衡配置，力求以较为稳定的方式对中证 500 指数进行增强。

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 500 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 500 指数增强 A 基金份额净值为 0.9574 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 6.40%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%；截至报告期末国泰君安中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 0.9515 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 6.19%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年，A 股市场以一季度的快速上涨开始，逐渐调整到二季度的震荡行情为主。主要是由于二季度国内经济复苏不及预期、海外地缘政治紧张和人民币贬值等因素，压制了 A 股市场情绪和投资活跃度。具体而言，2023 年一季度较高的经济复苏预期带动市场上涨，而进入二季度，随着经济数据的出炉，金融、通胀数据均回落，显示了经济内生动能不强，复苏斜率放缓，市场情绪受到压制。同时海外银行业危机和债务违约风险持续发酵，引发市场担忧加剧，各板块均迎来快速调整。

从中长期的角度来看，在当前时间点我们依然坚定地看好中证 500 指数未来的走势，主要有以下几个理由：首先，从历史相对估值（加权 PE）的角度来看，中证 500 指数依然是几个主要宽基指数中最低估的指数之一，历史上只有约 15% 的时间比当前的估值更低，也为后续估值和盈利的双击创造了较好的基本面条件；其次，中证 500 成分股涵盖了二线蓝筹或细分行业的龙头公司，优质的基本面对机构具有较好的配置价值，相对于大盘股也具有更大的市值空间；最后，中证 500 指数在周期和非周期、价值和成长、新兴行业和传统行业等方面的分布均较为平衡，在各种不同市场环境下进可攻退可守。

展望后市，A 股权益市场估值刚离开历史低位区域，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，市场预期美联储加息周期逐步接近尾声，引来美元指数和美债利率的进一步走弱，有助于海外资金加速回流 A 股。国内方面，政策重心从供给端的降本增效转向需求端的扩大内需，宽货币和宽信用的政策使得流动性延续充裕，有利于 A 股企业盈利修复和提振市场情绪。整体来看，当前市场估值已经体现了上半年经济修复不及预期，下半年在宽货币的宏观环境下，企业盈利修复的确定性较高，A 股整体有望呈现震荡向上。我们希望通过选择基本面和技术面共振的股票来博取较为稳定的超额收益，在中证 500 指数的基础上不断提升业绩表现，坚持长期主义，为客户获取优异稳定的超额回报。

4.6 管理人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

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

本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 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 500 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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	99,465,840.28	82,350,580.82
结算备付金		11,139,173.50	6,469,542.93
存出保证金		4,271,568.00	2,796,309.60
交易性金融资产	6.4.7.2	1,517,310,264.42	1,162,187,263.14
其中：股票投资		1,517,310,264.42	1,162,187,263.14
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	-	-
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		14,739,303.90	1,484,101.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,646,926,150.10	1,255,287,798.18
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,448,312.61	3,231,908.38
应付管理人报酬		1,317,616.41	969,871.11
应付托管费		197,642.48	145,480.67
应付销售服务费		182,643.26	143,036.49
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	161,398.74	125,304.18
负债合计		4,307,613.50	4,615,600.83
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,719,506,577.08	1,392,254,275.35
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-76,888,040.48	-141,582,078.00
净资产合计		1,642,618,536.60	1,250,672,197.35
负债和净资产总计		1,646,926,150.10	1,255,287,798.18

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,719,506,577.08 份。其中国泰君安中证 500 指数增强 A 基金份额净值 0.9574 元，基金份额总额 1,112,207,130.51 份；国泰君安中证 500 指数增强 C 基金份额净值 0.9515 元，基金份额总额 607,299,446.57 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：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	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
一、营业总收入		89,160,093.04	-43,002,479.50
1. 利息收入		368,891.67	226,299.47
其中：存款利息收入	6.4.7.9	368,891.67	226,299.47
债券利息收入		-	0
资产支持证券利息收入		-	0
买入返售金融资产收入		-	0
证券出借利息收入		-	0
其他利息收入		-	0
2. 投资收益（损失以“-”填列）		78,697,035.69	-53,778,364.39
其中：股票投资收益	6.4.7.10	62,637,871.64	-60,734,121.81
基金投资收益		-	0
债券投资收益		-	0
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	0
衍生工具收益	6.4.7.11	965,089.34	-951,823.53
股利收益	6.4.7.12	15,094,074.71	7,907,580.95
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	0
其他投资收益		-	0
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	9,202,417.74	10,124,371.01
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	891,747.94	425,214.41
减：二、营业总支出		9,660,787.36	7,117,317.93

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,360,068.50	5,425,741.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,104,010.31	813,861.18
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,107,475.15	814,456.67
4. 投资顾问费		-	0
5. 利息支出		-	0
其中：卖出回购金融资产支出		-	0
6. 信用减值损失		-	0
7. 税金及附加		4,855.84	0
8. 其他费用	6.4.7.15	84,377.56	63,258.62
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		79,499,305.68	-50,119,797.43
减：所得税费用		-	0
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		79,499,305.68	-50,119,797.43
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		79,499,305.68	-50,119,797.43

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：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）	1,392,254,275.35	-	-141,582,078.00	1,250,672,197.35
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,392,254,275.35	-	-141,582,078.00	1,250,672,197.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	327,252,301.73	-	64,694,037.52	391,946,339.25

(一)、综合收益总额	-	-	79,499,305.68	79,499,305.68
(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)	327,252,301.73	-	-14,805,268.16	312,447,033.57
其中: 1. 基金申购款	980,919,980.83	-	-36,352,558.30	944,567,422.53
2. 基金赎回款	-653,667,679.10	-	21,547,290.14	-632,120,388.96
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,719,506,577.08	-	-76,888,040.48	1,642,618,536.60
项 目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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)	1,161,946,276.66	-	17,254,268.47	1,179,200,545.13
加: 会计政策变更	-	-	0	0
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,161,946,276.66	-	17,254,268.47	1,179,200,545.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	179,504,939.66	-	-58,759,064.01	120,745,875.65
(一)、综合收益总额	-	-	-50,119,797.43	-50,119,797.43
(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)	179,504,939.66	-	-8,639,266.58	170,865,673.08
其中: 1. 基金申购款	445,855,881.43	-	-33,108,680.59	412,747,200.84
2. 基金赎回款	-266,350,941.77	-	24,469,414.01	-241,881,527.76
(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)	0	-	0	0
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,341,451,216.32	-	-41,504,795.54	1,299,946,420.78

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 500 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 500 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【2021】3391 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 1,160,704,146.74 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 500 指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2021 年 12 月 15 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,基金托管人为上海银行股份有限公司。

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,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份券(包括存托凭证)、备选成份券(包括存托凭证)、其他国内依法发行上市的股票和存托凭证(包括主板、创业板和其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转换债)、可交换债、次级债、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、中期票据等)、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。

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

基金的投资组合比例为:本基金投资于股票、存托凭证资产的比例不低于基金资产的 80%,投资于中证 500 指数成份券及其备选成份券的资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

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、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	52,851,627.92
等于：本金	52,838,095.79
加：应计利息	13,532.13
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	46,614,212.36
等于：本金	46,608,398.62
加：应计利息	5,813.74
减：坏账准备	-
合计	99,465,840.28

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	1,531,946,872.35	-	1,517,310,264.42	-14,636,607.93
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,531,946,872.35	-	1,517,310,264.42	-14,636,607.93

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			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	

利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	35,587,247.17	0.00	-	-
股指期货	35,587,247.17	0.00	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	35,587,247.17	-	-	-

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
IC2307	IC2307	3	3,594,480.00	37,032.66
IC2308	IC2308	1	1,196,080.00	13,040.00
IC2312	IC2312	26	30,805,840.00	-40,919.83
合计				9,152.83
减：可抵销期货暂收款				9,152.83
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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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	1,076.18
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	134,507.37
预提审计费	24,795.19
其他应付	1,020.00
合计	161,398.74

6.4.7.7 实收基金

国泰君安中证 500 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	855,925,363.63	855,925,363.63
本期申购	452,474,418.09	452,474,418.09
本期赎回（以“-”号填列）	-196,192,651.21	-196,192,651.21
本期末	1,112,207,130.51	1,112,207,130.51

国泰君安中证 500 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	536,328,911.72	536,328,911.72
本期申购	528,445,562.74	528,445,562.74
本期赎回（以“-”号填列）	-457,475,027.89	-457,475,027.89
本期末	607,299,446.57	607,299,446.57

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 500 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	-67,351,917.65	-18,453,696.61	-85,805,614.26
本期利润	43,144,501.39	4,447,919.72	47,592,421.11
本期基金份额交易产生的变动数	-5,804,091.50	-3,401,045.37	-9,205,136.87
其中：基金申购款	-10,280,616.41	-4,979,993.87	-15,260,610.28
基金赎回款	4,476,524.91	1,578,948.50	6,055,473.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-30,011,507.76	-17,406,822.26	-47,418,330.02

国泰君安中证 500 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	-44,240,537.77	-11,535,925.97	-55,776,463.74
本期利润	27,152,386.55	4,754,498.02	31,906,884.57
本期基金份额交易产生的变动数	-2,898,858.62	-2,701,272.67	-5,600,131.29
其中：基金申购款	-13,766,891.37	-7,325,056.65	-21,091,948.02
基金赎回款	10,868,032.75	4,623,783.98	15,491,816.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-19,987,009.84	-9,482,700.62	-29,469,710.46

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	169,702.06
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	108,061.29
结算备付金利息收入	91,128.32
其他	-
合计	368,891.67

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	19,288,804,953.33
减：卖出股票成本总额	19,201,052,210.68
减：交易费用	25,114,871.01
买卖股票差价收入	62,637,871.64

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	1,074,633.94
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	40,465.25
减：交易费用	69,079.35
合计	965,089.34

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	15,094,074.71
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	15,094,074.71

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	9,154,211.68
——股票投资	9,154,211.68
——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	48,206.06
——权证投资	-
——期货投资	48,206.06
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	9,202,417.74

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	891,747.94
合计	891,747.94

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	75.00
合计	84,377.56

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
上海银行股份有限公司(以下简称“上海银行”)	基金托管人、代销机构
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		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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
国泰君安证券股份有限公司	38,829,083,621.74	100.00%	26,031,832,783.30	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	2,768,255.86	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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	1,683,804.49	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	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,360,068.50	5,425,741.46
其中：支付销售机构的客户维护费	2,171,617.23	2,579,717.01

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

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

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	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,104,010.31	813,861.18

注：支付基金托管人上海银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

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 500 指数增强 A	国泰君安中证 500 指数增强 C	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	580,897.02	580,897.02
上海国泰君安证券资产管理有限公司	-	243,685.23	243,685.23
上海银行股份有限公司	-	592.24	592.24
合计	-	825,174.49	825,174.49
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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 500 指数增强 A	国泰君安中证 500 指数增强 C	合计
国泰君安证券股份有限公司	0.00	729,083.52	729,083.52
上海国泰君安证券资产管理有限公司	0.00	430.25	430.25
上海银行股份有限公司	0.00	33,377.18	33,377.18
合计	0.00	762,890.95	762,890.95

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国泰君安资管，再由国泰君安资管计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X0.40%/当年天数。

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自有资金投资本基金的情况

国泰君安中证 500 指数增强 A

份额单位：份

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2021 年 12 月 15 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,999,450.00	9,999,450.00
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	9,999,450.00	9,999,450.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.90%	1.14%

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		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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
上海银行股份有限公司	52,851,627.92	169,702.06	48,414,073.44	79,788.2
国泰君安证券股份有限公司	46,614,212.36	108,061.29	37,813,391.13	94,138.53

注：本基金的银行存款由基金托管人上海银行保管，按银行同业利率计息。本基金的其他存款由基金结算机构国泰君安证券保管，按协议约定利率计息。

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

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
688472	阿特斯	2023 年 06 月 02 日	6 个月	科创板打新限售	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
688603	天承科技	2023 年 06 月 30 日	6 个月	科创板打新限售	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
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	-
301358	湖南裕能	2023 年 02 月 01 日	6 个月	创业板打新限售	23.77	42.89	1,779	42,286.83	76,301.31	-
688484	南芯科技	2023 年 03 月 28 日	6 个月	科创板打新限售	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
688576	西山科	2023 年 05 月 30 日	6 个月	科创板打新限售	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-

	技			售						
301246	宏源药业	2023 年 03 月 10 日	6 个月	创业板打新限售	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
688352	硕中科技	2023 年 04 月 11 日	6 个月	科创板打新限售	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
301310	鑫宏业	2023 年 05 月 26 日	6 个月	创业板打新限售	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301293	三博脑科	2023 年 04 月 25 日	6 个月	创业板打新限售	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
688552	航天南湖	2023 年 05 月 08 日	6 个月	科创板打新限售	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688570	天玛智控	2023 年 05 月 29 日	6 个月	科创板打新限售	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
301322	绿通科技	2023 年 02 月 27 日	6 个月	创业板打新限售	131.11	53.24	391	34,219.71	20,816.84	-
688458	美芯晟	2023 年 05 月 15 日	6 个月	科创板打新限售	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688581	安杰思	2023 年 05 月 12 日	6 个月	科创板打新限售	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
301439	泓淋电力	2023 年 03 月 10 日	6 个月	创业板打新限售	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
688623	双元科	2023 年 05 月 31 日	6 个月	科创板打新限售	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-

	技			售						
301399	英特科技	2023 年 05 月 16 日	6 个月	创业板打新限售	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
688593	新相微	2023 年 05 月 25 日	6 个月	科创板打新限售	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	创业板打新限售	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
688433	华曙高科	2023 年 04 月 07 日	6 个月	科创板打新限售	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
301345	涛涛车业	2023 年 03 月 10 日	6 个月	创业板打新限售	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301315	威士顿	2023 年 06 月 13 日	6 个月	创业板打新限售	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301429	森泰股份	2023 年 04 月 10 日	6 个月	创业板打新限售	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
688631	莱斯信息	2023 年 06 月 19 日	6 个月	科创板打新限售	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
301376	致欧科技	2023 年 06 月 14 日	6 个月	创业板打新限售	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301323	新莱福	2023 年 05 月 29 日	6 个月	创业板打新限售	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能	2023 年 06 月 20 日	6 个月	科创板打新限售	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-

	源			售						
301170	锡南科技	2023 年 06 月 16 日	6 个月	创业板打新限售	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	创业板打新限售	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	科创板打新限售	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	创业板打新限售	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
001367	海森药业	2023 年 03 月 30 日	6 个月	股票流通受限	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证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上海银行股份有限公司，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	99,465,840.28	-	-	-	99,465,840.28
结算备付金	11,139,173.50	-	-	-	11,139,173.50
存出保证金	4,271,568.00	-	-	-	4,271,568.00
交易性金融 资产	-	-	-	1,517,310,264.42	1,517,310,264.42
应收申购款	-	-	-	14,739,303.90	14,739,303.90
资产总计	114,876,581.78	-	-	1,532,049,568.32	1,646,926,150.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,448,312.61	2,448,312.61
应付管理人 报酬	-	-	-	1,317,616.41	1,317,616.41
应付托管费	-	-	-	197,642.48	197,642.48
应付销售服 务费	-	-	-	182,643.26	182,643.26
其他负债	-	-	-	161,398.74	161,398.74
负债总计	-	-	-	4,307,613.50	4,307,613.50
利率敏感度 缺口	114,876,581.78	-	-	1,527,741,954.82	1,642,618,536.60
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	82,350,580.82	-	-	-	82,350,580.82
结算备付金	6,469,542.93	-	-	-	6,469,542.93
存出保证金	2,796,309.60	-	-	-	2,796,309.60
交易性金融 资产	-	-	-	1,162,187,263.14	1,162,187,263.14
应收申购款	-	-	-	1,484,101.69	1,484,101.69
资产总计	91,616,433.35	-	-	1,163,671,364.83	1,255,287,798.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,231,908.38	3,231,908.38
应付管理人	-	-	-	969,871.11	969,871.11

报酬					
应付托管费	-	-	-	145,480.67	145,480.67
应付销售服务费	-	-	-	143,036.49	143,036.49
其他负债	-	-	-	125,304.18	125,304.18
负债总计	-	-	-	4,615,600.83	4,615,600.83
利率敏感度缺口	91,616,433.35	-	-	1,159,055,764.00	1,250,672,197.35

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	1,517,310,264.42	92.37	1,162,187,263.14	92.93
交易性金融资产—基金投	-	-	-	-

资				
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,517,310,264.42	92.37	1,162,187,263.14	92.93

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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	82,259,653.28	61,633,390.40
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-82,259,653.28	-61,633,390.40

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	1,516,577,287.66	1,153,710,000.39
第二层次	76,505.00	7,200,604.32
第三层次	656,471.76	1,276,658.43
合计	1,517,310,264.42	1,162,187,263.14

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	1,517,310,264.42	92.13
	其中：股票	1,517,310,264.42	92.13
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	110,605,013.78	6.72
8	其他各项资产	19,010,871.90	1.15
9	合计	1,646,926,150.10	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	22,726,316.97	1.38
B	采矿业	71,722,976.21	4.37
C	制造业	784,542,428.31	47.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	49,607,870.91	3.02
E	建筑业	18,216,168.97	1.11
F	批发和零售业	9,751,362.40	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	10,929,204.73	0.67
H	住宿和餐饮业	4,964,066.20	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	53,804,568.04	3.28
J	金融业	121,927,246.97	7.42
K	房地产业	10,599,575.66	0.65
L	租赁和商务服务业	722,988.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	2,533,804.08	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	12,035,185.25	0.73
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	42,294,129.40	2.57
S	综合	5,507,772.69	0.34
	合计	1,221,885,664.79	74.39

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	15,699,762.00	0.96
C	制造业	202,369,977.77	12.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,434,123.86	0.27
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	14,015,665.20	0.85

G	交通运输、仓储和邮政业	15,980,831.66	0.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,258,128.02	0.69
J	金融业	944,095.00	0.06
K	房地产业	3,893,151.53	0.24
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	10,929,606.78	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	750,080.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	267,150.86	0.02
R	文化、体育和娱乐业	14,882,026.95	0.91
S	综合	-	-
	合计	295,424,599.63	17.98

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	002422	科伦药业	758,086	22,499,992.48	1.37
2	600489	中金黄金	2,003,940	20,700,700.20	1.26
3	002384	东山精密	784,700	20,323,730.00	1.24
4	601966	玲珑轮胎	847,825	18,838,671.50	1.15
5	002273	水晶光电	1,565,600	18,693,264.00	1.14
6	000997	新大陆	980,600	18,533,340.00	1.13
7	002531	天顺风能	1,188,500	18,100,855.00	1.10
8	002203	海亮股份	1,483,700	17,819,237.00	1.08
9	603228	景旺电子	676,200	17,344,530.00	1.06
10	603218	日月股份	908,637	17,255,016.63	1.05
11	600315	上海家化	593,107	17,206,034.07	1.05
12	000738	航发控制	698,468	17,042,619.20	1.04
13	000739	普洛药业	933,800	16,565,612.00	1.01
14	600166	福田汽车	4,850,600	16,492,040.00	1.00
15	600862	中航高科	645,600	16,340,136.00	0.99
16	600968	海油发展	5,144,600	15,793,922.00	0.96

17	002299	圣农发展	818,000	15,664,700.00	0.95
18	002745	木林森	1,633,200	15,025,440.00	0.91
19	600498	烽火通信	721,900	14,705,103.00	0.90
20	600642	申能股份	2,083,600	14,564,364.00	0.89
21	002563	森马服饰	2,328,600	14,483,892.00	0.88
22	002739	万达电影	1,150,700	14,429,778.00	0.88
23	688002	睿创微纳	321,175	14,388,640.00	0.88
24	603589	口子窖	291,487	14,384,883.45	0.88
25	600637	东方明珠	1,804,162	14,108,546.84	0.86
26	002600	领益智造	2,025,700	13,997,587.00	0.85
27	688006	杭可科技	459,153	13,990,391.91	0.85
28	601077	渝农商行	3,876,500	13,916,635.00	0.85
29	688029	南微医学	168,900	13,775,484.00	0.84
30	600329	达仁堂	303,100	13,606,159.00	0.83
31	600582	天地科技	2,321,792	13,536,047.36	0.82
32	600096	云天化	764,060	13,042,504.20	0.79
33	600863	内蒙华电	3,135,938	13,014,142.70	0.79
34	603517	绝味食品	350,291	13,013,310.65	0.79
35	000750	国海证券	3,877,048	12,988,110.80	0.79
36	000060	中金岭南	2,679,985	12,729,928.75	0.77
37	600909	华安证券	2,671,436	12,475,606.12	0.76
38	002056	横店东磁	671,100	12,220,731.00	0.74
39	000967	盈峰环境	2,383,205	12,035,185.25	0.73
40	000898	鞍钢股份	4,310,273	11,982,558.94	0.73
41	688208	道通科技	391,866	11,877,458.46	0.72
42	300136	信维通信	585,553	11,757,904.24	0.72
43	600535	天士力	800,220	11,611,192.20	0.71
44	600517	国网英大	2,008,400	11,447,880.00	0.70
45	603317	天味食品	777,551	11,360,020.11	0.69
46	000027	深圳能源	1,698,600	11,193,774.00	0.68
47	600418	江淮汽车	883,600	11,124,524.00	0.68
48	600271	航天信息	793,800	10,867,122.00	0.66
49	600373	中文传媒	796,600	10,610,712.00	0.65
50	000623	吉林敖东	655,250	10,510,210.00	0.64
51	002152	广电运通	886,000	10,383,920.00	0.63
52	601098	中南传媒	869,600	10,087,360.00	0.61
53	600885	宏发股份	313,778	9,993,829.30	0.61
54	600170	上海建工	3,689,900	9,925,831.00	0.60
55	601958	金铂股份	875,327	9,759,896.05	0.59
56	002511	中顺洁柔	867,900	9,677,085.00	0.59
57	600380	健康元	734,648	9,337,376.08	0.57
58	300383	光环新网	859,482	9,239,431.50	0.56
59	601000	唐山港	2,605,642	9,197,916.26	0.56

60	600528	中铁工业	927,000	9,158,760.00	0.56
61	603868	飞科电器	144,765	9,133,223.85	0.56
62	002966	苏州银行	1,393,015	9,124,248.25	0.56
63	600497	驰宏锌锗	1,759,578	8,833,081.56	0.54
64	600879	航天电子	1,032,756	8,768,098.44	0.53
65	002625	光启技术	568,400	8,673,784.00	0.53
66	688082	盛美上海	76,058	8,396,803.20	0.51
67	002065	东华软件	1,169,523	8,256,832.38	0.50
68	002500	山西证券	1,386,006	7,733,913.48	0.47
69	601108	财通证券	1,022,030	7,399,497.20	0.45
70	600820	隧道股份	1,225,572	7,365,687.72	0.45
71	000031	大悦城	1,997,601	7,311,219.66	0.45
72	601717	郑煤机	582,451	7,251,514.95	0.44
73	601928	凤凰传媒	628,621	7,166,279.40	0.44
74	600143	金发科技	818,200	7,142,886.00	0.43
75	000887	中鼎股份	541,018	7,081,925.62	0.43
76	000636	风华高科	461,346	7,077,047.64	0.43
77	600967	内蒙一机	687,700	6,945,770.00	0.42
78	600167	联美控股	991,725	6,912,323.25	0.42
79	688390	固德威	41,294	6,890,316.84	0.42
80	601555	东吴证券	930,234	6,455,823.96	0.39
81	600487	亨通光电	432,900	6,346,314.00	0.39
82	600597	光明乳业	589,500	6,130,800.00	0.37
83	600316	洪都航空	260,081	6,098,899.45	0.37
84	603858	步长制药	294,500	6,063,755.00	0.37
85	601636	旗滨集团	700,241	6,036,077.42	0.37
86	002025	航天电器	94,300	6,016,340.00	0.37
87	600109	国金证券	681,200	5,906,004.00	0.36
88	000783	长江证券	1,011,200	5,864,960.00	0.36
89	300438	鹏辉能源	122,050	5,863,282.00	0.36
90	002250	联化科技	548,500	5,737,310.00	0.35
91	000998	隆平高科	367,200	5,636,520.00	0.34
92	603883	老百姓	176,400	5,265,540.00	0.32
93	603737	三棵树	79,380	5,193,039.60	0.32
94	603456	九洲药业	182,292	4,991,154.96	0.30
95	600258	首旅酒店	261,956	4,964,066.20	0.30
96	000009	中国宝安	386,967	4,670,691.69	0.28
97	600549	厦门钨业	244,000	4,643,320.00	0.28
98	000728	国元证券	709,658	4,626,970.16	0.28
99	600390	五矿资本	842,000	4,529,960.00	0.28
100	301029	怡合达	101,222	4,522,598.96	0.28
101	002155	湖南黄金	356,300	4,346,860.00	0.26
102	300257	开山股份	278,668	4,227,393.56	0.26

103	600927	永安期货	245,700	3,995,082.00	0.24
104	600563	法拉电子	27,400	3,762,020.00	0.23
105	600956	新天绿能	422,900	3,687,688.00	0.22
106	300003	乐普医疗	159,400	3,604,034.00	0.22
107	002372	伟星新材	172,092	3,534,769.68	0.22
108	601058	赛轮轮胎	308,000	3,508,120.00	0.21
109	002518	科士达	86,200	3,448,862.00	0.21
110	600985	淮北矿业	292,595	3,370,694.40	0.21
111	000778	新兴铸管	820,400	3,347,232.00	0.20
112	002985	北摩高科	74,670	3,294,440.40	0.20
113	002508	老板电器	128,611	3,252,572.19	0.20
114	000683	远兴能源	444,171	3,193,589.49	0.19
115	300308	中际旭创	21,600	3,184,920.00	0.19
116	300017	网宿科技	446,900	3,177,459.00	0.19
117	600801	华新水泥	248,900	3,073,915.00	0.19
118	300724	捷佳伟创	27,300	3,067,155.00	0.19
119	300850	新强联	75,400	2,818,452.00	0.17
120	002423	中粮资本	350,200	2,801,600.00	0.17
121	601666	平煤股份	365,700	2,757,378.00	0.17
122	002244	滨江集团	312,300	2,754,486.00	0.17
123	000937	冀中能源	421,800	2,691,084.00	0.16
124	603650	彤程新材	78,500	2,574,800.00	0.16
125	688248	南网科技	66,000	2,533,740.00	0.15
126	600827	百联股份	189,200	2,529,604.00	0.15
127	600038	中直股份	61,900	2,464,858.00	0.15
128	000050	深天马 A	259,800	2,384,964.00	0.15
129	600707	彩虹股份	498,541	2,373,055.16	0.14
130	002926	华西证券	279,000	2,318,490.00	0.14
131	000563	陕国投 A	748,600	2,283,230.00	0.14
132	601997	贵阳银行	431,700	2,227,572.00	0.14
133	600369	西南证券	564,400	2,060,060.00	0.13
134	601168	西部矿业	195,300	2,052,603.00	0.12
135	603233	大参林	69,840	1,956,218.40	0.12
136	000987	越秀资本	305,000	1,936,750.00	0.12
137	600808	马钢股份	743,393	1,910,520.01	0.12
138	300861	美畅股份	41,500	1,799,855.00	0.11
139	002468	申通快递	160,000	1,731,200.00	0.11
140	002568	百润股份	41,174	1,496,674.90	0.09
141	600598	北大荒	106,909	1,425,096.97	0.09
142	002128	电投能源	107,150	1,416,523.00	0.09
143	600906	财达证券	194,300	1,398,960.00	0.09
144	000933	神火股份	105,900	1,376,700.00	0.08
145	600398	海澜之家	197,400	1,358,112.00	0.08

146	603826	坤彩科技	26,300	1,315,000.00	0.08
147	600673	东阳光	116,100	837,081.00	0.05
148	688234	天岳先进	10,836	801,213.84	0.05
149	688009	中国通号	136,712	792,929.60	0.05
150	002010	传化智联	135,900	722,988.00	0.04
151	600765	中航重机	26,300	697,213.00	0.04
152	603816	顾家家居	17,900	682,885.00	0.04
153	603026	胜华新材	10,000	592,500.00	0.04
154	600325	华发股份	54,200	533,870.00	0.03
155	002081	金螳螂	108,500	489,335.00	0.03
156	601611	中国核建	51,500	435,175.00	0.03
157	600718	东软集团	39,400	420,004.00	0.03
158	603338	浙江鼎力	7,152	400,583.52	0.02
159	600699	均胜电子	18,411	324,770.04	0.02
160	002249	大洋电机	56,000	319,200.00	0.02
161	002110	三钢闽光	69,300	292,446.00	0.02
162	000559	万向钱潮	50,512	275,290.40	0.02
163	600500	中化国际	44,600	247,976.00	0.02
164	300285	国瓷材料	9,000	246,600.00	0.02
165	600928	西安银行	60,400	212,608.00	0.01
166	600481	双良节能	14,500	202,710.00	0.01
167	600737	中粮糖业	24,400	196,420.00	0.01
168	601139	深圳燃气	25,800	188,082.00	0.01
169	601665	齐鲁银行	47,100	184,632.00	0.01
170	000883	湖北能源	10,416	47,496.96	0.00
171	002373	千方科技	3,200	43,648.00	0.00
172	601187	厦门银行	7,700	38,654.00	0.00
173	688188	柏楚电子	118	22,250.08	0.00
174	002223	鱼跃医疗	500	17,995.00	0.00
175	688200	华峰测控	24	3,672.00	0.00
176	688052	纳芯微	18	2,850.66	0.00
177	688301	奕瑞科技	10	2,824.30	0.00
178	688819	天能股份	42	1,547.28	0.00
179	002294	信立泰	35	1,091.65	0.00
180	002690	美亚光电	30	772.50	0.00
181	600160	巨化股份	50	689.00	0.00
182	603707	健友股份	45	607.50	0.00
183	688295	中复神鹰	10	366.80	0.00
184	000975	银泰黄金	20	234.00	0.00
185	300253	卫宁健康	19	205.58	0.00
186	600970	中材国际	11	140.25	0.00
187	600377	宁沪高速	9	88.47	0.00
188	003035	南网能源	9	64.08	0.00

189	300558	贝达药业	1	48.03	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	3,816,600	15,419,064.00	0.94
2	600583	海油工程	2,563,400	14,995,890.00	0.91
3	688425	铁建重工	2,489,755	11,975,721.55	0.73
4	300759	康龙化成	281,990	10,794,577.20	0.66
5	300014	亿纬锂能	169,400	10,248,700.00	0.62
6	002215	诺普信	1,251,000	9,395,010.00	0.57
7	603103	横店影视	549,580	9,254,927.20	0.56
8	600020	中原高速	2,228,958	8,180,275.86	0.50
9	600031	三一重工	481,500	8,007,345.00	0.49
10	002154	报喜鸟	1,239,300	6,840,936.00	0.42
11	300638	广和通	294,800	6,686,064.00	0.41
12	603567	珍宝岛	446,482	6,679,370.72	0.41
13	002454	松芝股份	747,100	6,327,937.00	0.39
14	300869	康泰医学	274,220	6,296,091.20	0.38
15	600197	伊力特	221,100	6,007,287.00	0.37
16	600229	城市传媒	660,400	5,626,608.00	0.34
17	603708	家家悦	447,700	5,614,158.00	0.34
18	600611	大众交通	1,781,150	5,272,204.00	0.32
19	300857	协创数据	197,300	5,185,044.00	0.32
20	300232	洲明科技	565,300	5,166,842.00	0.31
21	600488	津药药业	904,300	5,082,166.00	0.31
22	603305	旭升集团	178,900	4,985,943.00	0.30
23	002971	和远气体	189,748	4,867,036.20	0.30
24	603328	依顿电子	587,041	4,860,699.48	0.30
25	002449	国星光电	534,360	4,750,460.40	0.29
26	300319	麦捷科技	532,129	4,555,024.24	0.28
27	300872	天阳科技	289,040	4,491,681.60	0.27
28	600531	豫光金铅	703,816	4,434,040.80	0.27
29	600748	上实发展	985,541	3,892,886.95	0.24
30	600469	风神股份	559,600	3,603,824.00	0.22
31	002664	信质集团	252,300	3,552,384.00	0.22
32	002746	仙坛股份	413,900	3,261,532.00	0.20
33	002170	芭田股份	468,300	3,217,221.00	0.20
34	688173	希荻微	132,566	3,033,110.08	0.18
35	601600	中国铝业	497,800	2,732,922.00	0.17
36	600829	人民同泰	385,400	2,713,216.00	0.17

37	002335	科华数据	75,400	2,710,630.00	0.17
38	002312	川发龙蟒	333,000	2,707,290.00	0.16
39	603989	艾华集团	120,345	2,534,465.70	0.15
40	603508	思维列控	146,800	2,502,940.00	0.15
41	600050	中国联通	518,900	2,490,720.00	0.15
42	000531	穗恒运 A	337,322	2,438,838.06	0.15
43	600035	楚天高速	580,800	2,369,664.00	0.14
44	600019	宝钢股份	412,000	2,315,440.00	0.14
45	603719	良品铺子	92,200	2,305,922.00	0.14
46	603208	江山欧派	56,000	2,039,520.00	0.12
47	688138	清溢光电	93,808	1,980,286.88	0.12
48	600098	广州发展	317,700	1,963,386.00	0.12
49	002419	天虹股份	329,400	1,926,990.00	0.12
50	300041	回天新材	158,400	1,869,120.00	0.11
51	603309	维力医疗	118,400	1,831,648.00	0.11
52	000751	锌业股份	546,871	1,804,674.30	0.11
53	300443	金雷股份	46,300	1,641,335.00	0.10
54	300219	鸿利智汇	222,500	1,635,375.00	0.10
55	300194	福安药业	397,800	1,543,464.00	0.09
56	600337	美克家居	444,900	1,445,925.00	0.09
57	002559	亚威股份	162,700	1,444,776.00	0.09
58	603628	清源股份	87,587	1,386,502.21	0.08
59	300457	赢合科技	77,700	1,372,182.00	0.08
60	600664	哈药股份	405,400	1,333,766.00	0.08
61	002053	云南能投	115,128	1,291,736.16	0.08
62	002919	名臣健康	24,060	1,085,106.00	0.07
63	600201	生物股份	102,520	974,965.20	0.06
64	000919	金陵药业	118,600	927,452.00	0.06
65	300129	泰胜风能	86,400	828,576.00	0.05
66	688150	莱特光电	36,555	818,832.00	0.05
67	002869	金溢科技	35,800	786,884.00	0.05
68	600054	黄山旅游	58,600	750,080.00	0.05
69	601137	博威合金	47,100	732,876.00	0.04
70	601686	友发集团	104,700	716,148.00	0.04
71	601001	晋控煤业	75,200	703,872.00	0.04
72	300019	硅宝科技	37,321	636,323.05	0.04
73	000301	东方盛虹	53,800	635,916.00	0.04
74	688139	海尔生物	11,479	590,824.13	0.04
75	600760	中航沈飞	13,000	585,000.00	0.04
76	002649	博彦科技	40,300	569,439.00	0.03
77	688357	建龙微纳	8,501	549,929.69	0.03
78	600864	哈投股份	105,800	540,638.00	0.03
79	600577	精达股份	118,900	501,758.00	0.03

80	000550	江铃汽车	30,300	419,352.00	0.03
81	002948	青岛银行	128,900	403,457.00	0.02
82	600728	佳都科技	56,450	391,198.50	0.02
83	603507	振江股份	9,600	348,096.00	0.02
84	002498	汉缆股份	79,800	319,998.00	0.02
85	300672	国科微	3,400	283,390.00	0.02
86	603236	移远通信	4,700	271,237.00	0.02
87	601702	华峰铝业	19,600	268,128.00	0.02
88	002997	瑞鹄模具	8,600	255,678.00	0.02
89	002391	长青股份	36,600	251,442.00	0.02
90	301103	何氏眼科	5,800	243,368.00	0.01
91	002169	智光电气	19,700	163,313.00	0.01
92	601107	四川成渝	38,900	158,323.00	0.01
93	300292	吴通控股	36,400	141,960.00	0.01
94	002967	广电计量	6,700	134,603.00	0.01
95	001696	宗申动力	18,000	127,440.00	0.01
96	300735	光弘科技	11,500	123,050.00	0.01
97	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.01
98	002303	美盈森	31,600	102,068.00	0.01
99	000737	北方铜业	18,900	101,871.00	0.01
100	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
101	301358	湖南裕能	1,779	76,301.31	0.00
102	603171	税友股份	1,800	71,964.00	0.00
103	603916	苏博特	4,000	52,960.00	0.00
104	000045	深纺织 A	4,100	45,100.00	0.00
105	600571	信雅达	4,400	40,216.00	0.00
106	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
107	002541	鸿路钢构	1,200	34,572.00	0.00
108	688576	西山科技	265	32,224.90	0.00
109	601619	嘉泽新能	7,000	31,850.00	0.00
110	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
111	688352	硕中科技	2,361	28,497.27	0.00
112	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
113	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
114	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
115	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
116	002275	桂林三金	1,200	21,612.00	0.00
117	301322	绿通科技	391	20,816.84	0.00
118	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
119	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
120	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
121	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
122	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00

123	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
124	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
125	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
126	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
127	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
128	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
129	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
130	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
131	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
132	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
133	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
134	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
135	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
136	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
137	688598	金博股份	46	7,889.00	0.00
138	688063	派能科技	38	7,533.50	0.00
139	688261	东微半导	45	6,294.15	0.00
140	688016	心脉医疗	30	5,396.40	0.00
141	603605	珀莱雅	40	4,496.00	0.00
142	688206	概伦电子	102	2,860.08	0.00
143	600211	西藏药业	42	2,494.80	0.00
144	688259	创耀科技	29	2,295.35	0.00
145	688551	科威尔	34	2,229.72	0.00
146	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
147	688366	昊海生科	24	2,021.28	0.00
148	003022	联泓新科	50	1,245.00	0.00
149	300827	上能电气	34	1,225.70	0.00
150	002158	汉钟精机	46	1,148.16	0.00
151	002324	普利特	40	570.80	0.00
152	603960	克来机电	30	559.50	0.00
153	688588	凌志软件	34	528.70	0.00
154	600977	中国电影	35	491.75	0.00
155	688046	药康生物	22	426.58	0.00
156	002212	天融信	40	388.00	0.00
157	000582	北部湾港	48	364.80	0.00
158	688032	禾迈股份	1	355.15	0.00
159	300101	振芯科技	13	252.07	0.00
160	603330	天洋新材	20	222.20	0.00
161	600376	首开股份	47	183.30	0.00
162	601500	通用股份	41	167.69	0.00
163	002641	公元股份	25	141.00	0.00
164	002048	宁波华翔	10	134.00	0.00
165	002467	二六三	24	119.28	0.00

166	603299	苏盐井神	9	89.82	0.00
167	000973	佛塑科技	20	89.20	0.00
168	000589	贵州轮胎	15	84.00	0.00
169	600266	城建发展	16	81.28	0.00
170	300630	普利制药	4	78.20	0.00
171	688508	芯朋微	1	57.99	0.00
172	603877	太平鸟	2	50.56	0.00
173	600635	大众公用	15	49.80	0.00
174	300415	伊之密	1	19.20	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	002422	科伦药业	106,356,357.78	8.50
2	002739	万达电影	94,581,844.50	7.56
3	688390	固德威	88,808,263.75	7.10
4	600498	烽火通信	87,156,802.00	6.97
5	002152	广电运通	86,482,883.33	6.91
6	002299	圣农发展	83,367,893.48	6.67
7	600497	驰宏锌锗	83,238,462.00	6.66
8	600489	中金黄金	82,954,017.86	6.63
9	300866	安克创新	79,078,174.90	6.32
10	000739	普洛药业	78,517,014.68	6.28
11	603228	景旺电子	78,454,167.98	6.27
12	002056	横店东磁	76,702,650.00	6.13
13	688006	杭可科技	75,970,102.89	6.07
14	600373	中文传媒	75,787,519.17	6.06
15	601098	中南传媒	75,048,287.38	6.00
16	600580	卧龙电驱	74,250,925.70	5.94
17	600380	健康元	72,495,833.89	5.80
18	688029	南微医学	71,992,930.54	5.76
19	603317	天味食品	71,514,284.62	5.72
20	300724	捷佳伟创	70,457,033.24	5.63
21	600315	上海家化	70,290,964.92	5.62
22	600582	天地科技	69,854,451.60	5.59
23	603345	安井食品	69,420,106.14	5.55
24	002384	东山精密	69,408,315.60	5.55
25	601168	西部矿业	68,333,086.66	5.46
26	601108	财通证券	67,963,952.30	5.43

27	600967	内蒙一机	67,722,918.87	5.41
28	600655	豫园股份	67,309,663.32	5.38
29	002465	海格通信	67,119,551.98	5.37
30	600535	天士力	66,552,095.42	5.32
31	002938	鹏鼎控股	66,418,951.08	5.31
32	601231	环旭电子	66,363,749.45	5.31
33	002273	水晶光电	66,300,450.82	5.30
34	002065	东华软件	65,781,492.42	5.26
35	600258	首旅酒店	65,660,447.97	5.25
36	600827	百联股份	65,409,285.85	5.23
37	000683	远兴能源	64,752,826.64	5.18
38	600316	洪都航空	64,356,322.41	5.15
39	002128	电投能源	64,071,463.50	5.12
40	601555	东吴证券	63,585,441.00	5.08
41	601958	金钼股份	62,569,175.97	5.00
42	600820	隧道股份	62,548,455.80	5.00
43	002372	伟星新材	62,268,775.32	4.98
44	002463	沪电股份	61,839,512.39	4.94
45	603517	绝味食品	61,833,985.21	4.94
46	600528	中铁工业	61,553,986.00	4.92
47	002396	星网锐捷	61,553,408.98	4.92
48	600160	巨化股份	61,333,633.85	4.90
49	002244	滨江集团	61,233,476.00	4.90
50	300136	信维通信	59,625,514.25	4.77
51	300088	长信科技	59,375,119.00	4.75
52	000563	陕国投 A	59,127,958.66	4.73
53	603338	浙江鼎力	58,956,393.56	4.71
54	600170	上海建工	58,520,084.07	4.68
55	603719	良品铺子	58,426,098.57	4.67
56	688819	天能股份	58,245,692.33	4.66
57	600968	海油发展	57,659,142.00	4.61
58	601717	郑煤机	57,520,070.77	4.60
59	601000	唐山港	57,510,213.27	4.60
60	600885	宏发股份	57,393,372.87	4.59
61	600673	东阳光	57,389,337.00	4.59
62	600435	北方导航	57,061,676.29	4.56
63	600131	国网信通	57,013,549.66	4.56
64	002557	洽洽食品	56,726,087.05	4.54
65	000997	新大陆	56,620,269.40	4.53
66	600699	均胜电子	56,522,423.96	4.52
67	002423	中粮资本	56,086,866.00	4.48
68	002249	大洋电机	56,060,476.09	4.48
69	603233	大参林	55,278,783.89	4.42

70	601636	旗滨集团	55,211,803.70	4.41
71	600667	太极实业	55,042,601.58	4.40
72	600909	华安证券	54,970,793.50	4.40
73	601058	赛轮轮胎	54,874,553.28	4.39
74	603160	汇顶科技	54,745,953.20	4.38
75	600166	福田汽车	54,390,093.00	4.35
76	002966	苏州银行	54,107,498.02	4.33
77	002203	海亮股份	53,855,912.03	4.31
78	300308	中际旭创	53,484,920.92	4.28
79	600299	安迪苏	53,421,644.88	4.27
80	002500	山西证券	53,033,468.50	4.24
81	603218	日月股份	52,889,158.73	4.23
82	600517	国网英大	52,132,637.20	4.17
83	000623	吉林敖东	51,924,312.37	4.15
84	600566	济川药业	51,885,033.47	4.15
85	300144	宋城演艺	51,201,604.83	4.09
86	300026	红日药业	50,991,759.00	4.08
87	600521	华海药业	50,801,442.92	4.06
88	000987	越秀资本	50,640,341.19	4.05
89	603883	老百姓	50,326,076.00	4.02
90	600863	内蒙华电	50,219,365.42	4.02
91	300861	美畅股份	50,161,094.06	4.01
92	600201	生物股份	49,206,610.00	3.93
93	000027	深圳能源	49,059,680.47	3.92
94	000807	云铝股份	49,009,644.80	3.92
95	603127	昭衍新药	48,929,215.47	3.91
96	000785	居然之家	48,890,174.00	3.91
97	600755	厦门国贸	48,341,202.15	3.87
98	000636	风华高科	48,089,497.56	3.85
99	600637	东方明珠	48,054,116.82	3.84
100	002625	光启技术	47,854,716.34	3.83
101	000750	国海证券	47,746,598.97	3.82
102	603596	伯特利	47,223,523.60	3.78
103	600271	航天信息	47,112,455.00	3.77
104	603456	九洲药业	47,090,667.91	3.77
105	002212	天融信	47,009,196.00	3.76
106	600369	西南证券	46,515,813.85	3.72
107	600195	中牧股份	46,472,072.88	3.72
108	002511	中顺洁柔	46,424,444.36	3.71
109	002111	威海广泰	46,265,798.00	3.70
110	000738	航发控制	46,187,138.46	3.69
111	300009	安科生物	46,146,346.00	3.69
112	300017	网宿科技	45,977,525.31	3.68

113	600161	天坛生物	45,961,147.08	3.67
114	600879	航天电子	45,872,099.14	3.67
115	000728	国元证券	45,683,172.14	3.65
116	000898	鞍钢股份	45,576,017.10	3.64
117	603444	吉比特	45,401,453.96	3.63
118	002532	天山铝业	45,333,567.00	3.62
119	600927	永安期货	45,264,138.00	3.62
120	688009	中国通号	45,257,520.83	3.62
121	600062	华润双鹤	45,123,691.00	3.61
122	603605	珀莱雅	44,985,273.20	3.60
123	000967	盈峰环境	44,938,554.89	3.59
124	002531	天顺风能	44,877,336.00	3.59
125	601607	上海医药	44,611,946.00	3.57
126	002048	宁波华翔	44,332,632.85	3.54
127	002266	浙富控股	44,198,370.48	3.53
128	300115	长盈精密	44,081,169.40	3.52
129	603939	益丰药房	44,003,656.02	3.52
130	600026	中远海能	43,960,933.50	3.51
131	603816	顾家家居	43,868,130.00	3.51
132	002572	索菲亚	43,529,840.00	3.48
133	603613	国联股份	43,508,120.00	3.48
134	000559	万向钱潮	43,381,898.32	3.47
135	688223	晶科能源	43,296,336.69	3.46
136	600352	浙江龙盛	42,984,087.00	3.44
137	600482	中国动力	42,642,938.00	3.41
138	601139	深圳燃气	42,516,350.91	3.40
139	603056	德邦股份	42,436,523.64	3.39
140	002508	老板电器	42,414,759.97	3.39
141	002831	裕同科技	42,236,193.34	3.38
142	000060	中金岭南	41,925,957.00	3.35
143	600862	中航高科	41,866,372.88	3.35
144	600038	中直股份	41,667,347.98	3.33
145	601665	齐鲁银行	41,524,013.74	3.32
146	002745	木林森	41,203,382.96	3.29
147	000039	中集集团	41,094,497.92	3.29
148	600959	江苏有线	40,849,236.08	3.27
149	300888	稳健医疗	40,740,602.00	3.26
150	600583	海油工程	40,542,415.00	3.24
151	002250	联化科技	40,462,185.00	3.24
152	600985	淮北矿业	40,419,813.60	3.23
153	300146	汤臣倍健	40,402,747.00	3.23
154	688088	虹软科技	40,176,900.43	3.21
155	300003	乐普医疗	40,087,011.00	3.21

156	600623	华谊集团	40,036,693.99	3.20
157	601966	玲珑轮胎	39,983,119.25	3.20
158	688208	道通科技	39,895,276.95	3.19
159	000031	大悦城	39,680,140.81	3.17
160	000887	中鼎股份	39,483,016.20	3.16
161	000050	深天马 A	39,457,664.15	3.15
162	600839	四川长虹	39,035,287.00	3.12
163	600377	宁沪高速	38,528,148.00	3.08
164	600487	亨通光电	38,343,441.00	3.07
165	600728	佳都科技	38,147,620.84	3.05
166	600398	海澜之家	38,119,725.00	3.05
167	600109	国金证券	38,053,688.03	3.04
168	601928	凤凰传媒	37,824,819.91	3.02
169	002985	北摩高科	37,700,425.47	3.01
170	300073	当升科技	37,497,317.00	3.00
171	600801	华新水泥	37,368,741.80	2.99
172	688063	派能科技	37,346,979.23	2.99
173	601106	中国一重	37,016,860.00	2.96
174	002673	西部证券	36,984,003.50	2.96
175	000589	贵州轮胎	36,947,662.05	2.95
176	601598	中国外运	36,946,812.50	2.95
177	002110	三钢闽光	36,613,354.48	2.93
178	300558	贝达药业	36,569,761.20	2.92
179	601118	海南橡胶	36,499,318.34	2.92
180	002081	金螳螂	36,329,066.00	2.90
181	603688	石英股份	36,162,337.00	2.89
182	601163	三角轮胎	35,551,456.90	2.84
183	002540	亚太科技	35,542,154.66	2.84
184	300433	蓝思科技	35,276,483.00	2.82
185	002632	道明光学	35,197,532.00	2.81
186	000778	新兴铸管	35,107,511.17	2.81
187	601696	中银证券	34,638,668.00	2.77
188	600707	彩虹股份	34,627,713.04	2.77
189	600050	中国联通	34,329,142.00	2.74
190	300251	光线传媒	34,151,445.00	2.73
191	000725	京东方 A	34,143,894.00	2.73
192	300776	帝尔激光	34,063,627.24	2.72
193	603737	三棵树	33,838,535.10	2.71
194	001914	招商积余	33,729,273.00	2.70
195	600216	浙江医药	33,347,475.67	2.67
196	600456	宝钛股份	33,280,072.57	2.66
197	002701	奥瑞金	33,237,146.72	2.66
198	300383	光环新网	32,950,081.18	2.63

199	688778	厦钨新能	32,890,080.48	2.63
200	601801	皖新传媒	32,750,669.00	2.62
201	002603	以岭药业	32,492,959.32	2.60
202	300357	我武生物	32,332,201.00	2.59
203	688187	时代电气	32,282,477.95	2.58
204	688002	睿创微纳	31,911,498.93	2.55
205	601991	大唐发电	31,710,846.48	2.54
206	600808	马钢股份	31,622,431.00	2.53
207	600500	中化国际	31,615,002.00	2.53
208	600977	中国电影	31,613,041.10	2.53
209	600705	中航产融	31,575,354.00	2.52
210	002683	广东宏大	31,538,218.00	2.52
211	601699	潞安环能	31,493,021.10	2.52
212	601077	渝农商行	31,385,984.04	2.51
213	002421	达实智能	31,235,595.00	2.50
214	000783	长江证券	31,166,478.00	2.49
215	300726	宏达电子	31,080,255.77	2.49
216	300072	海新能科	31,038,179.48	2.48
217	601399	国机重装	30,700,834.00	2.45
218	603236	移远通信	30,667,227.86	2.45
219	601003	柳钢股份	30,641,933.00	2.45
220	002867	周大生	30,429,665.77	2.43
221	002468	申通快递	30,410,881.00	2.43
222	002563	森马服饰	30,388,103.44	2.43
223	000597	东北制药	30,011,014.17	2.40
224	601137	博威合金	30,009,497.00	2.40
225	600682	南京新百	29,945,879.00	2.39
226	688772	珠海冠宇	29,883,540.71	2.39
227	000576	甘化科工	29,867,650.00	2.39
228	600409	三友化工	29,762,529.00	2.38
229	600155	华创云信	29,728,927.92	2.38
230	300869	康泰医学	29,678,489.22	2.37
231	300296	利亚德	29,616,059.15	2.37
232	600598	北大荒	29,426,461.07	2.35
233	600348	华阳股份	29,398,922.00	2.35
234	600006	东风汽车	29,325,771.00	2.34
235	600183	生益科技	29,315,148.63	2.34
236	002373	千方科技	29,253,773.00	2.34
237	603118	共进股份	29,072,307.99	2.32
238	301029	怡合达	28,975,074.08	2.32
239	603267	鸿远电子	28,933,864.00	2.31
240	600789	鲁抗医药	28,837,487.78	2.31
241	600079	人福医药	28,748,709.00	2.30

242	002653	海思科	28,695,537.00	2.29
243	600642	申能股份	28,615,567.00	2.29
244	600859	王府井	28,354,417.00	2.27
245	601872	招商轮船	28,328,242.73	2.27
246	603589	口子窖	28,242,729.27	2.26
247	002294	信立泰	28,198,997.23	2.25
248	601016	节能风电	28,123,668.44	2.25
249	600143	金发科技	28,050,896.00	2.24
250	603103	横店影视	27,930,884.40	2.23
251	601019	山东出版	27,893,961.00	2.23
252	000975	银泰黄金	27,819,202.60	2.22
253	002444	巨星科技	27,817,780.00	2.22
254	600597	光明乳业	27,643,565.75	2.21
255	600664	哈药股份	27,620,387.00	2.21
256	603868	飞科电器	27,615,574.06	2.21
257	000513	丽珠集团	27,575,807.67	2.20
258	688777	中控技术	27,388,327.72	2.19
259	002434	万里扬	26,990,154.00	2.16
260	002019	亿帆医药	26,803,232.30	2.14
261	000878	云南铜业	26,715,184.38	2.14
262	002078	太阳纸业	26,673,779.99	2.13
263	688318	财富趋势	26,627,587.94	2.13
264	300377	赢时胜	26,594,161.00	2.13
265	600685	中船防务	26,490,030.00	2.12
266	601158	重庆水务	26,472,372.00	2.12
267	600704	物产中大	26,296,916.00	2.10
268	601866	中远海发	26,213,487.00	2.10
269	601600	中国铝业	26,058,007.00	2.08
270	002919	名臣健康	26,003,075.00	2.08
271	601116	三江购物	25,997,206.00	2.08
272	002399	海普瑞	25,802,811.42	2.06
273	600390	五矿资本	25,686,799.80	2.05
274	002926	华西证券	25,634,100.00	2.05
275	002353	杰瑞股份	25,539,022.00	2.04
276	603858	步长制药	25,415,487.00	2.03
277	688707	振华新材	25,405,282.11	2.03
278	601608	中信重工	25,327,388.30	2.03
279	002017	东信和平	25,318,846.00	2.02
280	300438	鹏辉能源	25,199,458.00	2.01
281	000553	安道麦 A	25,055,826.00	2.00

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	002422	科伦药业	101,302,749.25	8.10
2	300866	安克创新	95,805,682.84	7.66
3	600580	卧龙电驱	84,889,139.82	6.79
4	600497	驰宏锌锗	82,886,946.63	6.63
5	601168	西部矿业	81,911,379.82	6.55
6	688390	固德威	81,123,833.63	6.49
7	002739	万达电影	79,985,034.02	6.40
8	601231	环旭电子	78,805,980.60	6.30
9	002152	广电运通	76,202,960.00	6.09
10	600498	烽火通信	75,880,508.88	6.07
11	002463	沪电股份	74,775,417.60	5.98
12	600380	健康元	74,346,774.73	5.94
13	603345	安井食品	74,157,090.36	5.93
14	600160	巨化股份	73,061,970.04	5.84
15	300724	捷佳伟创	72,797,744.50	5.82
16	002465	海格通信	72,500,712.52	5.80
17	600699	均胜电子	72,324,074.34	5.78
18	002299	圣农发展	72,205,741.50	5.77
19	601108	财通证券	70,654,615.30	5.65
20	600967	内蒙一机	70,453,186.02	5.63
21	600373	中文传媒	70,354,036.95	5.63
22	002938	鹏鼎控股	69,783,594.82	5.58
23	000739	普洛药业	69,688,240.65	5.57
24	688819	天能股份	67,701,352.27	5.41
25	601098	中南传媒	67,559,317.24	5.40
26	600582	天地科技	67,240,489.37	5.38
27	000683	远兴能源	65,882,304.94	5.27
28	600655	豫园股份	65,426,701.72	5.23
29	603228	景旺电子	65,368,713.71	5.23
30	603317	天味食品	65,201,011.11	5.21
31	002056	横店东磁	64,895,433.00	5.19
32	002249	大洋电机	64,827,239.58	5.18
33	600827	百联股份	64,799,975.03	5.18
34	002396	星网锐捷	64,726,718.44	5.18
35	688006	杭可科技	64,569,662.16	5.16
36	688029	南微医学	64,295,103.89	5.14
37	002128	电投能源	63,394,664.96	5.07
38	600489	中金黄金	62,699,780.69	5.01
39	300861	美畅股份	62,141,693.82	4.97

40	300144	宋城演艺	62,051,923.15	4.96
41	300009	安科生物	62,025,477.16	4.96
42	600258	首旅酒店	61,334,123.03	4.90
43	002065	东华软件	60,972,718.04	4.88
44	603719	良品铺子	60,709,359.94	4.85
45	002557	洽洽食品	60,647,196.45	4.85
46	601058	赛轮轮胎	60,065,664.39	4.80
47	002244	滨江集团	59,799,423.55	4.78
48	600535	天士力	59,432,829.70	4.75
49	300115	长盈精密	59,059,675.14	4.72
50	603233	大参林	58,875,000.00	4.71
51	601555	东吴证券	58,759,062.40	4.70
52	603338	浙江鼎力	58,742,762.92	4.70
53	600131	国网信通	58,570,419.88	4.68
54	002372	伟星新材	58,224,784.11	4.66
55	002273	水晶光电	57,641,919.77	4.61
56	300308	中际旭创	57,372,266.39	4.59
57	300088	长信科技	57,299,573.46	4.58
58	002384	东山精密	57,225,216.78	4.58
59	600667	太极实业	57,187,230.22	4.57
60	000563	陕国投 A	57,045,850.88	4.56
61	600435	北方导航	56,918,212.85	4.55
62	600820	隧道股份	56,750,005.18	4.54
63	600316	洪都航空	56,727,192.50	4.54
64	300017	网宿科技	56,341,136.81	4.50
65	600885	宏发股份	56,303,301.94	4.50
66	600528	中铁工业	56,228,626.29	4.50
67	601717	郑煤机	55,978,298.00	4.48
68	000728	国元证券	55,493,342.96	4.44
69	600299	安迪苏	55,239,507.62	4.42
70	600170	上海建工	55,210,291.43	4.41
71	002048	宁波华翔	55,103,242.67	4.41
72	603939	益丰药房	54,763,927.38	4.38
73	000807	云铝股份	54,723,717.99	4.38
74	002423	中粮资本	54,625,901.00	4.37
75	600673	东阳光	54,472,756.20	4.36
76	601958	金钼股份	54,252,288.60	4.34
77	000785	居然之家	53,891,736.26	4.31
78	600959	江苏有线	53,753,375.42	4.30
79	601139	深圳燃气	53,397,392.07	4.27
80	600315	上海家化	53,355,258.62	4.27
81	603127	昭衍新药	53,266,643.86	4.26
82	600566	济川药业	53,120,986.80	4.25

83	000987	越秀资本	52,564,134.51	4.20
84	603160	汇顶科技	52,397,682.71	4.19
85	601607	上海医药	52,377,760.65	4.19
86	300136	信维通信	51,530,170.72	4.12
87	002572	索菲亚	50,404,105.71	4.03
88	603613	国联股份	50,373,056.48	4.03
89	300026	红日药业	50,215,131.88	4.02
90	600755	厦门国贸	50,130,872.89	4.01
91	600909	华安证券	49,517,909.59	3.96
92	300073	当升科技	49,423,715.50	3.95
93	600201	生物股份	49,415,994.00	3.95
94	600521	华海药业	48,993,095.24	3.92
95	601598	中国外运	48,697,878.18	3.89
96	600398	海澜之家	48,688,620.08	3.89
97	601000	唐山港	48,280,850.71	3.86
98	601636	旗滨集团	48,263,729.57	3.86
99	603596	伯特利	48,109,606.00	3.85
100	600195	中牧股份	47,750,235.28	3.82
101	600968	海油发展	47,173,786.70	3.77
102	600161	天坛生物	47,115,372.49	3.77
103	603517	绝味食品	47,096,020.65	3.77
104	603605	珀莱雅	46,842,907.48	3.75
105	688009	中国通号	46,787,703.69	3.74
106	002212	天融信	46,028,069.66	3.68
107	600062	华润双鹤	45,809,392.96	3.66
108	601665	齐鲁银行	45,800,725.31	3.66
109	002532	天山铝业	45,480,544.37	3.64
110	000589	贵州轮胎	45,468,056.36	3.64
111	002831	裕同科技	45,323,353.03	3.62
112	600026	中远海能	45,213,633.00	3.62
113	603444	吉比特	45,014,314.24	3.60
114	002500	山西证券	45,007,077.20	3.60
115	002966	苏州银行	44,898,745.50	3.59
116	600517	国网英大	44,760,326.44	3.58
117	600377	宁沪高速	44,532,552.69	3.56
118	002111	威海广泰	44,522,227.40	3.56
119	600985	淮北矿业	44,508,282.54	3.56
120	603883	老百姓	44,385,621.22	3.55
121	600038	中直股份	44,171,219.23	3.53
122	600369	西南证券	43,864,047.24	3.51
123	688223	晶科能源	43,668,095.60	3.49
124	600271	航天信息	43,666,555.31	3.49
125	002266	浙富控股	43,460,798.23	3.47

126	603816	顾家家居	43,257,182.39	3.46
127	688088	虹软科技	43,149,650.15	3.45
128	600927	永安期货	42,996,703.57	3.44
129	000559	万向钱潮	42,800,201.81	3.42
130	600482	中国动力	42,682,427.00	3.41
131	000623	吉林敖东	42,651,444.23	3.41
132	000039	中集集团	42,140,624.05	3.37
133	002625	光启技术	42,121,534.88	3.37
134	000778	新兴铸管	41,889,244.21	3.35
135	603456	九洲药业	41,728,654.78	3.34
136	002250	联化科技	41,609,592.00	3.33
137	000997	新大陆	41,258,511.75	3.30
138	002444	巨星科技	40,850,716.00	3.27
139	300146	汤臣倍健	40,840,786.70	3.27
140	000050	深天马 A	40,756,390.86	3.26
141	600839	四川长虹	40,642,620.00	3.25
142	002673	西部证券	40,593,942.90	3.25
143	600352	浙江龙盛	40,388,569.78	3.23
144	000636	风华高科	40,213,402.72	3.22
145	000975	银泰黄金	39,678,385.60	3.17
146	603056	德邦股份	39,625,685.00	3.17
147	002508	老板电器	39,547,556.15	3.16
148	300003	乐普医疗	39,226,748.72	3.14
149	600623	华谊集团	39,204,756.88	3.13
150	300888	稳健医疗	39,173,387.00	3.13
151	002540	亚太科技	39,031,441.72	3.12
152	600166	福田汽车	38,887,065.00	3.11
153	002203	海亮股份	38,841,570.61	3.11
154	600863	内蒙华电	38,683,647.60	3.09
155	600879	航天电子	37,996,992.20	3.04
156	600637	东方明珠	37,935,529.67	3.03
157	002683	广东宏大	37,881,537.00	3.03
158	600728	佳都科技	37,840,313.58	3.03
159	601106	中国一重	37,605,481.62	3.01
160	600598	北大荒	37,576,833.00	3.00
161	688778	厦钨新能	37,546,345.26	3.00
162	000738	航发控制	37,386,399.00	2.99
163	000729	燕京啤酒	37,252,674.40	2.98
164	601163	三角轮胎	37,235,728.53	2.98
165	000027	深圳能源	37,113,188.06	2.97
166	601696	中银证券	36,968,848.00	2.96
167	601118	海南橡胶	36,501,341.79	2.92
168	300558	贝达药业	36,405,598.06	2.91

169	300433	蓝思科技	36,253,624.00	2.90
170	002081	金螳螂	36,207,639.50	2.90
171	600705	中航产融	36,150,883.00	2.89
172	600114	东睦股份	36,063,223.95	2.88
173	002867	周大生	35,957,348.42	2.88
174	601699	潞安环能	35,842,698.80	2.87
175	603688	石英股份	35,838,293.90	2.87
176	300251	光线传媒	35,813,628.00	2.86
177	688063	派能科技	35,809,910.85	2.86
178	001914	招商积余	35,643,831.67	2.85
179	000887	中鼎股份	35,410,750.28	2.83
180	002110	三钢闽光	35,242,795.82	2.82
181	600801	华新水泥	35,062,625.85	2.80
182	002511	中顺洁柔	34,628,984.60	2.77
183	600415	小商品城	34,587,328.00	2.77
184	002985	北摩高科	34,349,271.12	2.75
185	000750	国海证券	34,054,764.50	2.72
186	600143	金发科技	33,829,680.50	2.70
187	688772	珠海冠宇	33,780,436.15	2.70
188	600707	彩虹股份	33,768,589.02	2.70
189	601801	皖新传媒	33,722,406.95	2.70
190	002632	道明光学	33,720,699.00	2.70
191	603218	日月股份	33,657,469.39	2.69
192	600808	马钢股份	33,636,419.22	2.69
193	000725	京东方 A	33,503,243.00	2.68
194	000898	鞍钢股份	33,312,578.07	2.66
195	000031	大悦城	33,205,050.55	2.65
196	600456	宝钛股份	33,161,746.09	2.65
197	002603	以岭药业	33,106,293.63	2.65
198	601991	大唐发电	33,097,954.24	2.65
199	300776	帝尔激光	33,065,433.28	2.64
200	000513	丽珠集团	33,006,481.48	2.64
201	600050	中国联通	32,999,077.00	2.64
202	002701	奥瑞金	32,912,406.40	2.63
203	600977	中国电影	32,808,008.82	2.62
204	600216	浙江医药	32,727,939.93	2.62
205	600487	亨通光电	32,509,144.98	2.60
206	002294	信立泰	32,458,443.12	2.60
207	688187	时代电气	32,273,548.51	2.58
208	601019	山东出版	32,261,655.00	2.58
209	600500	中化国际	31,937,305.00	2.55
210	601992	金隅集团	31,872,152.00	2.55
211	000967	盈峰环境	31,815,165.18	2.54

212	000400	许继电气	31,810,264.00	2.54
213	600109	国金证券	31,720,169.00	2.54
214	603355	莱克电气	31,706,580.41	2.54
215	002421	达实智能	31,684,103.00	2.53
216	300726	宏达电子	31,029,400.54	2.48
217	601399	国机重装	30,837,698.86	2.47
218	300357	我武生物	30,818,219.15	2.46
219	600006	东风汽车	30,618,968.30	2.45
220	300072	海新能科	30,615,318.90	2.45
221	002653	海思科	30,615,075.00	2.45
222	688777	中控技术	30,610,697.94	2.45
223	600155	华创云信	30,137,201.74	2.41
224	300296	利亚德	30,090,946.32	2.41
225	600682	南京新百	29,984,234.00	2.40
226	601928	凤凰传媒	29,881,386.00	2.39
227	601666	平煤股份	29,845,034.65	2.39
228	603267	鸿远电子	29,749,698.00	2.38
229	600079	人福医药	29,622,022.00	2.37
230	600859	王府井	29,482,735.76	2.36
231	000597	东北制药	29,378,778.20	2.35
232	600409	三友化工	29,295,633.00	2.34
233	002078	太阳纸业	29,229,807.14	2.34
234	000060	中金岭南	29,149,443.13	2.33
235	600789	鲁抗医药	29,126,568.90	2.33
236	600348	华阳股份	29,063,321.00	2.32
237	600685	中船防务	29,031,531.00	2.32
238	000576	甘化科工	29,016,787.00	2.32
239	000553	安道麦 A	28,995,414.51	2.32
240	600259	广晟有色	28,781,607.51	2.30
241	300377	赢时胜	28,684,543.00	2.29
242	600298	安琪酵母	28,648,191.12	2.29
243	601137	博威合金	28,579,805.75	2.29
244	601872	招商轮船	28,497,885.40	2.28
245	002373	千方科技	28,398,934.15	2.27
246	600210	紫江企业	28,280,758.55	2.26
247	601016	节能风电	28,066,376.86	2.24
248	600549	厦门钨业	27,978,347.53	2.24
249	603328	依顿电子	27,920,295.00	2.23
250	600782	新钢股份	27,890,354.58	2.23
251	600862	中航高科	27,795,377.00	2.22
252	603737	三棵树	27,754,970.00	2.22
253	002468	申通快递	27,552,539.00	2.20
254	600797	浙大网新	27,349,743.00	2.19

255	600704	物产中大	27,234,215.00	2.18
256	600183	生益科技	27,151,523.08	2.17
257	002019	亿帆医药	27,128,982.41	2.17
258	688318	财富趋势	27,124,736.40	2.17
259	002434	万里扬	27,118,774.00	2.17
260	000878	云南铜业	26,923,667.63	2.15
261	002745	木林森	26,777,123.06	2.14
262	603236	移远通信	26,743,947.62	2.14
263	601158	重庆水务	26,692,404.00	2.13
264	002531	天顺风能	26,523,860.00	2.12
265	002919	名臣健康	26,439,859.78	2.11
266	601116	三江购物	26,314,339.60	2.10
267	603118	共进股份	26,205,963.00	2.10
268	002004	华邦健康	26,089,196.81	2.09
269	002017	东信和平	26,069,103.50	2.08
270	600664	哈药股份	26,005,947.99	2.08
271	000598	兴蓉环境	25,896,156.00	2.07
272	002399	海普瑞	25,853,312.64	2.07
273	601608	中信重工	25,719,434.70	2.06
274	601866	中远海发	25,628,203.00	2.05
275	002353	杰瑞股份	25,615,511.00	2.05
276	000783	长江证券	25,298,243.00	2.02
277	688208	道通科技	25,213,085.28	2.02
278	688707	振华新材	25,190,545.40	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	19,547,021,000.28
卖出股票收入（成交）总额	19,288,804,953.33

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机，并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

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

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

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。

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	4,271,568.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,739,303.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,010,871.90

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	589,100	1,887.98	147,255,310.46	13.24%	964,951,820.05	86.76%

安中证 500 指数增强 A						
国泰君安中证 500 指数增强 C	10,853	55,956.83	299,076,205.78	49.25%	308,223,240.79	50.75%
合计	599,953	2,866.07	446,331,516.24	25.96%	1,273,175,060.84	74.04%

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 500 指数增强 A	3,010,122.18	0.2706%
	国泰君安中证 500 指数增强 C	2,530,273.99	0.4166%
	合计	5,540,396.17	0.3222%

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安中证 500 指数增强 A	国泰君安中证 500 指数增强 C
基金合同生效日 (2021 年 12 月 15 日) 基金份额总额	720,641,928.72	440,062,218.02
本报告期期初基金份额总额	855,925,363.63	536,328,911.72
本报告期基金总申购份额	452,474,418.09	528,445,562.74
减：本报告期基金总赎回份额	196,192,651.21	457,475,027.89
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-

本报告期末基金份额总额	1,112,207,130.51	607,299,446.57
-------------	------------------	----------------

§ 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、本报告期内本基金托管人重大人事变动如下：

2023 年 3 月，项寅同志担任上海银行股份有限公司资产托管部副总经理职务，上述人事变动已进行备案、公告。

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

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无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	38,829,083,621.74	100.00%	2,768,255.86	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关于旗下部分基金在直销柜台开展申购费率优惠活动的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2023-01-14
2	国泰君安中证 500 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
3	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
4	国泰君安中证 500 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
5	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
6	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
7	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直销 APP 费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2023-04-17
8	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
9	国泰君安中证 500 指数增强型	证监会指定网站、公司官网	2023-04-23

	证券投资基金 2023 年第 1 季度报告		
10	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金 A 类基金份额在直销柜台开展赎回费率优惠活动的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2023-06-16

§ 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、中国证监会准予国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 5、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
二〇二三年八月三十一日