

# 国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

## 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:上海浦东发展银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年04月19日起至2023年06月30日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>7</b>
2.1 基金基本情况	7
2.2 基金产品说明	7
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
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

<b>§ 5 托管人报告 .....</b>	<b>14</b>
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 .....	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计) .....</b>	<b>15</b>
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 .....	20
<b>§ 7 投资组合报告 .....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	41
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 .....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12 投资组合报告附注 .....	49

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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 .....	51
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	52
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>52</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>54</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55



## § 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	25,534,195.04 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	11,749,077.72 份	13,785,117.32 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	<p>本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。</p> <p>本基金通过指数化投资，争取获得与标的指数相似的总回报，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p>

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海国泰君安证券资产管理有限公司	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	郑杨

## 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
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 04 月 19 日（基金合同生效日）-2023 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	-68,897.34	-13,796.68
本期利润	-234,818.65	-141,200.06
加权平均基金份额本期利润	-0.0233	-0.0224
本期加权平均净值利润率	-2.37%	-2.29%
本期基金份额净值增长率	-2.43%	-2.51%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2023 年 06 月 30 日)	
期末可供分配利润	-285,673.80	-345,602.50
期末可供分配基金份额利润	-0.0243	-0.0251
期末基金资产净值	11,463,403.92	13,439,514.82
期末基金份额净值	0.9757	0.9749
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2023 年 06 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-2.43%	-2.51%

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）。

(4) 本基金于 2023 年 4 月 19 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

## 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	2.03%	0.74%	1.10%	0.83%	0.93%	-0.09%
自基金合同生效起至今	-2.43%	0.72%	-7.30%	0.81%	4.87%	-0.09%

#### 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	1.99%	0.74%	1.10%	0.83%	0.89%	-0.09%
自基金合同生效起至今	-2.51%	0.72%	-7.30%	0.81%	4.79%	-0.09%

### 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-2023年06月30日)



注：1、本基金于 2023 年 4 月 19 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

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

国泰君安沪深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-2023年06月30日)



注：1、本基金于 2023 年 4 月 19 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海国泰君安证券资产管理有限公司正式成立于 2010 年 10 月 18 日，经中国证监会证监许可【2010】631 号文批准，是业内首批券商系资产管理公司。公司注册资本金 20 亿元，注册地上海。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡崇海	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。现任量化投资部总经理。	2023-04-19	-	12 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士，12 年证券从业经验，具备基金从业资格。曾任香港科技大学人工智能实验室访问学者，其后加盟方正证券研究所、国泰君安证券咨询部及研究所从事量化对冲模型的研发工作，2014 年加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，先后在量化投资部、权益与衍生品部担任高级投资经理，从事量化投资和策略研发工作，在 Alpha 量化策略以及基于机器学习的投资方面有独到且深入的研究。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部总经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 5 次。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

从主要风险因子的走势来看，今年一季度延续了去年的小市值风格，中小盘股表现占优，二季度大小盘股表现较均衡。动量因子在去年四季度开始显著失效，期间股票的反转效应得到强化，然而今年开始动量因子表现有所回升，二季度动量因子持续走强，接近历史平均水平。估值因子在一季度“中国特色估值体系”提出后，表现强势，且走势延续到了二季度。除数字经济等热门主题外，

低估值一直是市场的主线，相对而言成长因子和分析师情绪因子持续表现弱势。从 Alpha 大类因子的表现来看，今年高频因子和基本面因子表现都达到了历史平均水平。其中，基本面因子在年报、一季报和二季度业绩预告等密集基本面增量信息的引导下，在上半年表现强势。此外，今年一季度市场交投活跃度逐渐提升，二季度市场主题逐渐分散，市场波动率提升，高频因子的拥挤度开始有所缓解，高频因子的有效性有提升。基本面和高频两种策略表现的相关性较低，体现出较好的互补特征。

在量化增强层面，我们尽量结合以财务数据为基础的基本面信号和以高频量价为主的技术面信号，通过机器学习模型来进行有效因子的选择和因子之间的轮动，并通过投资组合管理模型严格控制投资组合在主要市场风险和行业上相对于基准指数的暴露程度。得益于基本面量化和高频量价在信号层面较低的相关性，使得我们有信心在兼顾两者的情况下追求稳健的 Alpha。随着今年在大幅度扩充有效因子库和有针对性改进模型底层逻辑之后，我们坚信模型能以更有效的方式输出稳定的超额收益。本基金在两者上进行了均衡配置，力求以较为稳定的方式对沪深 300 指数进行增强。

本基金今年来保持高仓位稳定运作，在市场风格和行业走势出现较大的变化下，依然维持一贯的投资组合管理体系。作为宽基指数的增强型量化产品，具有越跌越安全的特点，投资管理人始终保持高仓位运作，一般情况下不主动择时，而专注于以稳健的方式跑赢指数，通过积少成多、以概率取胜的方式增厚投资收益，这样的基金特点更需要投资者坚持长期投资的理念。我们认为沪深 300 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沪深 300 指数增强发起 A 基金份额净值为 0.9757 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.43%，同期业绩比较基准收益率为-7.30%；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 0.9749 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.51%，同期业绩比较基准收益率为-7.30%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

虽然今年以来，在地缘政治和人民币贬值等因素的影响下，A 股市场的活跃度和投资情绪一般，

但是从中长期的角度来看，我们依然坚定地看好沪深 300 未来的走势，主要有以下几个理由：1). 从历史相对估值（加权 PE）的角度来看，沪深 300 指数在历史 11%的分位数，仍然处于较低估值水平，未来随着经济的全面逐步复苏，有望迎来估值和盈利的双击。2). 沪深 300 指数成份较为分散，覆盖众多的各个行业的龙头企业，在不同经济周期中都能表现出较高的韧性和流动性。3). 随着美国加息周期接近尾声，沪深 300 指数作为最具代表性，流动性最好，也是最直接的投资工具之一，将迎来更多的外资流入，推动进一步的上涨。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金的收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

#### 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：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
<b>资 产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	1,803,423.53
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	23,071,251.91
其中：股票投资		23,071,251.91
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		-
买入返售金融资产	6.4.7.3	-
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		62,469.13
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.4	-
资产总计		24,937,144.57
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 06 月 30 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		478.04
应付管理人报酬		14,745.45
应付托管费		2,211.83
应付销售服务费		2,659.07



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	6.4.7.5	14,131.44
负债合计		34,225.83
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.6	25,534,195.04
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.7	-631,276.30
净资产合计		24,902,918.74
负债和净资产总计		24,937,144.57

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 25,534,195.04 份。其中国泰君安沪深 300 指数增强发起 A 基金份额净值 0.9757 元，基金份额总额 11,749,077.72 份；国泰君安沪深 300 指数增强发起 C 基金份额净值 0.9749 元，基金份额总额 13,785,117.32 份。本基金于 2023 年 4 月 19 日成立，本报告期自 2023 年 04 月 19 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 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：2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 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		-327,283.04
1. 利息收入		1,542.40
其中：存款利息收入	6.4.7.8	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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-35,539.25
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-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		-
股利收益	6.4.7.10	167,076.19
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.11	-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）	6.4.7.12	38.50
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>48,735.67</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	31,897.33
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,784.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	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		-
8. 其他费用	6.4.7.13	7,101.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-376,018.71
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-376,018.71
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-376,018.71

注：本基金于 2023 年 4 月 19 日成立，无上年度同期对比数据。

### 6.3 净资产（基金净值）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：2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）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）	-	-	-	-
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）	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基金净值变动数（净值减少以“-”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）	25,534,195.04	-	-631,276.30	24,902,918.74
-----------------	---------------	---	-------------	---------------

注：本基金于 2023 年 4 月 19 日成立，无上年度同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

谢乐斌	陶耿	茹建江
-----	-----	-----
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金(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》、《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式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【2023】568 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 15,019,999.00 份，经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证。《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2023 年 4 月 19 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、存托凭证资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于沪深 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。

#### 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 04 月 19 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 04 月 19 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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2023 年 04 月 19 日至 2023 年 06 月 30 日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其

他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发

生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。



#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润中的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《关于固定收益品种的估值处理标准》(中基协字[2022]566号)采用估值技术确定公

允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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	1,695,654.55
等于：本金	1,695,591.46
加：应计利息	63.09
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	107,768.98
等于：本金	107,654.16
加：应计利息	114.82
减：坏账准备	-
合计	1,803,423.53

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 2023 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	23,364,576.60	-	23,071,251.91	-293,324.69
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	23,364,576.60	-	23,071,251.91	-293,324.69

#### 6.4.7.3 买入返售金融资产

##### 6.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

##### 6.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.5 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	-
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	-

预提审计费	7,101.44
红利提前到账	7,030.00
合计	14,131.44

#### 6.4.7.6 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 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	10,009,999.00	10,009,999.00
本期申购	1,739,578.84	1,739,578.84
本期赎回（以“-”号填列）	-500.12	-500.12
本期末	11,749,077.72	11,749,077.72

##### 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 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	5,010,000.00	5,010,000.00
本期申购	8,787,537.93	8,787,537.93
本期赎回（以“-”号填列）	-12,420.61	-12,420.61
本期末	13,785,117.32	13,785,117.32

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。

#### 6.4.7.7 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-68,897.34	-165,921.31	-234,818.65
本期基金份额交易产生的变动数	-17,575.28	-33,279.87	-50,855.15
其中：基金申购款	-17,580.26	-33,289.69	-50,869.95
基金赎回款	4.98	9.82	14.80
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-86,472.62	-199,201.18	-285,673.80
-----	------------	-------------	-------------

**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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-13,796.68	-127,403.38	-141,200.06
本期基金份额交易产生的变动数	-98,121.66	-106,280.78	-204,402.44
其中：基金申购款	-98,252.46	-106,339.31	-204,591.77
基金赎回款	130.80	58.53	189.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-111,918.34	-233,684.16	-345,602.50

**6.4.7.8 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	687.57
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	854.83
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	1,542.40

**6.4.7.9 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 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	53,321,967.20
减：卖出股票成本总额	53,451,731.54
减：交易费用	72,851.10
买卖股票差价收入	-202,615.44

**6.4.7.10 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	167,076.19
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	167,076.19

#### 6.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-293,324.69
——股票投资	-293,324.69
——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	-
——权证投资	-
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	-293,324.69

#### 6.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	38.50
合计	38.50

#### 6.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	7,101.44
信息披露费	-
证券出借违约金	-
合计	7,101.44

#### 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“上海浦东发展银行”)	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 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
国泰君安证券	130,138,275.34	100.00%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。



#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行基金交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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 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	31,897.33
其中：支付销售机构的客户维护费	24.92

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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费	4,784.63

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 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，逐日累计至每个月月末，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 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。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 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	-
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	10,009,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	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 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	-
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
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	36.34%

**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 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
上海浦东发展银行	1,695,654.55	687.57
国泰君安证券	107,768.98	854.83

注：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。本基金的其他存款由基金结算机构国泰君安证券股份有限公司保管，按协议约定利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期无须做说明的其他关联方交易事项。

**6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

无。

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

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金的托管行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 2023 年 6 月 30 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、流通受限制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	1,803,423.53	-	-	-	1,803,423.53
交易性金融资产	-	-	-	23,071,251.91	23,071,251.91
应收申购款	-	-	-	62,469.13	62,469.13
资产总计	1,803,423.53	-	-	23,133,721.04	24,937,144.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	478.04	478.04
应付管理人报酬	-	-	-	14,745.45	14,745.45
应付托管费	-	-	-	2,211.83	2,211.83
应付销售服务费	-	-	-	2,659.07	2,659.07
其他负债	-	-	-	14,131.44	14,131.44
负债总计	-	-	-	34,225.83	34,225.83
利率敏感度缺口	1,803,423.53	-	-	23,099,495.21	24,902,918.74

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%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	23,071,251.91	92.64
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	23,071,251.91	92.64

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 06 月 30 日
第一层次	23,071,251.91
第二层次	-
第三层次	-
合计	23,071,251.91

###### 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。本基金本报告期持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

###### 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	23,071,251.91	92.52
	其中：股票	23,071,251.91	92.52
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	1,803,423.53	7.23
8	其他各项资产	62,469.13	0.25
9	合计	24,937,144.57	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	-	-
B	采矿业	739,342.00	2.97
C	制造业	10,469,747.00	42.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	656,956.00	2.64
E	建筑业	434,574.64	1.75
F	批发和零售业	71,712.00	0.29
G	交通运输、仓储和邮政业	395,886.00	1.59
H	住宿和餐饮业	33,872.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,027,744.00	4.13
J	金融业	3,621,215.00	14.54
K	房地产业	24,757.00	0.10
L	租赁和商务服务业	391,310.00	1.57
M	科学研究和技术服务业	419,460.00	1.68
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	42,665.00	0.17

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	18,329,240.64	73.60

### 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	99,580.00	0.40
B	采矿业	300,098.00	1.21
C	制造业	2,884,623.56	11.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	240,529.00	0.97
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	113,860.00	0.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	345,656.71	1.39
J	金融业	416,672.00	1.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	340,992.00	1.37
S	综合	-	-
	合计	4,742,011.27	19.04

### 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	700	1,183,700.00	4.75

2	300750	宁德时代	3,200	732,128.00	2.94
3	601318	中国平安	10,000	464,000.00	1.86
4	300014	亿纬锂能	7,100	429,550.00	1.72
5	600031	三一重工	25,600	425,728.00	1.71
6	600050	中国联通	77,800	373,440.00	1.50
7	601998	中信银行	59,500	355,810.00	1.43
8	000333	美的集团	5,800	341,736.00	1.37
9	601728	中国电信	58,700	330,481.00	1.33
10	002594	比亚迪	1,200	309,924.00	1.24
11	600919	江苏银行	42,100	309,435.00	1.24
12	000568	泸州老窖	1,400	293,398.00	1.18
13	601857	中国石油	37,600	280,872.00	1.13
14	000858	五粮液	1,600	261,712.00	1.05
15	601628	中国人寿	7,400	258,704.00	1.04
16	002129	TCL 中环	7,725	256,470.00	1.03
17	600030	中信证券	12,900	255,162.00	1.02
18	600690	海尔智家	10,700	251,236.00	1.01
19	300759	康龙化成	6,400	244,992.00	0.98
20	600019	宝钢股份	43,500	244,470.00	0.98
21	601319	中国人保	41,200	240,608.00	0.97
22	000725	京东方 A	58,700	240,083.00	0.96
23	601816	京沪高铁	45,600	239,856.00	0.96
24	601012	隆基绿能	8,300	237,961.00	0.96
25	600016	民生银行	63,100	236,625.00	0.95
26	601600	中国铝业	42,900	235,521.00	0.95
27	000338	潍柴动力	18,300	228,018.00	0.92
28	002179	中航光电	5,000	226,750.00	0.91
29	600570	恒生电子	5,100	225,879.00	0.91
30	601766	中国中车	34,700	225,550.00	0.91
31	000625	长安汽车	17,200	222,396.00	0.89
32	601888	中国中免	2,000	221,060.00	0.89
33	600760	中航沈飞	4,760	214,200.00	0.86
34	601618	中国中冶	53,000	210,410.00	0.84
35	600028	中国石化	32,900	209,244.00	0.84
36	600900	长江电力	9,300	205,158.00	0.82
37	603369	今世缘	3,700	195,360.00	0.78
38	003816	中国广核	62,100	193,131.00	0.78
39	601398	工商银行	39,600	190,872.00	0.77
40	600809	山西汾酒	1,000	185,070.00	0.74
41	603259	药明康德	2,800	174,468.00	0.70
42	002459	晶澳科技	4,100	170,970.00	0.69
43	002027	分众传媒	25,000	170,250.00	0.68
44	002475	立讯精密	5,100	165,495.00	0.66

45	600036	招商银行	4,800	157,248.00	0.63
46	601006	大秦铁路	21,000	156,030.00	0.63
47	601668	中国建筑	26,936	154,612.64	0.62
48	300433	蓝思科技	13,100	154,056.00	0.62
49	603288	海天味业	3,220	150,857.00	0.61
50	600309	万华化学	1,700	149,328.00	0.60
51	000596	古井贡酒	600	148,428.00	0.60
52	000425	徐工机械	21,000	142,170.00	0.57
53	601328	交通银行	24,400	141,520.00	0.57
54	600886	国投电力	11,000	139,150.00	0.56
55	300122	智飞生物	3,000	132,600.00	0.53
56	000651	格力电器	3,500	127,785.00	0.51
57	000301	东方盛虹	10,500	124,110.00	0.50
58	601898	中煤能源	14,700	124,068.00	0.50
59	600438	通威股份	3,400	116,654.00	0.47
60	300274	阳光电源	1,000	116,630.00	0.47
61	600741	华域汽车	6,300	116,298.00	0.47
62	601169	北京银行	24,700	114,361.00	0.46
63	600918	中泰证券	16,400	113,324.00	0.46
64	600999	招商证券	7,900	107,203.00	0.43
65	600958	东方证券	10,400	100,880.00	0.41
66	601989	中国重工	20,900	100,738.00	0.40
67	300316	晶盛机电	1,400	99,260.00	0.40
68	601601	中国太保	3,800	98,724.00	0.40
69	600406	国电南瑞	4,240	97,944.00	0.39
70	601939	建设银行	15,500	97,030.00	0.39
71	688223	晶科能源	6,900	97,014.00	0.39
72	601877	正泰电器	3,500	96,775.00	0.39
73	002271	东方雨虹	3,500	95,410.00	0.38
74	600362	江西铜业	5,000	94,900.00	0.38
75	688012	中微公司	600	93,870.00	0.38
76	000938	紫光股份	2,900	92,365.00	0.37
77	300760	迈瑞医疗	300	89,940.00	0.36
78	600989	宝丰能源	6,900	87,009.00	0.35
79	600547	山东黄金	3,500	82,180.00	0.33
80	300408	三环集团	2,700	79,245.00	0.32
81	603501	韦尔股份	800	78,432.00	0.31
82	600837	海通证券	8,500	78,370.00	0.31
83	601607	上海医药	3,200	71,712.00	0.29
84	600025	华能水电	9,900	70,587.00	0.28
85	600183	生益科技	4,900	69,580.00	0.28
86	601117	中国化学	8,400	69,552.00	0.28
87	600745	闻泰科技	1,400	68,460.00	0.27

88	600196	复星医药	2,200	67,980.00	0.27
89	002916	深南电路	900	67,833.00	0.27
90	002304	洋河股份	500	65,675.00	0.26
91	300999	金龙鱼	1,600	63,984.00	0.26
92	000001	平安银行	5,200	58,396.00	0.23
93	601336	新华保险	1,500	55,155.00	0.22
94	300763	锦浪科技	500	52,050.00	0.21
95	000768	中航西飞	1,800	48,150.00	0.19
96	603799	华友钴业	1,000	45,910.00	0.18
97	601658	邮储银行	9,200	44,988.00	0.18
98	601985	中国核电	6,300	44,415.00	0.18
99	300015	爱尔眼科	2,300	42,665.00	0.17
100	601818	光大银行	13,500	41,445.00	0.17
101	601288	农业银行	11,100	39,183.00	0.16
102	601899	紫金矿业	3,300	37,521.00	0.15
103	688599	天合光能	800	34,088.00	0.14
104	600754	锦江酒店	800	33,872.00	0.14
105	601377	兴业证券	5,400	33,048.00	0.13
106	600061	国投资本	3,600	25,632.00	0.10
107	600048	保利发展	1,900	24,757.00	0.10
108	300142	沃森生物	500	13,225.00	0.05
109	600085	同仁堂	200	11,512.00	0.05
110	601225	陕西煤业	300	5,457.00	0.02
111	600674	川投能源	300	4,515.00	0.02
112	002736	国信证券	400	3,492.00	0.01

### 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	6,500	192,920.00	0.77
2	601003	柳钢股份	47,000	189,880.00	0.76
3	000997	新大陆	10,000	189,000.00	0.76
4	002531	天顺风能	12,400	188,852.00	0.76
5	601077	渝农商行	47,600	170,884.00	0.69
6	002384	东山精密	6,100	157,990.00	0.63
7	601966	玲珑轮胎	7,000	155,540.00	0.62
8	600166	福田汽车	44,700	151,980.00	0.61
9	300638	广和通	6,000	136,080.00	0.55
10	600098	广州发展	21,400	132,252.00	0.53
11	603567	珍宝岛	8,500	127,160.00	0.51
12	603103	横店影视	7,300	122,932.00	0.49

13	002600	领益智造	17,600	121,616.00	0.49
14	603218	日月股份	6,400	121,536.00	0.49
15	600968	海油发展	35,500	108,985.00	0.44
16	002966	苏州银行	16,200	106,110.00	0.43
17	002273	水晶光电	8,400	100,296.00	0.40
18	002299	圣农发展	5,200	99,580.00	0.40
19	600020	中原高速	26,600	97,622.00	0.39
20	600583	海油工程	16,600	97,110.00	0.39
21	600489	中金黄金	9,100	94,003.00	0.38
22	002948	青岛银行	27,900	87,327.00	0.35
23	600197	伊力特	3,200	86,944.00	0.35
24	600329	达仁堂	1,900	85,291.00	0.34
25	002203	海亮股份	6,800	81,668.00	0.33
26	600315	上海家化	2,600	75,426.00	0.30
27	600728	佳都科技	10,700	74,151.00	0.30
28	688425	铁建重工	15,400	74,074.00	0.30
29	600418	江淮汽车	5,600	70,504.00	0.28
30	603228	景旺电子	2,700	69,255.00	0.28
31	600637	东方明珠	7,700	60,214.00	0.24
32	601098	中南传媒	5,000	58,000.00	0.23
33	002154	报喜鸟	10,400	57,408.00	0.23
34	603589	口子窖	1,100	54,285.00	0.22
35	300232	洲明科技	5,500	50,270.00	0.20
36	688029	南微医学	600	48,936.00	0.20
37	002152	广电运通	3,900	45,708.00	0.18
38	688082	盛美上海	400	44,160.00	0.18
39	300869	康泰医学	1,900	43,624.00	0.18
40	600517	国网英大	7,300	41,610.00	0.17
41	002739	万达电影	3,300	41,382.00	0.17
42	600977	中国电影	2,900	40,745.00	0.16
43	600578	京能电力	10,300	40,273.00	0.16
44	000027	深圳能源	6,100	40,199.00	0.16
45	002454	松芝股份	4,600	38,962.00	0.16
46	600498	烽火通信	1,800	36,666.00	0.15
47	601928	凤凰传媒	3,000	34,200.00	0.14
48	000739	普洛药业	1,700	30,158.00	0.12
49	002056	横店东磁	1,600	29,136.00	0.12
50	600271	航天信息	2,100	28,749.00	0.12
51	600863	内蒙华电	6,700	27,805.00	0.11
52	000738	航发控制	1,100	26,840.00	0.11
53	002563	森马服饰	3,800	23,636.00	0.09
54	002745	木林森	2,500	23,000.00	0.09
55	601019	山东出版	2,400	22,008.00	0.09

56	601921	浙版传媒	2,500	21,725.00	0.09
57	002335	科华数据	600	21,570.00	0.09
58	603305	旭升集团	620	17,279.40	0.07
59	601000	唐山港	4,600	16,238.00	0.07
60	600862	中航高科	600	15,186.00	0.06
61	688318	财富趋势	143	14,295.71	0.06
62	600909	华安证券	2,300	10,741.00	0.04
63	603989	艾华集团	400	8,424.00	0.03
64	300672	国科微	100	8,335.00	0.03
65	002449	国星光电	900	8,001.00	0.03
66	603171	税友股份	200	7,996.00	0.03
67	600380	健康元	600	7,626.00	0.03
68	600201	生物股份	800	7,608.00	0.03
69	603328	依顿电子	900	7,452.00	0.03
70	603517	绝味食品	200	7,430.00	0.03
71	603868	飞科电器	100	6,309.00	0.03
72	688006	杭可科技	28	853.16	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	1,725,966.00	6.93
2	300750	宁德时代	1,043,098.00	4.19
3	601318	中国平安	937,183.00	3.76
4	601319	中国人保	664,182.00	2.67
5	601601	中国太保	631,424.00	2.54
6	601816	京沪高铁	627,294.00	2.52
7	002129	TCL 中环	608,165.00	2.44
8	601012	隆基绿能	600,805.00	2.41
9	000858	五粮液	598,772.00	2.40
10	600809	山西汾酒	598,591.00	2.40
11	601328	交通银行	564,445.00	2.27
12	600016	民生银行	563,807.00	2.26
13	300014	亿纬锂能	561,633.00	2.26
14	601728	中国电信	559,892.00	2.25
15	601998	中信银行	545,433.00	2.19
16	000333	美的集团	524,589.00	2.11
17	600030	中信证券	519,321.00	2.09
18	601766	中国中车	511,697.00	2.05

19	000725	京东方 A	504,826.00	2.03
20	002475	立讯精密	502,317.00	2.02
21	601966	玲珑轮胎	501,963.00	2.02
22	600050	中国联通	499,244.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	516,166.00	2.07
2	601601	中国太保	513,126.00	2.06
3	601318	中国平安	452,322.00	1.82
4	601336	新华保险	445,465.00	1.79
5	601328	交通银行	431,376.00	1.73
6	600015	华夏银行	430,205.00	1.73
7	601225	陕西煤业	425,925.00	1.71
8	601319	中国人保	425,252.00	1.71
9	600977	中国电影	415,825.00	1.67
10	601816	京沪高铁	398,765.00	1.60
11	600809	山西汾酒	387,804.00	1.56
12	002475	立讯精密	371,740.00	1.49
13	002129	TCL 中环	367,967.00	1.48
14	601899	紫金矿业	363,759.00	1.46
15	600276	恒瑞医药	359,918.00	1.45
16	000063	中兴通讯	358,399.00	1.44
17	002739	万达电影	352,637.00	1.42
18	601966	玲珑轮胎	343,818.00	1.38
19	002938	鹏鼎控股	338,366.00	1.36
20	688599	天合光能	338,216.56	1.36

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	76,816,308.14
卖出股票收入（成交）总额	53,321,967.20

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信银行股份有限公司，2023 年 6 月因违反多项违法行为，被中国人民银行分支行处以责令改正的行政处罚。

本基金持有的前十名证券发行主体中国平安保险(集团)股份有限公司，2022 年 8 月因违反外汇账户管理规定，被国家外汇管理局处以责令改正的处罚。

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

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

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	62,469.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,469.13

### 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	1,377	8,532.37	10,009,000.00	85.19%	1,740,077.72	14.81%
国泰君安沪深 300 指数增强发起 C	103	133,836.09	13,199,722.49	95.75%	585,394.83	4.25%
合计	1,480	17,252.83	23,208,722.49	90.89%	2,325,472.55	9.11%

## 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	2,005.42	0.0171%
	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C	-	-
	合计	2,005.42	0.0079%

## 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	国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	0
	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C	0
	合计	0
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	0
	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C	0
	合计	0

注：本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

#### 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	58.82%	15,019,000.00	58.82%	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	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	2,005.42	0.01%	-	-	-
合计	15,021,005.42	58.83%	15,019,000.00	58.82%	-

#### § 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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,739,578.84	8,787,537.93
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	500.12	12,420.61
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	11,749,077.72	13,785,117.32

#### § 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、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

本基金本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期无涉及管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期无涉及托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	2	130,138,275.34	100.00%	9,279.10	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	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	证监会指定网站、公司官网	2023-04-13

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	证监会指定网站、公司官网	2023-04-13
3	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	证监会指定网站、公司官网	2023-04-13
4	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	证监会指定网站、公司官网	2023-04-13
5	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	证监会指定网站、公司官网	2023-04-13
6	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及招募说明书提示性公告	证券时报	2023-04-13
7	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金份额发售公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2023-04-13
8	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
9	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生效公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2023-04-20
10	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回和定期定额投资业务的公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2023-05-10

## § 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	20230419-20230630	15,019,000.00	-	-	15,019,000.00	58.82%
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) 基金在短期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

二〇二三年八月三十一日