

# 国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 03 月 29 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。本年度报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年03月15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。

本报告期自2023年01月01日起至2023年12月31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	7
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、基金净值表现及利润分配情况</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
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
<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	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	17
4.9 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 .....	17
<b>§ 5 托管人报告 .....</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	17
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 .....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	17
<b>§ 6 审计报告 .....</b>	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	17
6.2 审计报告的基本内容 .....	18
<b>§ 7 年度财务报表 .....</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表 .....	19
7.2 利润表 .....	21
7.3 净资产变动表 .....	23
7.4 报表附注 .....	24
<b>§ 8 投资组合报告 .....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	55
8.3 期末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 .....	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	101
8.6 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 .....	101
8.7 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 .....	101

8.8 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 .....	101
8.9 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 .....	101
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	101
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	102
8.12 投资组合报告附注 .....	102
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>103</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	103
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	103
9.3 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 .....	103
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>104</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>104</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	104
11.2 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 .....	104
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	105
11.4 基金投资策略的改变 .....	105
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	105
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	105
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	105
11.8 其他重大事件 .....	106
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>107</b>
12.1 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 .....	107
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	107

§ 13 备查文件目录 .....	108
13.1 备查文件目录 .....	108
13.2 存放地点 .....	108
13.3 查阅方式 .....	108

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	国泰君安中证 1000 指数增强	
基金主代码	015867	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 08 月 16 日	
基金管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,410,006,840.95 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安中证 1000 指数增强 A	国泰君安中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	015867	015868
报告期末下属分级基金的份额总额	350,853,146.00 份	1,059,153,694.95 份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	上海国泰君安证券资产管理有 限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责 人	姓名	吕巍
	联系电话	021-38676022
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com
客户服务电话	95521	95599
传真	021-38871190	010-68121816
注册地址	上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	上海市静安区新闻路 669 号博 华广场 22-23 层及 25 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200120	100031
法定代表人	陶耿	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名 称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理 人互联网网址	www.gtjazg.com
基金年度报告备置地点	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
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
注册登记机构	上海国泰君安证券资产管理有限公司	上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023 年		2022 年 08 月 16 日（基金合同生效 日）-2022 年 12 月 31 日	
	国泰君安中证 1000 指数增强 A	国泰君安中证 1000 指数增强 C	国泰君安中证 1000 指数增强 A	国泰君安中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	9,488,340.57	-34,974,876.67	-22,804,544.93	-19,117,772.21
本期利润	14,005,967.62	-39,926,248.80	-30,625,689.66	-25,064,443.75

加权平均基金份额本期利润	0.0517	-0.0692	-0.0936	-0.0927
本期加权平均净值利润率	5.32%	-7.23%	-9.91%	-9.82%
本期基金份额净值增长率	2.56%	2.17%	-9.49%	-9.63%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	-25,148,788.07	-81,287,633.53	-29,399,701.55	-26,319,563.35
期末可供分配基金份额利润	-0.0717	-0.0767	-0.0949	-0.0963
期末基金资产净值	325,704,357.93	977,866,061.42	280,402,577.08	247,099,194.86
期末基金份额净值	0.9283	0.9233	0.9051	0.9037
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-7.17%	-7.67%	-9.49%	-9.63%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 国泰君安中证 1000 指数增强 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.18%	0.97%	-2.98%	0.98%	-0.20%	-0.01%
过去六个月	-7.18%	0.94%	-10.28%	0.95%	3.10%	-0.01%
过去一年	2.56%	0.90%	-5.91%	0.90%	8.47%	0.00%
自基金合同生效起至今	-7.17%	0.98%	-18.21%	1.01%	11.04%	-0.03%

##### 国泰君安中证 1000 指数增强 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.27%	0.97%	-2.98%	0.98%	-0.29%	-0.01%
过去六个月	-7.36%	0.94%	-10.28%	0.95%	2.92%	-0.01%
过去一年	2.17%	0.90%	-5.91%	0.90%	8.08%	0.00%
自基金合同生效起至今	-7.67%	0.98%	-18.21%	1.01%	10.54%	-0.03%

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

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

(2022年08月16日-2023年12月31日)



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

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

(2022年08月16日-2023年12月31日)



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

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2022 年按实际存续期计算。



注：2022 年按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

## § 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 12 月 31 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 48 只公开募集证券投资基金。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡崇海	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金基金经理。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。	2022-08-16	-	12 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士，12 年证券从业经验，具备基金从业资格。曾任香港科技大学人工智能实验室访问学者，其后加盟方正证券研究所、国泰君安证券咨询部及研究所从事量化对冲模型的研发工作，2014 年加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，先后在量化投资部、权益与衍生品部担任高级投资经理，从事量化投资和策略研发工作，在 Alpha 量化策略以及基于机器学习的投资方面有独到且深入的研究。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《上海国泰君安证券资产管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 27 次。本基金与本公司管理的其他组合在不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)同向交易的交易价差未出现异常。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年在国内经济弱复苏、美联储加息和全球避险情绪高涨的背景下，A 股市场经历了年初冲高后长期的震荡下行。年初市场因超预期的宏观经济数据以及宽松的政策环境而表现出乐观，但随着经济复苏放缓和宏观数据回落，市场进入震荡下行期。三、四季度，尽管有强力的政策支持，但

中美关系紧张和地缘政治因素使市场持续低迷。我们对 2024 年 A 股市场持乐观态度，2023 年开年至今，经济已显现见底回升的积极态势且政策呵护有力，同时 A 股市场的估值优势愈发显著，在美元降息周期中，A 股将更加有配置价值。

从主要宽基指数来看，中证 1000 指数表现一般（跌幅 6.28%），差于中证 2000 指数（涨幅 5.57%），好于中证 500 指数（跌幅 7.42%）和沪深 300 指数（跌幅 11.38%）。除主要宽基指数外，创业板指数全年跌幅较大（跌幅 19.41%）。A 股全年波动较大，且行业轮动频繁，主题投资机会也快速切换。以中特估和人工智能为代表的结构性投资机会贯穿全年，为投资者提供了一定的收益贡献。2023 年行业表现分化明显，其中 TMT 板块尤其是通信行业以超过 20% 的收益率领跑，而在经济复苏不达预期的背景下，消费板块表现疲软。房地产行业在 2023 年获得显著的政策支持，但是由于实际的去化和债务问题，行业表现不及预期。展望 2024 年，科技成长板块和高技术制造业估值已经处于低位，加上持续的政策支持，有不错的成长机会。政策的发力方向仍然会持续在地产和科创上，同时以大宗消费、文旅消费为抓手的扩内需政策将继续推进。

从主要风险因子的走势来看，全年部分风险因子的收益表现较为持续，整体而言，小盘、低波和价值风格是 2023 年的主题。从大小盘风格来看，从一季度开始小盘风格在 ChatGPT 引发的 TMT 板块强势表现的带动下涨幅较好，除二季度受国内经济数据低于预期的影响下大盘风格占优，其他时间小盘风格相对占优。从成长价值风格来看，在国内经济复苏不及预期和外部因素扰动下，受风险情绪拖累，资金偏好投资较稳健的价值和红利风格，价值股在 2023 年相对成长股表现更佳。此外，成长因子和分析师情绪因子全年持续表现弱势。Alpha 表现方面，全年整体基本面因子表现较好，同时，实时量价因子的整体表现受制于缩量下行的低波行情，整体也有所减弱。展望 2024 年，随着经济进一步复苏以及政策进一步发力，资本市场信心和活跃度有望逐步恢复，我们认为基本面和量价模型会有较好的发挥空间，同时我们也将根据市场的演化过程不断引入新的因子和改良原有的模型，并强化选股模型对不同风格的适应能力，在保持稳重求胜的风格下追求更好的超额收益率。

从中证 1000 指数当前的估值水平来看，截至 12 月底其加权 PE 和整体 PE 分别在 41 倍和 35 倍左右，依然处于历史较为低估的水平，整体 PE 在历史上的分位数低于 26%，而用 PB 估值的话，则历史分位数更低，处于历史分位数 3.7% 之内。从业绩的可持续角度来看，估值进一步向下的空间要显著小于向上的空间。未来随着经济的全面逐步复苏，有望迎来估值和盈利的双击。我们认为做为一个高成长性、盈利增长潜力巨大，行业分布均匀的中小盘宽基指数，中证 1000 指数依然是当前市场环境下的进可攻、退可守的选择。

随着 A 股盈利预期改善，美债利率高位回落，中央经济工作会议定调积极，未来稳增长政策进一步推动，近期市场已接近底部，2024 年具备回升条件。我们预计，未来一年市场依然会保持风格切换较快的特点，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。在本基金中，我们通过挖掘有投资逻辑的 Alpha 因子，不断改进底层量化模型以及定期监控策略的表现等方式来增强策略表现。我们一直坚守一贯的投资体系和理念，并尽可能以此来稳定投资者对我们超额收益率的预期。在量化增强层面，我们将结合财务数据为基础的基本面信号和实时量价信号，通过机器学习模型来有效

选择因子，并通过投资组合管理来控制模型在主要市场风险和行业上相对于基准指数的暴露程度，力求以较为稳定的方式增强中证 1000 指数。过去两年，市场在小盘和低波风格上一直有持续的超额，诚然确实由于我们严格的风险控制，在这方面获益很小，也有值得反思的地方，但是我们更希望通过在追求更纯粹 Alpha 方面付出更多努力，以此来降低策略对市场风格的依赖。另外一方面，由于本基金采用的基本面量化信号和实时量价信号在逻辑和数值层面均有较低的相关性，我们相信能够在兼顾两者的情况下追求稳健的 Alpha，当然如何更有效发挥两者的协同和共振效应，并根据市场的流动性和波动率进行及时优化，都是需要我们不断精进的地方，至少在过去一年我们这方面做得并不好。最后，作为宽基指数的增强型量化产品，我们具有越跌越安全的特点，投资管理人始终保持高仓位运作，并以稳健的方式跑赢指数。我们的投资策略是通过积少成多、以概率取胜的方式增厚投资收益，因此更需要投资者长期持有。我们认为中证 1000 指数当前依然处于历史低估阶段，成长性良好，指数未来上涨的空间依然远大于下跌的空间，我们将努力通过科学的手段增强量化模型的超额收益率水平，以此不断为客户增厚投资收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 0.9283 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.56%，同期业绩比较基准收益率为-5.91%；截至报告期末国泰君安中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 0.9233 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.17%，同期业绩比较基准收益率为-5.91%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A 股已经经历了接近 3 年的下行走势，大部分宽基指数的估值来到了历史的下轨附近，充分体现了市场对未来经济下行以及经济转型阵痛的预期。2023 年是资本市场全面深化改革的关键年，围绕全面注册制改革、防范化解风险和提振市场信心，资本市场进行一系列重大改革，从投资端、融资端、交易端等方面制定了一揽子措施。我们认为全面降低交易费率、强化上市公司监管、提升上市公司分红和回购意识、规范化大股东减持制度等等，均是对资本市场长期痼疾的治本之策，扎扎实实提升了 A 股长期投资价值。展望 2024 年，货币政策有望延续宽松格局，资本市场资金迎来新结构和新均衡，资金面有望温和净流入。随着美联储结束加息以及进入降息，美元指数和美债收益率迎来“双降”，叠加国内经济和盈利预期改善的提振作用，外资有望回流。在货币宽松的市场环境下，市场风险偏好回暖，资金供给端的规模有望较 2023 年明显改善，成长股有望迎来显著的修复性行情。中证 1000 指数作为市场当前中小盘股的典型代表，具有较强的新兴产业属性，不管是相对估值和绝对估值，均有较强安全垫。从量化模型的 Alpha 角度来看，诚然过去几年随着私募量化行业以及场外衍生品的快速发展，中证 1000 指数的波动率变得越来越低，在中证 1000 上博取超额收益的难度也越来越受到挑战。但是我们也要看到，以雪球为主的场外衍生品、融券 T0 和 DMA 的出清和规范化监管，反而一定程度上缓解了主要宽基指数成分股内的拥挤程度，有利于量化行业的长期有序发展。另一方面在投研过程中，我们也逐步强化另类因子的挖掘、异质化思维建模和提升实盘

模型的逻辑性等，尽量提升在主要宽基指数上博取纯粹 Alpha 的能力。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合规运作角度出发，在合规文化建设、制度体系建设、合规审查及检查、反洗钱、员工执业行为规范等角度开展工作，不断深化员工的合规意识，推动公司合规文化和内部风险控制机制的完善和优化。

内部监察工作重点包括以下几个方面：

1、合规文化建设。管理人通过内外部合规培训、合规考试、法规解读、法律法规库维护更新、监管会议精神传达等多种形式推动公司合规文化建设，不断提高全体员工合规意识，为公司业务健康发展提供良好的文化土壤。

2、制度体系建设和完善。管理人根据法律法规变化，结合行业新动态，围绕新业务需要，不断优化和健全公司制度体系，并注重相关制度体系的落实和执行。通过制度体系的建设和完善，不断提升了业务管理流程的健全性、规范性、精细化和可操作性，为公司业务规范运营和合规管理进一步夯实了制度基础。

3、合规审查和检查。根据法律法规、监管要求和公司制度规定，做好对公司新业务、新产品、新投资品种及其他创新业务的法律合规及风险控制支持，定期对产品销售、投资、研究及交易等相关业务活动的日常合规性进行检查，查漏补缺。合规检查工作促进了内部控制管理的完善，防范了合规风险的进一步发生。

4、员工执业与投资行为管理。根据法律法规和公司制度要求，管理人不断加强员工执业行为管理。管理人要求新员工入职时需提供和完善个人信息并完成相关投资的申报工作，对投资、交易人员的通讯工具实行交易时间段集中管理，并对监控摄像、电子邮件、电话录音和即时通讯工具聊天记录定期进行合规检查。通过一系列常态化的员工执业和投资行为管理，促进员工执业和投资行为持续符合监管要求。

5、反洗钱合规管理。本报告期内，管理人持续加强反洗钱合规管理，制定反洗钱工作方案，并在年度内推进落实。持续做好日常可疑交易监控排查、客户风险等级划分、修订反洗钱内部控制管理制度、跟进反洗钱系统改造、完成各类反洗钱工作报告、反洗钱金融机构分类评级自评工作等。

管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部合规风控工作的科学性和有效性，努力防范和控制各类风险，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—上海国泰君安证券资产管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

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

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

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 21328 号
--------	-------------------------

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金(以下简称“国泰君安中证 1000 指数增强基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了国泰君安中证 1000 指数增强基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于国泰君安中证 1000 指数增强基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>国泰君安中证 1000 指数增强基金的基金管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估国泰君安中证 1000 指数增强基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算国泰君安中证 1000 指数增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督国泰君安中证 1000 指数增强基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致

任	<p>的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国泰君安中证 1000 指数增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国泰君安中证 1000 指数增强基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	薛竞   段黄霖
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2024-03-25

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	137,588,188.36	34,006,559.91
结算备付金		8,988,273.99	4,351,911.30
存出保证金		1,413,120.00	1,475,232.00
交易性金融资产	7.4.7.2	1,221,467,913.87	489,082,299.73
其中：股票投资		1,221,467,913.87	489,082,299.73
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,787,300.69	169,457.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		1,371,244,796.91	529,085,459.95
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		65,789,523.93	836,295.84
应付管理人报酬		1,180,358.76	449,025.65
应付托管费		177,053.81	67,353.83
应付销售服务费		367,427.07	79,917.68
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	160,013.99	151,095.01
负债合计		67,674,377.56	1,583,688.01
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	1,410,006,840.95	583,221,036.84
未分配利润	7.4.7.8	-106,436,421.60	-55,719,264.90
净资产合计		1,303,570,419.35	527,501,771.94
负债和净资产总计		1,371,244,796.91	529,085,459.95

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,410,006,840.95 份。其中国泰君安中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 0.9283 元，基金份额总额 350,853,146.00 份；国泰君安中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 0.9233 元，基金份额总额 1,059,153,694.95 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 08 月 16 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-14,262,365.77	-52,727,131.14
1. 利息收入		387,048.25	210,166.59
其中：存款利息收入	7.4.7.9	387,048.25	210,166.59
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-15,671,905.33	-39,255,205.04
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-19,470,015.50	-38,667,848.94
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	7.4.7.11	-1,372,709.68	-726,034.49
股利收益	7.4.7.12	5,170,819.85	138,678.39
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	-433,745.08	-13,767,816.27
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	1,456,236.39	85,723.58
<b>减：二、营业总支出</b>		11,657,915.41	2,963,002.27
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	8,090,172.17	2,112,096.65
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,213,525.78	316,814.49
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,179,381.39	381,993.31

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		4,643.55	-
8. 其他费用	7.4.7.15	170,192.52	152,097.82
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-25,920,281.18	-55,690,133.41
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-25,920,281.18	-55,690,133.41
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-25,920,281.18	-55,690,133.41

### 7.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	583,221,036.84	-55,719,264.90	527,501,771.94
二、本期期初净资产	583,221,036.84	-55,719,264.90	527,501,771.94
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	826,785,804.11	-50,717,156.70	776,068,647.41
（一）、综合收益总额	-	-25,920,281.18	-25,920,281.18
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	826,785,804.11	-24,796,875.52	801,988,928.59
其中：1. 基金申购款	1,901,245,280.63	-54,687,106.26	1,846,558,174.37
2. 基金赎回款	-1,074,459,476.52	29,890,230.74	-1,044,569,245.78
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-

四、本期期末净资产	1,410,006,840.95	-106,436,421.60	1,303,570,419.35
项 目	上年度可比期间 2022 年 08 月 16 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	609,392,211.62	-	609,392,211.62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-26,171,174.78	-55,719,264.90	-81,890,439.68
（一）、综合收益总额	-	-55,690,133.41	-55,690,133.41
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-26,171,174.78	-29,131.49	-26,200,306.27
其中：1. 基金申购款	46,845,172.90	-3,944,917.63	42,900,255.27
2. 基金赎回款	-73,016,347.68	3,915,786.14	-69,100,561.54
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	583,221,036.84	-55,719,264.90	527,501,771.94

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

陶耿	庄严	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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)已获中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]983 号《关于准予国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》，由上海国泰君安证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2022 年 8 月 1 日至 2022 年 8 月 12 日共募集 609,312,722.10 元(不含认购资金利息)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天(2022)验字第 0724 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2022 年 8 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额 609,392,211.62 份基金份额，其中认购资金利息折合 79,489.52 份基金份额。本基金的基金管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份券(包

括存托凭证、下同)、备选成份券(包括存托凭证、下同)、其他国内依法发行上市的股票和存托凭证(包括主板、创业板和其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转换债)、可交换债、公开发行的次级债、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、中期票据等)、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票、存托凭证资产的比例不低于基金资产的 80%,投资于中证 1000 指数成份券及其备选成份券的资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,待履行适当程序后,以变更后的规定为准。本基金的业绩比较基准为:中证 1000 指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司于 2024 年 3 月 25 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 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。比较财务报表的实际编制期间为 2022 年 8 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 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、金融负债或权益工具。(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商业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商业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。

#### 7.4.4.4 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。

#### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 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。

#### 7.4.4.11 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。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》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。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以产生的利息及利息性质的收入为销售额。(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按

50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	82,565,277.53	13,498,189.70
等于：本金	82,553,164.07	13,495,870.13
加：应计利息	12,113.46	2,319.57
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	55,022,910.83	20,508,370.21
等于：本金	55,019,334.88	20,505,675.72
加：应计利息	3,575.95	2,694.49
减：坏账准备	-	-
合计	137,588,188.36	34,006,559.91

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。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,235,846,447.68	-	1,221,467,913.87	-14,378,533.81
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	1,235,846,447.68	-	1,221,467,913.87	-14,378,533.81
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	502,702,557.59	-	489,082,299.73	-13,620,257.86
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	502,702,557.59	-	489,082,299.73	-13,620,257.86

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 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 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	11,599,027.54	0.00	-	-
—股指期货	11,599,027.54	0.00	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,599,027.54	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	9,982,438.41	0.00	-	-
—股指期货	9,982,438.41	0.00	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	9,982,438.41	-	-	-

##### 7.4.7.3.2 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
IM2401	IM2401	10	11,776,000.00	176,972.46
合计				176,972.46
减：可抵销期货暂收款				176,972.46
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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 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未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	13.99	1,095.01
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	120,000.00	110,000.00
预提审计费	40,000.00	40,000.00
合计	160,013.99	151,095.01

7.4.7.7 实收基金

国泰君安中证 1000 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	309,802,278.63	309,802,278.63
本期申购	357,057,144.74	357,057,144.74
本期赎回（以“-”号填列）	-316,006,277.37	-316,006,277.37
本期末	350,853,146.00	350,853,146.00

国泰君安中证 1000 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	273,418,758.21	273,418,758.21
本期申购	1,544,188,135.89	1,544,188,135.89
本期赎回（以“-”号填列）	-758,453,199.15	-758,453,199.15
本期末	1,059,153,694.95	1,059,153,694.95

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

国泰君安中证 1000 指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-21,790,974.32	-7,608,727.23	-29,399,701.55
本期期初	-21,790,974.32	-7,608,727.23	-29,399,701.55
本期利润	9,488,340.57	4,517,627.05	14,005,967.62
本期基金份额交易产生的变动数	-1,361,060.43	-8,393,993.71	-9,755,054.14
其中：基金申购款	-2,750,252.65	-11,426,367.66	-14,176,620.31
基金赎回	1,389,192.22	3,032,373.95	4,421,566.17

回款			
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,663,694.18	-11,485,093.89	-25,148,788.07

**国泰君安中证 1000 指数增强 C**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-19,606,392.30	-6,713,171.05	-26,319,563.35
本期期初	-19,606,392.30	-6,713,171.05	-26,319,563.35
本期利润	-34,974,876.67	-4,951,372.13	-39,926,248.80
本期基金份额交易产生的变动数	7,904,239.24	-22,946,060.62	-15,041,821.38
其中：基金申购款	1,681,112.99	-42,191,598.94	-40,510,485.95
基金赎回款	6,223,126.25	19,245,538.32	25,468,664.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-46,677,029.73	-34,610,603.80	-81,287,633.53

**7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 08 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	214,353.68	87,770.28
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	88,961.37	91,660.11
结算备付金利息收入	83,733.20	30,736.20
其他	-	-
合计	387,048.25	210,166.59

7.4.7.10 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 08 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	17,195,131,517.21	4,438,866,645.63
减：卖出股票成本总额	17,196,487,532.16	4,471,679,343.81
减：交易费用	18,114,000.55	5,855,150.76
买卖股票差价收入	-19,470,015.50	-38,667,848.94

7.4.7.11 衍生工具收益

7.4.7.11.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 08 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-1,126,170.87	-701,961.59
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	38,696.30	-
减：交易费用	207,842.51	24,072.90
合计	-1,372,709.68	-726,034.49

7.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 08 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	5,170,819.85	138,678.39
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	5,170,819.85	138,678.39

7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 08 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-758,275.95	-13,620,257.86
——股票投资	-758,275.95	-13,620,257.86

——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	324,530.87	-147,558.41
——权证投资	-	-
——期货投资	324,530.87	-147,558.41
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	-433,745.08	-13,767,816.27

#### 7.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 08 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,456,236.39	85,723.58
合计	1,456,236.39	85,723.58

#### 7.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 08 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	110,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	9,392.52	2,097.82
证券账户开户费	800.00	-
合计	170,192.52	152,097.82

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

##### 7.4.9.1 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。

##### 7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 08 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 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	35,114,018,836.58	100.00%	9,411,604,212.72	100.00%

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 7.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的基金交易。

#### 7.4.10.1.6 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 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 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	2,503,131.27	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 08 月 16 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 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	670,908.08	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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 08 月 16 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,090,172.17	2,112,096.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,648,927.94	1,041,713.21
应支付基金管理人的净管理费	5,441,244.23	1,070,383.44

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

其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 08 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,213,525.78	316,814.49

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

其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安中证 1000 指数增强 A	国泰君安中证 1000 指数增强 C	合计
国泰君安证券	-	607,254.28	607,254.28
国泰君安资管	-	681,306.44	681,306.44
合计	-	1,288,560.72	1,288,560.72
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 08 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安中证 1000 指数增强 A	国泰君安中证 1000 指数增强 C	合计
国泰君安证券	-	377,928.55	377,928.55
国泰君安资管	-	1,974.74	1,974.74
合计	-	379,903.29	379,903.29

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。

其计算公式为：

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

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

##### 国泰君安中证 1000 指数增强 C

份额单位：份

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 08 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2022 年 08 月 16 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	8,314,279.78	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减:报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	8,314,279.78	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.78%	-

注:分类基金基金管理人持有本基金份额占总份额比例的计算中,对下属分类基金,比例的分母采用各自类别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分类基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

#### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 08 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	82,565,277.53	214,353.68	13,498,189.70	87,770.28
国泰君安证券	55,022,910.83	88,961.37	20,508,370.21	91,660.11

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

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:张)	总金额

国泰君安证券	301456	盘古智能	网下询价	4,061.00	154,155.56
上年度可比期间 2022 年 08 月 16 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额

注：本基金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。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
688717	艾罗能源	2023 年 12 月 26 日	1 个月内(含)	新股未上市	55.66	55.66	16,147	898,742.02	898,742.02	-
688702	盛科通信	2023 年 09 月 06 日	6 个月	新股锁定	42.66	48.18	539	22,993.74	25,969.02	-
301559	中集环科	2023 年 09 月 26 日	6 个月	新股锁定	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
688627	精智达技术	2023 年 07 月 11 日	6 个月	新股锁定	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
301525	儒	2023 年	6 个月	新股	99.57	81.46	215	21,407.55	17,513.90	-

	竞科技	08 月 23 日		锁定						
301509	金凯生科	2023 年 07 月 26 日	6 个月	新股锁定	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-
601096	宏盛华源铁塔集团	2023 年 12 月 15 日	6 个月	新股锁定	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
301468	博盈特焊	2023 年 07 月 12 日	6 个月	新股锁定	47.58	30.22	468	22,267.44	14,142.96	-
688610	埃科光电	2023 年 07 月 10 日	6 个月	新股锁定	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股锁定	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301456	盘古智能	2023 年 07 月 06 日	6 个月	新股锁定	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
688602	康鹏科技	2023 年 07 月 13 日	6 个月	新股锁定	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688719	爱科赛博	2023 年 09 月 20 日	6 个月	新股锁定	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
301508	中机认检	2023 年 11 月 23 日	6 个月	新股锁定	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301251	威	2023 年	6 个月	新股	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-

	尔高	08 月 30 日		锁定						
688592	司南导航	2023 年 08 月 07 日	6 个月	新股锁定	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
688603	天承科技	2023 年 06 月 30 日	6 个月	新股锁定	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688653	康希通信	2023 年 11 月 10 日	6 个月	新股锁定	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688716	中研股份	2023 年 09 月 13 日	6 个月	新股锁定	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
301413	安培龙	2023 年 12 月 11 日	6 个月	新股锁定	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023 年 08 月 10 日	6 个月	新股锁定	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301516	中远通	2023 年 12 月 01 日	6 个月	新股锁定	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301272	英华特	2023 年 07 月 06 日	6 个月	新股锁定	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301469	恒达新材	2023 年 08 月 10 日	6 个月	新股锁定	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301518	长华化学	2023 年 07 月 26 日	6 个月	新股锁定	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301568	思泰克	2023 年 11 月 21 日	6 个月	新股锁定	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301520	万邦	2023 年 09 月 18 日	6 个月	新股锁定	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-

	医药	日								
688638	誉辰智能	2023 年 07 月 04 日	6 个月	新股锁定	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-
301459	丰茂股份	2023 年 12 月 06 日	6 个月	新股锁定	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
688720	艾森股份	2023 年 11 月 29 日	6 个月	新股锁定	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-
301517	陕西华达	2023 年 10 月 09 日	6 个月	新股锁定	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301578	辰奕智能	2023 年 12 月 21 日	6 个月	新股锁定	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
301548	崇德科技	2023 年 09 月 11 日	6 个月	新股锁定	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
688657	浩辰软件	2023 年 09 月 25 日	6 个月	新股锁定	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688646	逸飞激光	2023 年 07 月 21 日	6 个月	新股锁定	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688693	锆威特	2023 年 08 月 10 日	6 个月	新股锁定	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
603062	麦加芯彩	2023 年 10 月 31 日	6 个月	新股锁定	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
301555	惠柏新	2023 年 10 月 24 日	6 个月	新股锁定	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-

	材										
301505	苏州规划	2023 年 07 月 12 日	6 个月	新股锁定	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-	
301529	福赛科技	2023 年 08 月 31 日	6 个月	新股锁定	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-	
688648	中邮科技	2023 年 11 月 06 日	6 个月	新股锁定	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-	
603004	鼎龙科技	2023 年 12 月 20 日	6 个月	新股锁定	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-	
603107	上海汽配	2023 年 10 月 25 日	6 个月	新股锁定	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-	
603193	润本生物技术股份	2023 年 10 月 09 日	6 个月	新股锁定	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-	
001306	夏厦精密	2023 年 11 月 09 日	6 个月	新股锁定	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-	
603075	热威科技股份	2023 年 09 月 01 日	6 个月	新股锁定	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-	
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月	新股锁定	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-	
603231	索	2023 年	6 个月	新股	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-	

	宝蛋白	12 月 06 日		锁定						
603373	安邦护卫集团股份	2023 年 12 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司，其他银行存款为国泰君安证券券商保证金，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2023 年 12 月 31 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）。

#### 7.4.13.3 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 12 月 31 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。

##### 7.4.13.3.1 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 7.4.12。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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
----------------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
货币资金	137,588,188.36	-	-	-	137,588,188.36
结算备付金	8,988,273.99	-	-	-	8,988,273.99
存出保证金	1,413,120.00	-	-	-	1,413,120.00
交易性金融资产	-	-	-	1,221,467,913.87	1,221,467,913.87
应收申购款	-	-	-	1,787,300.69	1,787,300.69
资产总计	147,989,582.35	-	-	1,223,255,214.56	1,371,244,796.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	65,789,523.93	65,789,523.93
应付管理人报酬	-	-	-	1,180,358.76	1,180,358.76
应付托管费	-	-	-	177,053.81	177,053.81
应付销售服务费	-	-	-	367,427.07	367,427.07
其他负债	-	-	-	160,013.99	160,013.99
负债总计	-	-	-	67,674,377.56	67,674,377.56
利率敏感度缺口	147,989,582.35	-	-	1,155,580,837.00	1,303,570,419.35
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					
货币资金	34,006,559.91	-	-	-	34,006,559.91
结算备付金	4,351,911.30	-	-	-	4,351,911.30
存出保证金	1,475,232.00	-	-	-	1,475,232.00
交易性金融资产	-	-	-	489,082,299.73	489,082,299.73
应收申购款	-	-	-	169,457.01	169,457.01
资产总计	39,833,703.21	-	-	489,251,756.74	529,085,459.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	836,295.84	836,295.84
应付管理人报酬	-	-	-	449,025.65	449,025.65
应付托管费	-	-	-	67,353.83	67,353.83
应付销售服务费	-	-	-	79,917.68	79,917.68
其他负债	-	-	-	151,095.01	151,095.01
负债总计	-	-	-	1,583,688.01	1,583,688.01

利率敏感度缺口	39,833,703.21	-	-	487,668,068.73	527,501,771.94
---------	---------------	---	---	----------------	----------------

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 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)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	1,221,467,913.87	93.70	489,082,299.73	92.72
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,221,467,913.87	93.70	489,082,299.73	92.72

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资 (附注 7.4.7.3)。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。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 7.4.1）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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准（附注 7.4.1）上升 5%	64,014,470.98	-
	业绩比较基准（附注 7.4.1）下降 5%	-64,014,470.98	-

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,220,093,214.86	487,907,465.38
第二层次	898,742.02	844,662.00
第三层次	475,956.99	330,172.35
合计	1,221,467,913.87	489,082,299.73

###### 7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	330,172.35	330,172.35
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,055,459.71	1,055,459.71
转出第三层次	-	1,053,298.62	1,053,298.62
当期利得或损失总额	-	143,623.55	143,623.55
其中：计入损益的利得或损失	-	143,623.55	143,623.55
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	475,956.99	475,956.99
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	38,598.52	38,598.52
项目	上年度可比期间 2022 年 08 月 16 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	287,723.21	287,723.21
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	42,449.14	42,449.14
其中：计入损益的利得或损失	-	42,449.14	42,449.14
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	330,172.35	330,172.35
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允	-	42,449.14	42,449.14

价值变动损益			
--------	--	--	--

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2023 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

**7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况**

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	475,956.99	亚式期权模型	预期年化波动率	14.62%~217.75%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	330,172.35	亚式期权模型	预期年化波动率	31.73%~119.05%	负相关

**7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

**7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	1,221,467,913.87	89.08
	其中：股票	1,221,467,913.87	89.08
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	146,576,462.35	10.69
8	其他各项资产	3,200,420.69	0.23
9	合计	1,371,244,796.91	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	8,768,897.00	0.67
B	采矿业	6,998,654.76	0.54
C	制造业	692,418,149.60	53.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,654,199.00	2.04
E	建筑业	28,280,262.70	2.17
F	批发和零售业	18,044,440.00	1.38

G	交通运输、仓储和邮政业	33,410,569.16	2.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	104,224,620.09	8.00
J	金融业	5,955,614.00	0.46
K	房地产业	9,606,425.40	0.74
L	租赁和商务服务业	2,653,068.20	0.20
M	科学研究和技术服务业	11,286,746.44	0.87
N	水利、环境和公共设施管理业	3,532,219.60	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,089,516.50	0.54
R	文化、体育和娱乐业	41,062,691.00	3.15
S	综合	140,917.00	0.01
	合计	1,000,126,990.45	76.72

### 8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,372,712.00	0.34
C	制造业	143,775,170.68	11.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,830,353.00	0.75
E	建筑业	1,333,780.00	0.10
F	批发和零售业	3,246,440.33	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	5,134,088.00	0.39
H	住宿和餐饮业	200,162.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,074,570.95	3.07
J	金融业	2,105,427.00	0.16
K	房地产业	224,756.00	0.02
L	租赁和商务服务业	2,471,524.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	1,179,042.46	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	63,366.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	149,048.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	7,180,483.00	0.55
S	综合	-	-
	合计	221,340,923.42	16.98

### 8.2.3 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。

### 8.3 期末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

#### 8.3.1 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601949	中国出版	1,522,200	12,299,376.00	0.94
2	002913	奥士康	391,400	11,996,410.00	0.92
3	603583	捷昌驱动	545,802	10,932,414.06	0.84
4	600623	华谊集团	1,559,300	10,041,892.00	0.77
5	002204	大连重工	2,123,846	9,705,976.22	0.74
6	000582	北部湾港	1,292,000	9,702,920.00	0.74
7	002745	木林森	1,114,950	9,655,467.00	0.74
8	300319	麦捷科技	958,800	9,242,832.00	0.71
9	600812	华北制药	1,608,500	9,168,450.00	0.70
10	600578	京能电力	3,079,900	9,116,504.00	0.70
11	002274	华昌化工	1,166,000	8,803,300.00	0.68
12	000650	仁和药业	1,323,700	8,776,131.00	0.67
13	600776	东方通信	776,000	8,761,040.00	0.67
14	300303	聚飞光电	1,437,700	8,525,561.00	0.65
15	002390	信邦制药	1,918,597	8,518,570.68	0.65
16	600595	中孚实业	2,445,539	8,510,475.72	0.65
17	002276	万马股份	815,900	8,338,498.00	0.64
18	601801	皖新传媒	1,177,000	8,180,150.00	0.63
19	600966	博汇纸业	1,311,800	8,146,278.00	0.62
20	600872	中炬高新	287,800	8,087,180.00	0.62
21	002467	二六三	1,715,400	7,959,456.00	0.61
22	000597	东北制药	1,486,900	7,954,915.00	0.61
23	002041	登海种业	589,400	7,797,762.00	0.60
24	601399	国机重装	2,743,320	7,763,595.60	0.60
25	600696	岩石股份	418,800	7,534,212.00	0.58
26	600531	豫光金铅	1,235,500	7,474,775.00	0.57
27	688128	中国电器研究院	357,752	7,341,071.04	0.56
28	002701	奥瑞金	1,753,400	7,259,076.00	0.56
29	601921	浙版传媒	928,500	7,093,740.00	0.54
30	300476	胜宏科技	382,300	7,053,435.00	0.54
31	300634	彩讯股份	338,100	6,920,907.00	0.53
32	301165	锐捷网络	180,500	6,839,145.00	0.52
33	600409	三友化工	1,244,300	6,831,207.00	0.52
34	002206	海利得	1,333,500	6,694,170.00	0.51
35	002946	新乳业	582,500	6,687,100.00	0.51

36	301301	川宁生物	786,600	6,607,440.00	0.51
37	002043	兔宝宝	741,000	6,565,260.00	0.50
38	601908	京运通	1,432,600	6,546,982.00	0.50
39	601952	苏垦农发	638,800	6,541,312.00	0.50
40	002537	海联金汇	975,900	6,499,494.00	0.50
41	301071	力量钻石	199,520	6,444,496.00	0.49
42	601606	长城军工	528,700	6,439,566.00	0.49
43	600667	太极实业	904,300	6,357,229.00	0.49
44	000969	安泰科技	706,900	6,355,031.00	0.49
45	002125	湘潭电化	582,700	6,229,063.00	0.48
46	688018	乐鑫科技	60,342	6,212,208.90	0.48
47	601019	山东出版	655,700	6,150,466.00	0.47
48	000049	德赛电池	226,072	6,131,072.64	0.47
49	002773	康弘药业	327,700	6,042,788.00	0.46
50	300113	顺网科技	415,234	5,813,276.00	0.45
51	600572	康恩贝	1,150,200	5,808,510.00	0.45
52	601369	陕鼓动力	727,800	5,807,844.00	0.45
53	002516	旷达科技	1,167,600	5,756,268.00	0.44
54	002866	传艺科技	270,300	5,735,766.00	0.44
55	301207	华兰疫苗	206,300	5,735,140.00	0.44
56	600586	金晶科技	851,200	5,686,016.00	0.44
57	002960	青鸟消防	403,700	5,587,208.00	0.43
58	600618	氯碱化工	613,400	5,581,940.00	0.43
59	000543	皖能电力	887,000	5,552,620.00	0.43
60	688403	汇成股份	518,745	5,472,759.75	0.42
61	002585	双星新材	671,700	5,447,487.00	0.42
62	603766	隆鑫通用	1,053,400	5,435,544.00	0.42
63	301267	华夏眼科	169,250	5,431,232.50	0.42
64	600172	黄河旋风	1,432,300	5,356,802.00	0.41
65	002212	天融信	546,800	5,347,704.00	0.41
66	600797	浙大网新	796,900	5,227,664.00	0.40
67	688586	江航飞机装备	461,406	5,116,992.54	0.39
68	600691	阳煤化工	1,592,372	5,111,514.12	0.39
69	688575	XD 亚辉龙生物	222,388	5,086,013.56	0.39
70	600577	精达股份	1,215,600	5,032,584.00	0.39
71	002534	西子洁能	402,600	5,028,474.00	0.39
72	300346	南大光电	179,630	4,959,584.30	0.38
73	688389	深圳普门科技	219,907	4,950,106.57	0.38
74	300457	赢合科技	267,100	4,925,324.00	0.38
75	002088	鲁阳节能	345,100	4,917,675.00	0.38
76	000019	深粮控股	650,600	4,905,524.00	0.38
77	600562	国睿科技	350,700	4,853,688.00	0.37
78	300618	寒锐钴业	170,588	4,825,934.52	0.37

79	000682	东方电子	594,600	4,786,530.00	0.37
80	600929	雪天盐业	725,400	4,678,830.00	0.36
81	605338	巴比食品	217,100	4,663,308.00	0.36
82	300263	隆华科技	659,583	4,643,464.32	0.36
83	603093	南华期货	386,000	4,632,000.00	0.36
84	600717	天津港	1,126,000	4,627,860.00	0.36
85	301078	孩子王	563,400	4,625,514.00	0.35
86	688711	江苏宏微科技	108,881	4,517,472.69	0.35
87	600420	国药现代	450,100	4,406,479.00	0.34
88	300109	新开源	244,000	4,401,760.00	0.34
89	300770	新媒股份	112,500	4,351,500.00	0.33
90	688088	虹软科技	105,739	4,339,528.56	0.33
91	300034	钢研高纳	213,100	4,336,585.00	0.33
92	002838	道恩股份	330,291	4,231,027.71	0.32
93	301047	义翘神州	50,990	4,201,576.00	0.32
94	688366	昊海生物科技	38,416	4,160,068.64	0.32
95	002993	奥海科技	108,600	4,137,660.00	0.32
96	000550	江铃汽车	217,200	4,133,316.00	0.32
97	603013	亚普股份	238,400	4,119,552.00	0.32
98	002705	新宝股份	281,300	4,098,541.00	0.31
99	600206	有研新材	328,000	4,063,920.00	0.31
100	688368	晶丰明源半导体	37,275	4,023,463.50	0.31
101	002378	章源钨业	708,660	4,011,015.60	0.31
102	000951	中国重汽	297,000	3,967,920.00	0.30
103	002646	天佑德酒	289,800	3,944,178.00	0.30
104	600810	神马股份	529,300	3,937,992.00	0.30
105	603638	艾迪精密	242,200	3,935,750.00	0.30
106	000088	盐田港	791,807	3,864,018.16	0.30
107	688023	安恒信息	34,376	3,811,954.64	0.29
108	002245	蔚蓝锂芯	444,200	3,784,584.00	0.29
109	002145	中核钛白	842,200	3,773,056.00	0.29
110	603881	数据港	190,100	3,767,782.00	0.29
111	688707	振华新材料	182,823	3,747,871.50	0.29
112	603989	艾华集团	172,700	3,716,504.00	0.29
113	300773	拉卡拉	230,900	3,703,636.00	0.28
114	000030	富奥股份	686,200	3,664,308.00	0.28
115	601126	四方股份	258,500	3,660,360.00	0.28
116	600711	盛屯矿业	834,764	3,622,875.76	0.28
117	601811	新华文轩	264,600	3,614,436.00	0.28
118	600391	航发科技	187,200	3,579,264.00	0.27
119	601068	中铝国际	772,700	3,569,874.00	0.27
120	600063	皖维高新	825,200	3,548,360.00	0.27

121	000928	中钢国际	605,400	3,529,482.00	0.27
122	300236	上海新阳	99,900	3,518,478.00	0.27
123	603010	万盛股份	324,000	3,495,960.00	0.27
124	000875	吉电股份	794,100	3,494,040.00	0.27
125	601326	秦港股份	1,221,600	3,481,560.00	0.27
126	002061	浙江交科	953,534	3,480,399.10	0.27
127	601222	林洋能源	540,900	3,456,351.00	0.27
128	000719	中原传媒	351,200	3,417,176.00	0.26
129	688439	振华风光	37,933	3,380,209.63	0.26
130	002895	川恒股份	177,800	3,378,200.00	0.26
131	001213	中铁特货	802,700	3,371,340.00	0.26
132	600459	贵研铂业	234,300	3,364,548.00	0.26
133	300687	赛意信息	153,300	3,338,874.00	0.26
134	002815	崇达技术	347,000	3,324,260.00	0.26
135	600850	电科数字	152,000	3,306,000.00	0.25
136	600787	中储股份	645,000	3,289,500.00	0.25
137	000672	上峰水泥	406,540	3,276,712.40	0.25
138	600225	卓朗科技	831,483	3,159,635.40	0.24
139	600267	海正药业	336,100	3,145,896.00	0.24
140	600718	东软集团	339,100	3,136,675.00	0.24
141	600955	维远股份	173,800	3,119,710.00	0.24
142	688798	艾为电子	43,444	2,998,939.32	0.23
143	002488	金固股份	416,400	2,989,752.00	0.23
144	002053	云南能投	309,300	2,975,466.00	0.23
145	300451	创业慧康	452,000	2,960,600.00	0.23
146	300039	上海凯宝	440,800	2,931,320.00	0.22
147	002249	大洋电机	572,600	2,845,822.00	0.22
148	002190	成飞集成	149,300	2,832,221.00	0.22
149	002051	中工国际	344,900	2,800,588.00	0.21
150	600710	苏美达	385,900	2,736,031.00	0.21
151	300206	理邦仪器	265,600	2,711,776.00	0.21
152	600997	开滦股份	351,200	2,679,656.00	0.21
153	600507	方大特钢	567,100	2,614,331.00	0.20
154	002351	漫步者	147,100	2,599,257.00	0.20
155	002191	劲嘉股份	482,000	2,588,340.00	0.20
156	002405	四维图新	281,200	2,502,680.00	0.19
157	600662	外服控股	519,300	2,492,640.00	0.19
158	605009	豪悦护理	63,400	2,419,978.00	0.19
159	603678	火炬电子	91,200	2,414,064.00	0.19
160	600835	上海机电	202,300	2,401,301.00	0.18
161	600750	江中药业	114,000	2,380,320.00	0.18
162	603328	依顿电子	288,400	2,350,460.00	0.18
163	002275	桂林三金	161,000	2,332,890.00	0.18

164	002706	良信股份	261,200	2,306,396.00	0.18
165	603008	喜临门	133,200	2,265,732.00	0.17
166	002158	汉钟精机	101,300	2,254,938.00	0.17
167	002649	博彦科技	183,100	2,246,637.00	0.17
168	000795	英洛华	348,800	2,173,024.00	0.17
169	301175	中科环保	429,200	2,141,708.00	0.16
170	002174	游族网络	186,800	2,140,728.00	0.16
171	600869	远东股份	483,400	2,122,126.00	0.16
172	600456	宝钛股份	67,200	2,109,408.00	0.16
173	002265	建设工业	180,200	2,047,072.00	0.16
174	002539	云图控股	246,600	2,034,450.00	0.16
175	600252	中恒集团	806,300	2,023,813.00	0.16
176	600201	生物股份	187,100	2,015,067.00	0.15
177	300696	爱乐达	111,232	1,936,549.12	0.15
178	603915	国茂股份	117,140	1,930,467.20	0.15
179	002911	佛燃能源	167,300	1,917,258.00	0.15
180	300702	天宇股份	87,800	1,906,138.00	0.15
181	300671	富满微	56,500	1,826,645.00	0.14
182	002950	奥美医疗	191,400	1,814,472.00	0.14
183	000685	中山公用	242,000	1,769,020.00	0.14
184	300158	振东制药	260,100	1,755,675.00	0.13
185	600273	嘉化能源	203,100	1,744,629.00	0.13
186	600657	信达地产	475,400	1,706,686.00	0.13
187	603043	广州酒家	86,900	1,697,157.00	0.13
188	000006	深振业 A	368,600	1,691,874.00	0.13
189	300674	宇信科技	103,900	1,691,492.00	0.13
190	688315	诺禾致源科技	72,250	1,686,315.00	0.13
191	002226	江南化工	385,000	1,686,300.00	0.13
192	300393	中来股份	160,300	1,657,502.00	0.13
193	603396	金辰股份	29,500	1,612,175.00	0.12
194	600075	新疆天业	371,795	1,606,154.40	0.12
195	300666	江丰电子	27,300	1,599,234.00	0.12
196	300768	迪普科技	107,700	1,591,806.00	0.12
197	600602	云赛智联	134,700	1,558,479.00	0.12
198	002967	广电计量	102,400	1,537,024.00	0.12
199	000061	农产品	235,960	1,526,661.20	0.12
200	300741	华宝股份	70,951	1,519,060.91	0.12
201	301080	百普赛斯	24,700	1,455,818.00	0.11
202	600098	广州发展	267,500	1,436,475.00	0.11
203	600510	黑牡丹	233,000	1,316,450.00	0.10
204	002961	瑞达期货	85,800	1,278,420.00	0.10
205	002697	红旗连锁	256,400	1,276,872.00	0.10
206	300377	赢时胜	163,900	1,271,864.00	0.10

207	002242	九阳股份	99,900	1,269,729.00	0.10
208	688007	光峰科技	48,985	1,267,731.80	0.10
209	000025	特力A	79,100	1,258,481.00	0.10
210	688238	和元生物	139,848	1,257,233.52	0.10
211	601311	骆驼股份	155,720	1,247,317.20	0.10
212	300497	富祥药业	130,864	1,224,887.04	0.09
213	688568	中科星图公司	24,629	1,208,298.74	0.09
214	601001	晋控煤业	97,200	1,198,476.00	0.09
215	688037	芯源微电子	8,758	1,170,156.38	0.09
216	001338	永顺泰	93,900	1,132,434.00	0.09
217	000058	深赛格	157,100	1,126,407.00	0.09
218	000902	新洋丰	96,400	1,097,996.00	0.08
219	688083	中望软件	10,866	1,081,601.64	0.08
220	000528	柳工	157,600	1,062,224.00	0.08
221	300623	捷捷微电	66,100	1,049,007.00	0.08
222	000737	北方铜业	179,500	1,041,100.00	0.08
223	300894	火星人	63,600	1,032,864.00	0.08
224	002978	安宁股份	31,800	1,006,788.00	0.08
225	600729	重庆百货	35,700	1,006,740.00	0.08
226	001696	宗申动力	151,200	1,002,456.00	0.08
227	300170	汉得信息	118,900	988,059.00	0.08
228	300458	全志科技	43,400	984,746.00	0.08
229	603229	奥翔药业	73,650	972,916.50	0.07
230	601969	海南矿业	145,900	961,481.00	0.07
231	300271	华宇软件	115,500	945,945.00	0.07
232	002498	汉缆股份	235,900	943,600.00	0.07
233	002544	普天科技	44,300	900,176.00	0.07
234	603128	华贸物流	119,400	882,366.00	0.07
235	600012	皖通高速	79,100	871,682.00	0.07
236	301060	兰卫医学	65,300	867,837.00	0.07
237	002216	三全食品	64,520	864,568.00	0.07
238	002015	协鑫能科	66,700	825,746.00	0.06
239	002550	千红制药	138,800	816,144.00	0.06
240	000555	神州信息	72,100	814,009.00	0.06
241	300068	南都电源	62,300	806,162.00	0.06
242	000034	神州数码	26,700	798,597.00	0.06
243	600320	振华重工	238,960	793,347.20	0.06
244	603368	柳药集团	41,300	781,396.00	0.06
245	688173	希荻微电子	44,229	777,988.11	0.06
246	688739	成大生物	23,540	765,285.40	0.06
247	002901	大博医疗	18,800	763,092.00	0.06
248	601609	金田股份	109,700	742,669.00	0.06
249	600475	华光环能	69,869	726,637.60	0.06

250	002461	珠江啤酒	91,200	720,480.00	0.06
251	688556	高测科技股份	18,195	709,423.05	0.05
252	002335	科华数据	25,600	708,608.00	0.05
253	000600	建投能源	140,300	702,903.00	0.05
254	002314	南山控股	236,400	685,560.00	0.05
255	002124	天邦食品	187,100	679,173.00	0.05
256	301087	可孚医疗	17,650	668,935.00	0.05
257	002023	海特高新	72,900	663,390.00	0.05
258	688268	广东华特气体	9,603	647,050.14	0.05
259	601965	中国汽研	29,297	646,291.82	0.05
260	300382	斯莱克	61,700	612,681.00	0.05
261	603556	海兴电力	21,000	609,630.00	0.05
262	000517	荣安地产	247,800	607,110.00	0.05
263	603906	龙蟠科技	48,600	605,556.00	0.05
264	300772	运达股份	56,800	604,352.00	0.05
265	688578	艾力斯医药科技	13,800	574,908.00	0.04
266	300233	金城医药	34,000	566,440.00	0.04
267	603100	川仪股份	19,700	546,084.00	0.04
268	301239	普瑞眼科	6,200	533,200.00	0.04
269	600163	中闽能源	120,800	527,896.00	0.04
270	600216	浙江医药	49,100	526,843.00	0.04
271	688239	贵州航宇科技	11,021	526,473.17	0.04
272	603299	苏盐井神	59,000	502,680.00	0.04
273	688133	泰坦股份	10,712	496,501.20	0.04
274	601678	滨化股份	115,500	486,255.00	0.04
275	600502	安徽建工	104,100	484,065.00	0.04
276	000966	长源电力	107,100	474,453.00	0.04
277	300638	广和通	24,506	466,349.18	0.04
278	601890	亚星锚链	45,800	453,420.00	0.03
279	600446	金证股份	38,800	448,916.00	0.03
280	600556	天下秀	75,800	447,978.00	0.03
281	605507	国邦医药	25,300	444,268.00	0.03
282	600675	中华企业	139,400	439,110.00	0.03
283	688198	佰仁医疗科技	3,453	430,002.09	0.03
284	000791	甘肃能源	75,400	419,978.00	0.03
285	300036	超图软件	20,000	418,000.00	0.03
286	000690	宝新能源	94,200	417,306.00	0.03
287	000789	万年青	59,300	406,798.00	0.03
288	003012	东鹏控股	48,300	398,475.00	0.03
289	600125	铁龙物流	65,200	394,460.00	0.03
290	002859	洁美科技	15,800	394,210.00	0.03
291	002991	甘源食品	5,500	393,030.00	0.03

292	301095	广立微	5,200	388,596.00	0.03
293	300613	富瀚微	9,100	386,204.00	0.03
294	002036	联创电子	36,100	368,581.00	0.03
295	600596	新安股份	39,500	360,240.00	0.03
296	300470	中密控股	9,400	355,320.00	0.03
297	600330	天通股份	40,900	352,967.00	0.03
298	603713	密尔克卫	6,600	351,186.00	0.03
299	601200	上海环境	39,000	350,610.00	0.03
300	300620	光库科技	7,700	348,810.00	0.03
301	600389	江山股份	19,500	339,300.00	0.03
302	300119	瑞普生物	20,700	339,273.00	0.03
303	600751	海航科技	129,100	338,242.00	0.03
304	300035	中科电气	31,500	332,010.00	0.03
305	300726	宏达电子	10,700	323,033.00	0.02
306	603171	税友股份	9,100	321,958.00	0.02
307	603733	仙鹤股份	19,800	319,572.00	0.02
308	688508	芯朋微电子	6,400	314,944.00	0.02
309	301308	江波龙	3,400	312,970.00	0.02
310	000735	罗牛山	50,600	291,962.00	0.02
311	002020	京新药业	22,300	283,656.00	0.02
312	603439	贵州三力	15,000	283,200.00	0.02
313	688559	海目星激光	7,900	282,030.00	0.02
314	600059	古越龙山	30,200	280,860.00	0.02
315	000035	中国天楹	56,000	276,640.00	0.02
316	300133	华策影视	47,100	276,477.00	0.02
317	603919	金徽酒	10,800	265,896.00	0.02
318	600458	时代新材	28,400	261,564.00	0.02
319	002219	新里程	84,900	257,247.00	0.02
320	002139	拓邦股份	26,300	256,688.00	0.02
321	300002	神州泰岳	28,100	248,685.00	0.02
322	688700	东威科技	3,925	239,503.50	0.02
323	002332	仙琚制药	18,600	237,522.00	0.02
324	002985	北摩高科	6,800	235,824.00	0.02
325	000848	承德露露	28,960	227,336.00	0.02
326	002081	金螳螂	59,400	223,344.00	0.02
327	688680	海优新材	3,400	223,210.00	0.02
328	002918	蒙娜丽莎	16,100	217,994.00	0.02
329	300327	中颖电子	9,200	209,760.00	0.02
330	002130	沃尔核材	27,700	209,135.00	0.02
331	000968	蓝焰控股	29,400	209,034.00	0.02
332	002741	光华科技	13,900	206,693.00	0.02
333	002737	葵花药业	7,800	202,644.00	0.02
334	000921	海信家电	9,900	201,960.00	0.02

335	002258	利尔化学	16,800	201,096.00	0.02
336	603567	珍宝岛	16,500	200,640.00	0.02
337	688139	海尔生物	4,656	188,661.12	0.01
338	002677	浙江美大	18,000	181,980.00	0.01
339	600761	安徽合力	9,700	176,637.00	0.01
340	002987	京北方	9,500	176,510.00	0.01
341	688106	金宏气体	7,200	173,448.00	0.01
342	301219	腾远钴业	4,400	173,228.00	0.01
343	600782	新钢股份	48,500	169,265.00	0.01
344	603599	广信股份	11,200	162,400.00	0.01
345	603087	甘李药业	3,000	157,950.00	0.01
346	300624	万兴科技	1,600	151,360.00	0.01
347	603801	志邦家居	8,900	149,253.00	0.01
348	300463	迈克生物	9,600	144,672.00	0.01
349	600770	综艺股份	28,700	140,917.00	0.01
350	002782	可立克	9,700	136,285.00	0.01
351	002079	苏州固锴	11,500	129,720.00	0.01
352	301039	中集车辆	13,828	129,706.64	0.01
353	601163	三角轮胎	9,000	129,690.00	0.01
354	002091	江苏国泰	16,500	129,195.00	0.01
355	300224	正海磁材	11,000	128,920.00	0.01
356	002959	小熊电器	2,300	119,439.00	0.01
357	600550	保变电气	24,300	118,584.00	0.01
358	603920	世运电路	6,300	115,164.00	0.01
359	603169	兰石重装	18,600	114,576.00	0.01
360	002768	国恩股份	5,200	111,384.00	0.01
361	002727	一心堂	4,800	111,168.00	0.01
362	300188	国投智能	6,700	107,334.00	0.01
363	601212	白银有色	37,100	99,799.00	0.01
364	301050	雷电微力	1,700	99,042.00	0.01
365	601137	博威合金	6,100	94,733.00	0.01
366	601677	明泰铝业	8,100	91,854.00	0.01
367	688408	中信博新能源	1,265	90,763.75	0.01
368	301035	润丰股份	1,200	84,000.00	0.01
369	002320	海峡股份	13,900	81,037.00	0.01
370	603533	掌阅科技	4,000	79,520.00	0.01
371	603123	翠微股份	7,200	76,680.00	0.01
372	002261	拓维信息	5,000	75,200.00	0.01
373	002283	天润工业	12,800	74,880.00	0.01
374	600587	新华医疗	2,900	74,791.00	0.01
375	603197	保隆科技	1,300	73,320.00	0.01
376	688800	瑞可达连接系 统	1,785	71,721.30	0.01

377	002060	粤水电	14,600	71,686.00	0.01
378	002085	万丰奥威	14,300	70,642.00	0.01
379	002626	金达威	4,200	68,586.00	0.01
380	600037	歌华有线	8,700	67,251.00	0.01
381	603730	岱美股份	4,600	66,654.00	0.01
382	603306	华懋科技	2,300	62,353.00	0.00
383	603118	共进股份	6,500	58,240.00	0.00
384	600195	中牧股份	4,300	50,998.00	0.00
385	300953	震裕科技	900	49,662.00	0.00
386	601375	中原证券	11,800	45,194.00	0.00
387	688185	康希诺生物	600	44,712.00	0.00
388	688050	爱博诺德医疗	253	43,526.12	0.00
389	002011	盾安环境	3,100	42,625.00	0.00
390	002421	达实智能	11,800	37,996.00	0.00
391	603588	高能环境	5,600	36,624.00	0.00
392	688100	威胜信息	1,156	33,431.52	0.00
393	000681	视觉中国	2,100	30,870.00	0.00
394	600211	西藏药业	600	29,280.00	0.00
395	601882	海天精工	1,100	28,765.00	0.00
396	300455	航天智装	2,200	26,268.00	0.00
397	003006	百亚股份	1,700	25,772.00	0.00
398	002436	兴森科技	1,500	22,095.00	0.00
399	000989	九芝堂	2,100	21,252.00	0.00
400	688131	皓元医药	115	5,986.90	0.00
401	688161	威高骨科	30	1,243.50	0.00
402	603279	景津装备	40	884.40	0.00
403	688209	英集芯科技	44	785.84	0.00
404	688001	苏州华兴源创科技	8	279.60	0.00

### 8.3.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688095	福昕软件开发	98,272	6,864,299.20	0.53
2	300709	精研科技	207,500	6,471,925.00	0.50
3	688468	科美诊断	519,467	5,605,048.93	0.43
4	688292	浩瀚深度信息技术	199,868	5,500,367.36	0.42
5	600310	广西能源	1,389,600	5,197,104.00	0.40
6	688252	天德钰科技	240,439	4,799,162.44	0.37
7	002380	科远智慧	279,300	4,756,479.00	0.36

8	603788	宁波高发	304,400	4,544,692.00	0.35
9	603006	联明股份	343,000	4,431,560.00	0.34
10	600798	宁波海运	1,198,200	4,385,412.00	0.34
11	603933	睿能科技	267,000	4,151,850.00	0.32
12	300102	乾照光电	553,700	4,069,695.00	0.31
13	301339	通行宝	200,500	4,046,090.00	0.31
14	300922	天秦装备	232,800	3,973,896.00	0.30
15	688503	聚和材料股份 公司	67,199	3,601,866.40	0.28
16	688049	炬芯科技	90,875	3,459,611.25	0.27
17	600789	鲁抗医药	478,400	3,415,776.00	0.26
18	600867	通化东宝	300,700	3,256,581.00	0.25
19	600825	新华传媒	715,500	3,198,285.00	0.25
20	603317	天味食品	218,740	2,907,054.60	0.22
21	300558	贝达药业	54,900	2,830,095.00	0.22
22	002152	广电运通	222,100	2,722,946.00	0.21
23	002284	亚太股份	307,200	2,694,144.00	0.21
24	600489	中金黄金	267,300	2,662,308.00	0.20
25	002546	新联电子	518,300	2,591,500.00	0.20
26	600613	神奇制药	340,000	2,587,400.00	0.20
27	600757	长江传媒	337,200	2,512,140.00	0.19
28	600113	浙江东日	300,300	2,468,466.00	0.19
29	002598	山东章鼓	237,100	2,465,840.00	0.19
30	688138	清溢光电	108,054	2,444,181.48	0.19
31	600105	永鼎股份	407,200	2,255,888.00	0.17
32	600498	烽火通信	133,200	2,216,448.00	0.17
33	002916	深南电路	30,500	2,165,195.00	0.17
34	688006	浙江杭可科技	88,677	2,082,135.96	0.16
35	002730	电光科技	219,300	2,078,964.00	0.16
36	002611	东方精工	418,666	2,076,583.36	0.16
37	000850	华茂股份	544,500	2,074,545.00	0.16
38	600479	千金药业	192,400	2,072,148.00	0.16
39	002662	京威股份	580,900	2,038,959.00	0.16
40	002364	中恒电气	256,600	1,975,820.00	0.15
41	688569	铁科轨道	66,105	1,825,159.05	0.14
42	002196	方正电机	236,500	1,698,070.00	0.13
43	002558	巨人网络	148,700	1,656,518.00	0.13
44	002298	中电兴发	284,100	1,636,416.00	0.13
45	603429	集友股份	183,360	1,525,555.20	0.12
46	600351	亚宝药业	216,300	1,492,470.00	0.11
47	603993	洛阳钼业	286,900	1,491,880.00	0.11
48	002232	启明信息	87,800	1,488,210.00	0.11
49	300292	吴通控股	390,900	1,454,148.00	0.11

50	300460	惠伦晶体	116,800	1,431,968.00	0.11
51	600582	天地科技	250,200	1,361,088.00	0.10
52	603689	皖天然气	150,600	1,308,714.00	0.10
53	600096	云天化	83,100	1,296,360.00	0.10
54	002614	奥佳华	172,200	1,291,500.00	0.10
55	300289	利德曼	208,350	1,281,352.50	0.10
56	688306	均普智能制造	222,643	1,240,121.51	0.10
57	600829	人民同泰	152,100	1,189,422.00	0.09
58	601600	中国铝业	210,000	1,184,400.00	0.09
59	300253	卫宁健康	164,500	1,182,755.00	0.09
60	002869	金溢科技	56,900	1,151,656.00	0.09
61	000338	潍柴动力	78,200	1,067,430.00	0.08
62	300724	捷佳伟创	14,100	1,043,541.00	0.08
63	002970	锐明技术	33,300	1,019,313.00	0.08
64	002766	索菱股份	186,200	1,014,790.00	0.08
65	300030	阳普医疗	130,400	1,010,600.00	0.08
66	002228	合兴包装	285,200	978,236.00	0.08
67	300880	迦南智能	48,900	974,088.00	0.07
68	601968	宝钢包装	182,900	938,277.00	0.07
69	002029	七匹狼	162,800	932,844.00	0.07
70	688003	天准科技	24,829	931,584.08	0.07
71	600664	哈药股份	274,538	919,702.30	0.07
72	000060	中金岭南	209,300	904,176.00	0.07
73	688717	艾罗能源	16,147	898,742.02	0.07
74	002479	富春环保	187,700	895,329.00	0.07
75	601139	深圳燃气	127,500	878,475.00	0.07
76	601900	南方传媒	66,000	857,340.00	0.07
77	600939	重庆建工	254,800	835,744.00	0.06
78	688475	萤石网络	18,000	808,200.00	0.06
79	600523	贵航股份	58,200	801,414.00	0.06
80	601878	浙商证券	75,300	785,379.00	0.06
81	600262	北方股份	40,100	771,925.00	0.06
82	002555	三七互娱	40,400	759,924.00	0.06
83	600584	长电科技	25,200	752,472.00	0.06
84	688588	凌志软件	62,151	739,596.90	0.06
85	603861	白云电器	75,300	736,434.00	0.06
86	603166	福达股份	105,700	730,387.00	0.06
87	002644	佛慈制药	73,400	715,650.00	0.05
88	688187	时代电气	19,311	701,568.63	0.05
89	688287	观典防务	67,600	667,212.00	0.05
90	603015	弘讯科技	67,500	658,800.00	0.05
91	000987	越秀资本	102,400	616,448.00	0.05
92	600979	广安爱众	175,300	606,538.00	0.05

93	002224	三力士	116,800	594,512.00	0.05
94	600488	津药药业	120,900	592,410.00	0.05
95	000800	一汽解放	69,400	589,900.00	0.05
96	600050	中国联通	128,700	563,706.00	0.04
97	688619	罗普特科技	39,400	553,964.00	0.04
98	601086	国芳集团	104,000	547,040.00	0.04
99	603331	百达精工	41,300	541,030.00	0.04
100	300861	美畅股份	15,800	525,982.00	0.04
101	600513	联环药业	46,900	522,466.00	0.04
102	300468	四方精创	47,900	519,715.00	0.04
103	000507	珠海港	98,100	516,006.00	0.04
104	000417	合肥百货	102,967	513,805.33	0.04
105	603416	信捷电气	13,600	510,816.00	0.04
106	002116	中国海诚	48,400	498,036.00	0.04
107	300628	亿联网络	16,100	475,755.00	0.04
108	688332	中科蓝讯	6,107	460,589.94	0.04
109	000959	首钢股份	129,300	447,378.00	0.03
110	300550	和仁科技	29,400	440,706.00	0.03
111	300307	慈星股份	68,300	438,486.00	0.03
112	002673	西部证券	68,800	438,256.00	0.03
113	300711	广哈通信	32,400	432,540.00	0.03
114	601368	绿城水务	80,100	428,535.00	0.03
115	000919	金陵药业	53,600	421,832.00	0.03
116	601633	长城汽车	16,500	416,130.00	0.03
117	300219	鸿利智汇	49,300	415,106.00	0.03
118	600551	时代出版	37,900	412,731.00	0.03
119	000729	燕京啤酒	47,781	412,350.03	0.03
120	603018	华设集团	53,400	405,840.00	0.03
121	000715	中兴商业	54,200	396,202.00	0.03
122	002373	千方科技	35,300	395,713.00	0.03
123	002073	软控股份	60,200	395,514.00	0.03
124	002057	中钢天源	48,700	391,548.00	0.03
125	300306	远方信息	31,400	379,312.00	0.03
126	000852	石化机械	61,400	377,610.00	0.03
127	002757	南兴股份	24,000	375,360.00	0.03
128	000598	兴蓉环境	65,900	374,971.00	0.03
129	002083	孚日股份	73,700	371,448.00	0.03
130	688205	德科立光电子	7,204	356,453.92	0.03
131	300046	台基股份	21,700	345,247.00	0.03
132	600062	华润双鹤	18,500	344,100.00	0.03
133	000419	通程控股	59,800	336,076.00	0.03
134	300441	鲍斯股份	47,900	330,031.00	0.03
135	600288	大恒科技	27,500	312,950.00	0.02

136	300383	光环新网	31,900	310,068.00	0.02
137	600141	兴发集团	16,800	306,600.00	0.02
138	002054	德美化工	44,800	304,640.00	0.02
139	002303	美盈森	84,900	297,999.00	0.02
140	603833	欧派家居	4,000	278,440.00	0.02
141	688678	福立旺精密	14,496	266,871.36	0.02
142	600828	茂业商业	72,300	263,895.00	0.02
143	002774	快意电梯	31,700	263,110.00	0.02
144	002609	捷顺科技	22,400	255,808.00	0.02
145	300682	朗新集团	15,600	255,684.00	0.02
146	002129	TCL 中环	16,300	254,932.00	0.02
147	002527	新时达	24,500	240,345.00	0.02
148	600619	海立股份	34,900	237,669.00	0.02
149	002404	嘉欣丝绸	39,200	236,768.00	0.02
150	688310	迈得医疗	7,918	236,748.20	0.02
151	601107	四川成渝	53,000	232,670.00	0.02
152	600362	江西铜业	12,900	230,394.00	0.02
153	600748	上实发展	64,400	224,756.00	0.02
154	601928	凤凰传媒	22,700	199,987.00	0.02
155	000960	锡业股份	13,500	193,320.00	0.01
156	000045	深纺织 A	16,100	189,980.00	0.01
157	002454	松芝股份	24,100	180,991.00	0.01
158	000519	中兵红箭	12,813	179,894.52	0.01
159	600737	中粮糖业	21,400	176,336.00	0.01
160	002563	森马服饰	30,400	175,408.00	0.01
161	688699	明微电子	4,300	173,505.00	0.01
162	002401	中远海科	9,400	170,328.00	0.01
163	002601	龙佰集团	9,800	167,874.00	0.01
164	688599	天合光能	5,700	162,621.00	0.01
165	301130	西点药业	5,700	158,916.00	0.01
166	002117	东港股份	18,300	156,465.00	0.01
167	000948	南天信息	10,200	153,714.00	0.01
168	000100	TCL 科技	35,700	153,510.00	0.01
169	600754	锦江酒店	5,100	152,490.00	0.01
170	002044	美年健康	24,800	149,048.00	0.01
171	002046	国机精工	12,500	144,375.00	0.01
172	000617	中油资本	26,500	143,100.00	0.01
173	688210	泛海统联精密 制造	5,035	131,665.25	0.01
174	300193	佳士科技	15,900	123,543.00	0.01
175	002423	中粮资本	18,300	122,244.00	0.01
176	601857	中国石油	17,200	121,432.00	0.01
177	300376	易事特	18,800	119,756.00	0.01

178	002084	海鸥住工	30,000	119,400.00	0.01
179	002090	金智科技	11,800	117,764.00	0.01
180	002268	电科网安	4,900	110,054.00	0.01
181	603283	赛腾股份	1,500	108,840.00	0.01
182	002522	浙江众成	21,700	104,377.00	0.01
183	002849	威星智能	5,500	102,630.00	0.01
184	002636	金安国纪	11,100	98,901.00	0.01
185	600028	中国石化	17,400	97,092.00	0.01
186	688009	中国通号	21,963	96,197.94	0.01
187	300480	光力科技	4,400	93,940.00	0.01
188	688590	新致软件	3,900	88,218.00	0.01
189	688030	山石网科	4,300	86,086.00	0.01
190	688819	天能电池集团 股份	3,083	86,077.36	0.01
191	601985	中国核电	11,300	84,750.00	0.01
192	603456	九洲药业	3,300	79,893.00	0.01
193	003035	南网能源	15,100	79,426.00	0.01
194	300145	中金环境	24,600	74,292.00	0.01
195	600501	航天晨光	5,000	68,400.00	0.01
196	300228	富瑞特装	9,400	66,740.00	0.01
197	002688	金河生物	13,700	65,897.00	0.01
198	000529	广弘控股	9,500	64,505.00	0.00
199	300172	中电环保	11,800	63,366.00	0.00
200	300016	北陆药业	8,400	59,808.00	0.00
201	002007	华兰生物	2,700	59,751.00	0.00
202	000541	佛山照明	8,800	58,520.00	0.00
203	601007	金陵饭店	5,900	47,672.00	0.00
204	300082	奥克股份	5,800	40,426.00	0.00
205	688579	山大地纬软件	2,664	33,832.80	0.00
206	603112	华翔股份	2,700	32,805.00	0.00
207	002202	金风科技	3,800	30,400.00	0.00
208	002608	江苏国信	4,500	29,565.00	0.00
209	300884	狄耐克	2,100	27,468.00	0.00
210	000544	中原环保	3,800	26,372.00	0.00
211	600637	东方明珠	3,500	26,320.00	0.00
212	688702	盛科通信	539	25,969.02	0.00
213	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
214	600965	福成股份	3,800	23,978.00	0.00
215	688627	精智达技术	222	19,473.84	0.00
216	301525	儒竞科技	215	17,513.90	0.00
217	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
218	601096	宏盛华源铁塔 集团	3,918	15,907.08	0.00

219	301468	博盈特焊	468	14,142.96	0.00
220	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
221	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
222	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
223	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
224	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
225	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
226	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
227	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
228	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
229	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
230	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
231	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
232	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
233	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
234	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
235	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
236	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
237	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
238	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
239	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
240	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
241	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
242	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
243	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
244	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
245	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
246	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
247	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
248	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
249	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
250	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
251	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
252	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
253	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
254	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
255	603193	润本生物技术 股份	303	5,047.98	0.00
256	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
257	603075	热威科技股份	182	4,242.42	0.00
258	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
259	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
260	603373	安邦护卫集团	88	3,058.00	0.00

		股份			
261	688085	三友医疗	130	2,535.00	0.00
262	688010	福光股份	9	216.54	0.00
263	002107	沃华医药	1	6.07	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	300457	赢合科技	61,300,371.78	11.62
2	300158	振东制药	47,615,307.00	9.03
3	601921	浙版传媒	45,242,592.44	8.58
4	000582	北部湾港	44,241,871.56	8.39
5	600531	豫光金铅	43,694,536.90	8.28
6	600267	海正药业	43,304,222.00	8.21
7	601801	皖新传媒	43,207,477.00	8.19
8	600572	康恩贝	43,060,532.00	8.16
9	300319	麦捷科技	42,409,226.84	8.04
10	301039	中集车辆	41,867,926.00	7.94
11	000550	江铃汽车	41,760,722.00	7.92
12	603171	税友股份	41,423,605.00	7.85
13	600872	中炬高新	40,854,802.12	7.74
14	002913	奥士康	40,782,540.00	7.73
15	300476	胜宏科技	40,627,885.00	7.70
16	002204	大连重工	39,964,044.80	7.58
17	600578	京能电力	39,235,819.76	7.44
18	000597	东北制药	38,756,282.75	7.35
19	002701	奥瑞金	38,750,420.00	7.35
20	601019	山东出版	38,520,460.34	7.30
21	002017	东信和平	38,213,474.48	7.24
22	002697	红旗连锁	38,128,468.79	7.23
23	600789	鲁抗医药	37,701,884.96	7.15
24	601126	四方股份	37,458,780.00	7.10
25	002206	海利得	37,348,741.00	7.08
26	601222	林洋能源	36,838,733.41	6.98
27	000030	富奥股份	36,468,576.00	6.91
28	002158	汉钟精机	36,350,854.44	6.89
29	002351	漫步者	36,228,880.45	6.87
30	000061	农产品	36,151,748.00	6.85
31	601137	博威合金	36,048,388.00	6.83
32	601952	苏垦农发	35,766,990.85	6.78

33	000682	东方电子	35,547,807.60	6.74
34	600966	博汇纸业	35,389,004.15	6.71
35	688083	中望软件	35,016,331.89	6.64
36	002635	安洁科技	34,810,226.62	6.60
37	002467	二六三	34,797,249.60	6.60
38	688408	中信博新能源	34,786,367.71	6.59
39	688018	乐鑫科技	34,667,751.20	6.57
40	603396	金辰股份	34,524,782.14	6.54
41	002335	科华数据	34,522,087.10	6.54
42	600577	精达股份	34,269,548.76	6.50
43	002773	康弘药业	34,199,315.00	6.48
44	603236	移远通信	34,102,268.43	6.46
45	688425	铁建重工	33,976,856.96	6.44
46	600502	安徽建工	33,916,370.17	6.43
47	000969	安泰科技	33,837,458.00	6.41
48	002461	珠江啤酒	33,668,849.18	6.38
49	000672	上峰水泥	33,388,742.80	6.33
50	000528	柳工	33,374,010.00	6.33
51	300768	迪普科技	33,227,183.91	6.30
52	300702	天宇股份	33,068,782.40	6.27
53	603299	苏盐井神	32,976,307.96	6.25
54	603328	依顿电子	32,922,209.50	6.24
55	002061	浙江交科	32,917,943.56	6.24
56	600391	航发科技	32,798,410.00	6.22
57	600562	国睿科技	32,731,332.14	6.20
58	002367	康力电梯	32,236,274.49	6.11
59	600776	东方通信	32,035,254.94	6.07
60	002946	新乳业	31,683,005.00	6.01
61	300102	乾照光电	31,655,851.04	6.00
62	300894	火星人	31,528,962.88	5.98
63	603583	捷昌驱动	31,501,605.41	5.97
64	603915	国茂股份	31,313,253.51	5.94
65	002967	广电计量	31,292,682.69	5.93
66	601369	陕鼓动力	31,268,229.00	5.93
67	000555	神州信息	31,082,066.20	5.89
68	600977	中国电影	30,959,704.19	5.87
69	002020	京新药业	30,771,010.72	5.83
70	600850	电科数字	30,599,272.90	5.80
71	300133	华策影视	30,570,893.00	5.80
72	002174	游族网络	30,443,254.00	5.77
73	601311	骆驼股份	30,436,735.20	5.77
74	300671	富满微	30,417,627.29	5.77
75	001696	宗申动力	30,253,463.00	5.74

76	300900	广联航空	30,096,253.01	5.71
77	600320	振华重工	30,090,863.00	5.70
78	300034	钢研高纳	30,063,653.20	5.70
79	000517	荣安地产	30,031,846.00	5.69
80	000811	冰轮环境	29,953,874.83	5.68
81	600761	安徽合力	29,862,967.70	5.66
82	300303	聚飞光电	29,846,590.00	5.66
83	300735	光弘科技	29,841,433.39	5.66
84	600583	海油工程	29,767,315.00	5.64
85	688088	虹软科技	29,683,762.41	5.63
86	688368	晶丰明源半导 体	29,618,004.03	5.61
87	000951	中国重汽	29,492,852.40	5.59
88	300674	宇信科技	29,402,008.00	5.57
89	002274	华昌化工	29,324,505.00	5.56
90	000758	中色股份	29,300,287.00	5.55
91	002534	西子洁能	29,298,992.86	5.55
92	603766	隆鑫通用	29,277,165.00	5.55
93	002435	长江健康	29,053,016.10	5.51
94	300226	上海钢联	29,028,367.89	5.50
95	300206	理邦仪器	28,858,606.90	5.47
96	300130	新国都	28,815,405.12	5.46
97	600812	华北制药	28,794,978.00	5.46
98	603920	世运电路	28,511,192.60	5.40
99	000426	兴业银锡	28,460,611.80	5.40
100	000032	深桑达 A	28,455,405.49	5.39
101	301239	普瑞眼科	28,439,703.19	5.39
102	603027	千禾味业	28,320,654.16	5.37
103	600098	广州发展	28,239,320.00	5.35
104	688173	希荻微电子	28,164,774.43	5.34
105	603881	数据港	28,132,924.32	5.33
106	603983	丸美股份	28,099,063.60	5.33
107	002085	万丰奥威	28,049,294.00	5.32
108	002139	拓邦股份	28,037,004.00	5.32
109	002389	航天彩虹	27,734,346.93	5.26
110	600775	南京熊猫	27,594,798.60	5.23
111	002859	洁美科技	27,517,304.00	5.22
112	002727	一心堂	27,465,019.26	5.21
113	603505	金石资源	27,339,622.84	5.18
114	688128	中国电器研究 院	27,324,250.30	5.18
115	600685	中船防务	27,320,037.00	5.18
116	002990	盛视科技	27,312,043.00	5.18

117	002706	良信股份	27,275,265.00	5.17
118	688023	安恒信息	27,178,793.78	5.15
119	002041	登海种业	27,174,504.00	5.15
120	600797	浙大网新	27,111,811.88	5.14
121	300634	彩讯股份	27,036,567.00	5.13
122	002171	楚江新材	27,010,967.00	5.12
123	600929	雪天盐业	27,008,526.85	5.12
124	300183	东软载波	26,969,500.00	5.11
125	002664	信质集团	26,912,995.48	5.10
126	002125	湘潭电化	26,684,943.22	5.06
127	002378	章源钨业	26,664,623.70	5.05
128	600458	时代新材	26,622,449.82	5.05
129	000650	仁和药业	26,600,862.00	5.04
130	000875	吉电股份	26,548,503.64	5.03
131	002649	博彦科技	26,516,146.73	5.03
132	605123	派克新材	26,499,642.00	5.02
133	601949	中国出版	26,395,423.00	5.00
134	002815	崇达技术	26,361,456.00	5.00
135	688007	光峰科技	26,308,354.75	4.99
136	603989	艾华集团	26,068,369.30	4.94
137	002498	汉缆股份	25,962,874.12	4.92
138	600480	凌云股份	25,925,089.55	4.91
139	600050	中国联通	25,869,519.00	4.90
140	300109	新开源	25,868,689.95	4.90
141	000950	重药控股	25,783,105.16	4.89
142	301087	可孚医疗	25,739,390.94	4.88
143	600456	宝钛股份	25,711,487.00	4.87
144	002145	中核钛白	25,704,608.00	4.87
145	002276	万马股份	25,692,198.00	4.87
146	002636	金安国纪	25,643,320.00	4.86
147	600017	日照港	25,609,330.60	4.85
148	300770	新媒股份	25,574,434.00	4.85
149	002044	美年健康	25,563,980.10	4.85
150	000543	皖能电力	25,537,207.00	4.84
151	688586	江航飞机装备	25,394,118.41	4.81
152	601101	昊华能源	25,356,227.80	4.81
153	002312	川发龙蟒	25,242,818.00	4.79
154	002558	巨人网络	25,232,896.00	4.78
155	002583	海能达	25,186,793.00	4.77
156	603733	仙鹤股份	24,988,542.00	4.74
157	603118	共进股份	24,980,599.90	4.74
158	600197	伊力特	24,959,983.00	4.73
159	600310	广西能源	24,935,624.00	4.73

160	601399	国机重装	24,931,752.60	4.73
161	688711	江苏宏微科技	24,924,690.04	4.73
162	600055	万东医疗	24,866,452.26	4.71
163	002550	千红制药	24,774,593.00	4.70
164	300738	奥飞数据	24,661,071.42	4.68
165	688139	海尔生物	24,644,796.08	4.67
166	002537	海联金汇	24,545,590.00	4.65
167	000657	中钨高新	24,511,505.98	4.65
168	600696	岩石股份	24,429,692.68	4.63
169	002314	南山控股	24,337,495.00	4.61
170	600662	外服控股	24,269,762.72	4.60
171	603919	金徽酒	24,178,105.60	4.58
172	600618	氯碱化工	24,162,844.99	4.58
173	600984	建设机械	24,094,064.95	4.57
174	002746	仙坛股份	24,081,362.36	4.57
175	603229	奥翔药业	24,036,547.30	4.56
176	000028	国药一致	23,973,720.60	4.54
177	000860	顺鑫农业	23,806,955.03	4.51
178	603063	禾望电气	23,806,314.00	4.51
179	688468	科美诊断	23,792,412.79	4.51
180	002283	天润工业	23,767,903.00	4.51
181	002036	联创电子	23,763,341.00	4.50
182	601619	嘉泽新能	23,727,053.00	4.50
183	601908	京运通	23,711,654.00	4.50
184	002130	沃尔核材	23,711,307.89	4.50
185	300232	洲明科技	23,697,533.00	4.49
186	300271	华宇软件	23,680,706.00	4.49
187	300377	赢时胜	23,599,027.85	4.47
188	002405	四维图新	23,592,742.95	4.47
189	000049	德赛电池	23,581,991.52	4.47
190	002390	信邦制药	23,561,981.00	4.47
191	002611	东方精工	23,508,819.97	4.46
192	000690	宝新能源	23,473,956.56	4.45
193	002651	利君股份	23,448,865.00	4.45
194	600825	新华传媒	23,369,637.00	4.43
195	601567	三星医疗	23,303,589.00	4.42
196	600037	歌华有线	23,264,626.73	4.41
197	002641	公元股份	23,216,429.00	4.40
198	600869	远东股份	23,151,746.50	4.39
199	600688	上海石化	23,072,936.00	4.37
200	600657	信达地产	23,004,471.78	4.36
201	000006	深振业 A	23,001,463.00	4.36
202	600206	有研新材	22,984,409.00	4.36

203	002911	佛燃能源	22,962,808.40	4.35
204	605589	圣泉集团	22,805,276.00	4.32
205	603567	珍宝岛	22,801,713.64	4.32
206	688575	XD 亚辉龙生物	22,798,089.40	4.32
207	600201	生物股份	22,604,185.72	4.29
208	002107	沃华医药	22,541,546.00	4.27
209	600335	国机汽车	22,508,971.34	4.27
210	601677	明泰铝业	22,457,442.00	4.26
211	000921	海信家电	22,339,229.87	4.23
212	600990	四创电子	22,288,186.36	4.23
213	600184	光电股份	22,175,224.58	4.20
214	002237	恒邦股份	22,170,675.42	4.20
215	600691	阳煤化工	22,168,805.00	4.20
216	000966	长源电力	22,111,952.57	4.19
217	000928	中钢国际	22,034,367.00	4.18
218	603416	信捷电气	22,022,327.12	4.17
219	300747	锐科激光	22,014,857.82	4.17
220	600717	天津港	21,989,085.08	4.17
221	600151	航天机电	21,983,337.00	4.17
222	002402	和而泰	21,982,716.00	4.17
223	600586	金晶科技	21,962,561.00	4.16
224	300065	海兰信	21,947,543.73	4.16
225	688127	蓝特光学	21,913,366.18	4.15
226	300188	国投智能	21,903,045.44	4.15
227	600063	皖维高新	21,841,347.68	4.14
228	603601	再升科技	21,839,564.89	4.14
229	600642	申能股份	21,838,164.00	4.14
230	002544	普天科技	21,808,429.00	4.13
231	601212	白银有色	21,786,192.00	4.13
232	600216	浙江医药	21,785,318.00	4.13
233	603010	万盛股份	21,657,609.06	4.11
234	300068	南都电源	21,441,827.90	4.06
235	600210	紫江企业	21,425,914.94	4.06
236	300180	华峰超纤	21,421,020.03	4.06
237	002646	天佑德酒	21,413,722.00	4.06
238	300638	广和通	21,410,556.54	4.06
239	603916	苏博特	21,389,857.40	4.05
240	000801	四川九洲	21,276,130.00	4.03
241	600420	国药现代	21,252,267.25	4.03
242	002851	麦格米特	21,242,344.63	4.03
243	300327	中颖电子	21,196,022.19	4.02
244	600075	新疆天业	21,193,222.60	4.02
245	600710	苏美达	21,178,844.00	4.01

246	600810	神马股份	21,121,497.70	4.00
247	301207	华兰疫苗	21,108,849.50	4.00
248	603169	兰石重装	21,073,100.29	3.99
249	300039	上海凯宝	20,965,543.40	3.97
250	603636	南威软件	20,946,841.00	3.97
251	603719	良品铺子	20,923,987.98	3.97
252	601068	中铝国际	20,844,274.00	3.95
253	002481	双塔食品	20,784,288.00	3.94
254	002053	云南能投	20,724,202.47	3.93
255	002516	旷达科技	20,480,717.00	3.88
256	688318	财富趋势	20,433,668.65	3.87
257	688315	诺禾致源科技	20,357,036.15	3.86
258	300114	中航电测	20,185,563.00	3.83
259	600488	津药药业	20,090,862.20	3.81
260	000045	深纺织 A	19,999,328.00	3.79
261	600750	江中药业	19,997,713.98	3.79
262	002463	沪电股份	19,979,480.50	3.79
263	000600	建投能源	19,964,920.00	3.78
264	002011	盾安环境	19,923,062.00	3.78
265	301069	凯盛新材	19,891,078.03	3.77
266	002960	青鸟消防	19,741,836.70	3.74
267	002675	东诚药业	19,680,884.62	3.73
268	300777	中简科技	19,634,756.02	3.72
269	300527	中船应急	19,616,707.84	3.72
270	600587	新华医疗	19,580,147.14	3.71
271	000917	电广传媒	19,494,513.45	3.70
272	600248	陕建股份	19,460,238.00	3.69
273	688578	艾力斯医药科技	19,447,312.53	3.69
274	301078	孩子王	19,428,239.58	3.68
275	300685	艾德生物	19,368,290.96	3.67
276	600446	金证股份	19,356,774.00	3.67
277	603279	景津装备	19,285,186.40	3.66
278	002978	安宁股份	19,225,816.00	3.64
279	002421	达实智能	18,935,864.00	3.59
280	002695	煌上煌	18,803,355.00	3.56
281	688403	汇成股份	18,778,175.55	3.56
282	002585	双星新材	18,756,599.00	3.56
283	002545	东方铁塔	18,755,294.04	3.56
284	603533	掌阅科技	18,754,694.00	3.56
285	002768	国恩股份	18,727,319.64	3.55
286	002284	亚太股份	18,642,413.00	3.53
287	600073	上海梅林	18,620,363.00	3.53

288	600285	羚锐制药	18,585,368.95	3.52
289	300696	爱乐达	18,567,900.68	3.52
290	000810	创维数字	18,559,345.00	3.52
291	603530	神马电力	18,454,526.07	3.50
292	300294	博雅生物	18,330,336.24	3.47
293	002215	诺普信	18,322,562.77	3.47
294	601606	长城军工	18,299,745.00	3.47
295	688526	武汉科前生物	18,280,122.04	3.47
296	600172	黄河旋风	18,241,915.00	3.46
297	600610	中毅达	18,217,402.67	3.45
298	600711	盛屯矿业	18,165,145.60	3.44
299	688366	昊海生物科技	18,121,726.19	3.44
300	300709	精研科技	18,056,634.01	3.42
301	603100	川仪股份	18,006,330.70	3.41
302	002747	埃斯顿	17,962,531.32	3.41
303	002190	成飞集成	17,922,974.00	3.40
304	002004	华邦健康	17,884,604.00	3.39
305	002226	江南化工	17,865,170.40	3.39
306	002737	葵花药业	17,857,412.00	3.39
307	301339	通行宝	17,829,695.60	3.38
308	603043	广州酒家	17,793,668.60	3.37
309	300036	超图软件	17,788,232.16	3.37
310	300502	新易盛	17,772,777.08	3.37
311	688798	艾为电子	17,760,400.59	3.37
312	300451	创业慧康	17,692,280.93	3.35
313	000795	英洛华	17,622,301.00	3.34
314	600754	锦江酒店	17,608,648.00	3.34
315	000019	深粮控股	17,603,566.00	3.34
316	000989	九芝堂	17,596,652.00	3.34
317	300315	掌趣科技	17,543,022.00	3.33
318	600623	华谊集团	17,448,433.00	3.31
319	600667	太极实业	17,302,839.99	3.28
320	600312	平高电气	17,243,458.00	3.27
321	000058	深赛格	17,177,182.99	3.26
322	002043	兔宝宝	17,104,842.00	3.24
323	605009	豪悦护理	17,101,502.33	3.24
324	603520	司太立	17,074,022.40	3.24
325	002446	盛路通信	17,072,008.00	3.24
326	000727	冠捷科技	17,067,274.00	3.24
327	000997	新大陆	17,028,371.00	3.23
328	300101	振芯科技	16,976,990.00	3.22
329	301015	百洋医药	16,976,716.53	3.22
330	601208	东材科技	16,967,947.00	3.22

331	600635	大众公用	16,933,608.17	3.21
332	600363	联创光电	16,923,484.00	3.21
333	301047	义翘神州	16,888,634.00	3.20
334	688223	晶科能源	16,847,637.95	3.19
335	301165	锐捷网络	16,757,677.62	3.18
336	688095	福昕软件开发	16,670,741.58	3.16
337	600835	上海机电	16,644,416.00	3.16
338	002600	领益智造	16,643,943.00	3.16
339	000729	燕京啤酒	16,625,352.00	3.15
340	000725	京东方 A	16,600,716.00	3.15
341	603368	柳药集团	16,567,338.00	3.14
342	300653	正海生物	16,546,914.00	3.14
343	000685	中山公用	16,402,798.84	3.11
344	605111	新洁能	16,377,297.61	3.10
345	603218	日月股份	16,361,938.00	3.10
346	600409	三友化工	16,342,197.00	3.10
347	601918	新集能源	16,338,116.02	3.10
348	300233	金城医药	16,334,700.65	3.10
349	600594	益佰制药	16,329,723.00	3.10
350	603718	海利生物	16,322,006.00	3.09
351	002838	道恩股份	16,313,954.02	3.09
352	603933	睿能科技	16,272,717.00	3.08
353	002126	银轮股份	16,253,279.94	3.08
354	600477	杭萧钢构	16,180,438.10	3.07
355	002987	京北方	16,177,457.40	3.07
356	000767	晋控电力	16,169,261.02	3.07
357	002239	奥特佳	16,128,246.00	3.06
358	603439	贵州三力	16,118,085.00	3.06
359	300803	指南针	16,111,918.86	3.05
360	600997	开滦股份	16,074,981.60	3.05
361	601600	中国铝业	16,055,319.00	3.04
362	300263	隆华科技	16,051,531.24	3.04
363	601999	出版传媒	16,022,221.80	3.04
364	003012	东鹏控股	15,996,764.00	3.03
365	603993	洛阳钼业	15,932,979.00	3.02
366	600284	浦东建设	15,913,159.30	3.02
367	600225	卓朗科技	15,901,272.00	3.01
368	300616	尚品宅配	15,839,881.94	3.00
369	002060	粤水电	15,819,423.26	3.00
370	601965	中国汽研	15,758,974.00	2.99
371	603906	龙蟠科技	15,599,749.00	2.96
372	600059	古越龙山	15,528,384.00	2.94
373	603566	普莱柯	15,452,447.70	2.93

374	300406	九强生物	15,420,747.03	2.92
375	002344	海宁皮城	15,402,863.24	2.92
376	600645	中源协和	15,375,387.00	2.91
377	002612	朗姿股份	15,347,627.47	2.91
378	002063	远光软件	15,335,955.20	2.91
379	603306	华懋科技	15,288,843.00	2.90
380	002233	塔牌集团	15,251,022.00	2.89
381	600062	华润双鹤	15,249,178.00	2.89
382	000612	焦作万方	15,220,122.00	2.89
383	603338	浙江鼎力	15,176,079.00	2.88
384	002895	川恒股份	15,110,278.00	2.86
385	300602	飞荣达	15,097,797.00	2.86
386	600675	中华企业	15,058,359.56	2.85
387	600273	嘉化能源	15,048,382.00	2.85
388	001213	中铁特货	15,037,118.00	2.85
389	600596	新安股份	15,021,462.40	2.85
390	603093	南华期货	15,010,778.00	2.85
391	300693	盛弘股份	14,970,638.76	2.84
392	603013	亚普股份	14,921,983.00	2.83
393	002091	江苏国泰	14,873,150.00	2.82
394	002567	唐人神	14,810,285.62	2.81
395	300134	大富科技	14,775,942.00	2.80
396	603466	风语筑	14,711,029.70	2.79
397	000011	深物业 A	14,684,804.00	2.78
398	603060	国检集团	14,669,281.95	2.78
399	002454	松芝股份	14,645,924.07	2.78
400	300031	宝通科技	14,605,035.47	2.77
401	600498	烽火通信	14,594,217.13	2.77
402	600129	太极集团	14,585,805.00	2.77
403	002518	科士达	14,573,659.49	2.76
404	000034	神州数码	14,520,978.37	2.75
405	688676	海南金盘智能 科技	14,513,953.96	2.75
406	601890	亚星锚链	14,479,465.00	2.74
407	600682	南京新百	14,462,496.00	2.74
408	002644	佛慈制药	14,438,810.00	2.74
409	601519	大智慧	14,430,243.00	2.74
410	600664	哈药股份	14,424,730.32	2.73
411	002317	众生药业	14,409,178.00	2.73
412	002242	九阳股份	14,388,624.00	2.73
413	601163	三角轮胎	14,361,322.00	2.72
414	300726	宏达电子	14,356,470.00	2.72
415	688148	芳源股份	14,316,524.28	2.71

416	002916	深南电路	14,315,982.82	2.71
417	300767	震安科技	14,301,915.78	2.71
418	300394	天孚通信	14,274,339.00	2.71
419	301050	雷电微力	14,245,186.97	2.70
420	002245	蔚蓝锂芯	14,223,247.00	2.70
421	002891	中宠股份	14,221,636.29	2.70
422	600602	云赛智联	14,212,520.00	2.69
423	601882	海天精工	14,206,714.28	2.69
424	603088	宁波精达	14,199,993.00	2.69
425	300119	瑞普生物	14,175,384.46	2.69
426	002677	浙江美大	14,161,412.00	2.68
427	300348	长亮科技	14,155,394.00	2.68
428	601728	中国电信	14,130,737.00	2.68
429	605507	国邦医药	14,079,197.24	2.67
430	002617	露笑科技	14,061,361.00	2.67
431	600595	中孚实业	14,017,360.48	2.66
432	300973	立高食品	14,001,501.00	2.65
433	688238	和元生物	13,990,114.79	2.65
434	601001	晋控煤业	13,984,668.00	2.65
435	000422	湖北宜化	13,942,898.00	2.64
436	300679	电连技术	13,925,708.19	2.64
437	000902	新洋丰	13,923,530.00	2.64
438	603103	横店影视	13,920,433.45	2.64
439	600266	城建发展	13,919,594.00	2.64
440	603305	旭升集团	13,916,562.64	2.64
441	603008	喜临门	13,915,524.00	2.64
442	600386	北巴传媒	13,904,993.32	2.64
443	688590	新致软件	13,899,287.83	2.63
444	300236	上海新阳	13,893,755.90	2.63
445	301155	海力风电	13,889,745.00	2.63
446	002993	奥海科技	13,882,617.00	2.63
447	002332	仙琚制药	13,882,473.00	2.63
448	002254	泰和新材	13,871,376.00	2.63
449	000919	金陵药业	13,789,599.00	2.61
450	600116	三峡水利	13,758,567.00	2.61
451	002724	海洋王	13,755,669.32	2.61
452	300346	南大光电	13,736,781.30	2.60
453	000737	北方铜业	13,730,838.00	2.60
454	002810	山东赫达	13,715,385.40	2.60
455	688559	海目星激光	13,694,226.74	2.60
456	000060	中金岭南	13,664,167.00	2.59
457	688252	天德钰科技	13,658,166.18	2.59
458	002287	奇正藏药	13,609,953.73	2.58

459	600729	重庆百货	13,607,792.00	2.58
460	002488	金固股份	13,600,203.00	2.58
461	002234	民和股份	13,571,808.00	2.57
462	002243	力合科创	13,568,041.00	2.57
463	002097	山河智能	13,555,064.95	2.57
464	002484	江海股份	13,544,696.00	2.57
465	002038	双鹭药业	13,544,377.08	2.57
466	603228	景旺电子	13,484,324.00	2.56
467	000688	国城矿业	13,448,411.00	2.55
468	300219	鸿利智汇	13,441,893.76	2.55
469	002866	传艺科技	13,440,102.00	2.55
470	600031	三一重工	13,353,903.00	2.53
471	600105	永鼎股份	13,341,104.00	2.53
472	600277	亿利洁能	13,324,066.00	2.53
473	688209	英集芯科技	13,312,179.63	2.52
474	601928	凤凰传媒	13,302,866.00	2.52
475	688187	时代电气	13,290,047.12	2.52
476	600469	风神股份	13,267,977.00	2.52
477	605338	巴比食品	13,221,119.00	2.51
478	600874	创业环保	13,207,282.16	2.50
479	000718	苏宁环球	13,205,021.00	2.50
480	301071	力量钻石	13,156,191.29	2.49
481	300026	红日药业	13,154,425.78	2.49
482	002051	中工国际	13,143,099.00	2.49
483	000901	航天科技	13,110,477.00	2.49
484	002662	京威股份	13,066,009.00	2.48
485	000960	锡业股份	13,017,472.00	2.47
486	002645	华宏科技	13,013,761.00	2.47
487	688206	概伦电子	13,000,038.82	2.46
488	002324	普利特	12,975,658.00	2.46
489	603123	翠微股份	12,962,708.09	2.46
490	600489	中金黄金	12,941,968.64	2.45
491	002267	陕天然气	12,928,674.00	2.45
492	300382	斯莱克	12,928,162.00	2.45
493	600718	东软集团	12,926,869.00	2.45
494	002380	科远智慧	12,913,786.52	2.45
495	600986	浙文互联	12,910,287.60	2.45
496	002124	天邦食品	12,885,509.00	2.44
497	600229	城市传媒	12,854,216.00	2.44
498	300229	拓尔思	12,853,947.06	2.44
499	600888	新疆众和	12,821,402.93	2.43
500	002782	可立克	12,806,350.00	2.43
501	002950	奥美医疗	12,797,589.50	2.43

502	003040	楚天龙	12,744,915.24	2.42
503	603730	岱美股份	12,740,881.40	2.42
504	000885	城发环境	12,701,346.80	2.41
505	688389	深圳普门科技	12,698,223.16	2.41
506	002100	天康生物	12,660,408.24	2.40
507	002938	鹏鼎控股	12,631,382.89	2.39
508	002573	清新环境	12,626,019.00	2.39
509	300755	华致酒行	12,608,564.00	2.39
510	000852	石化机械	12,607,152.60	2.39
511	002106	莱宝高科	12,592,715.84	2.39
512	688680	海优新材	12,584,459.78	2.39
513	300458	全志科技	12,583,807.00	2.39
514	688800	瑞可达连接系统	12,567,281.03	2.38
515	301267	华夏眼科	12,539,473.30	2.38
516	605168	三人行	12,531,246.33	2.38
517	000551	创元科技	12,457,299.00	2.36
518	300383	光环新网	12,420,566.00	2.35
519	300455	航天智装	12,381,268.00	2.35
520	600114	东睦股份	12,364,608.37	2.34
521	600829	人民同泰	12,328,873.00	2.34
522	002191	劲嘉股份	12,316,878.00	2.33
523	600211	西藏药业	12,310,884.00	2.33
524	600120	浙江东方	12,171,025.38	2.31
525	600746	江苏索普	12,165,022.00	2.31
526	600613	神奇制药	12,161,849.00	2.31
527	688331	荣昌生物	12,161,473.50	2.31
528	603005	晶方科技	12,108,047.00	2.30
529	002201	正威新材	12,088,139.79	2.29
530	600490	鹏欣资源	12,085,108.00	2.29
531	300298	三诺生物	12,079,611.00	2.29
532	002434	万里扬	12,015,018.00	2.28
533	000823	超声电子	12,003,303.80	2.28
534	603208	江山欧派	12,000,443.40	2.27
535	002449	国星光电	11,985,803.77	2.27
536	300398	飞凯材料	11,973,522.00	2.27
537	600422	昆药集团	11,926,604.72	2.26
538	600742	一汽富维	11,864,663.77	2.25
539	002472	双环传动	11,861,098.00	2.25
540	601007	金陵饭店	11,849,815.00	2.25
541	300267	尔康制药	11,843,674.00	2.25
542	002275	桂林三金	11,729,154.00	2.22
543	600163	中闽能源	11,710,748.00	2.22

544	688049	炬芯科技	11,702,210.67	2.22
545	600373	中文传媒	11,687,649.36	2.22
546	601319	中国人保	11,615,750.00	2.20
547	600027	华电国际	11,592,743.00	2.20
548	600328	中盐化工	11,576,526.60	2.19
549	603877	太平鸟	11,547,939.21	2.19
550	688508	芯朋微电子	11,519,395.04	2.18
551	688106	金宏气体	11,489,905.21	2.18
552	002901	大博医疗	11,466,904.00	2.17
553	300910	瑞丰新材	11,449,337.00	2.17
554	002436	兴森科技	11,443,128.00	2.17
555	300723	一品红	11,413,103.31	2.16
556	300276	三丰智能	11,402,900.00	2.16
557	600308	华泰股份	11,367,721.06	2.16
558	600558	大西洋	11,342,456.57	2.15
559	002626	金达威	11,340,224.00	2.15
560	002745	木林森	11,282,898.00	2.14
561	002048	宁波华翔	11,262,133.00	2.13
562	603301	振德医疗	11,227,254.99	2.13
563	600483	福能股份	11,205,107.00	2.12
564	688608	恒玄科技	11,201,057.61	2.12
565	688707	振华新材料	11,133,832.57	2.11
566	600770	综艺股份	11,121,144.20	2.11
567	002929	润建股份	11,112,977.71	2.11
568	002531	天顺风能	11,089,109.00	2.10
569	603985	恒润股份	11,074,429.02	2.10
570	002422	科伦药业	11,068,621.00	2.10
571	000601	韶能股份	11,065,439.75	2.10
572	603693	江苏新能	11,061,025.70	2.10
573	002135	东南网架	11,053,373.00	2.10
574	300443	金雷股份	11,007,162.06	2.09
575	002006	精工科技	10,934,837.98	2.07
576	603387	基蛋生物	10,919,723.15	2.07
577	300228	富瑞特装	10,912,666.51	2.07
578	300393	中来股份	10,882,797.00	2.06
579	002906	华阳集团	10,879,262.00	2.06
580	002605	姚记科技	10,875,682.69	2.06
581	600933	爱柯迪	10,860,600.00	2.06
582	301175	中科环保	10,825,097.00	2.05
583	002212	天融信	10,814,168.00	2.05
584	601326	秦港股份	10,813,008.89	2.05
585	002396	星网锐捷	10,791,537.00	2.05
586	002354	天娱数科	10,784,589.00	2.04

587	300376	易事特	10,779,355.00	2.04
588	601800	中国交建	10,759,007.16	2.04
589	000862	银星能源	10,741,231.00	2.04
590	600400	红豆股份	10,737,581.00	2.04
591	600876	凯盛新能	10,725,223.84	2.03
592	688700	东威科技	10,718,696.47	2.03
593	002218	拓日新能	10,699,976.50	2.03
594	600459	贵研铂业	10,692,601.43	2.03
595	688287	观典防务	10,666,178.69	2.02
596	003032	传智教育	10,651,099.00	2.02
597	000423	东阿阿胶	10,631,155.00	2.02
598	300463	迈克生物	10,628,199.00	2.01
599	002419	天虹股份	10,623,806.00	2.01
600	603429	集友股份	10,623,730.20	2.01
601	002517	恺英网络	10,605,113.04	2.01
602	603678	火炬电子	10,592,253.00	2.01
603	600787	中储股份	10,575,696.00	2.00
604	300433	蓝思科技	10,573,723.00	2.00
605	300497	富祥药业	10,568,944.96	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。

#### 8.4.2 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	300457	赢合科技	56,692,162.89	10.75
2	300158	振东制药	47,110,323.43	8.93
3	301039	中集车辆	43,870,015.12	8.32
4	000550	江铃汽车	39,764,802.00	7.54
5	601921	浙版传媒	39,688,908.86	7.52
6	600267	海正药业	39,319,977.35	7.45
7	002697	红旗连锁	39,107,347.00	7.41
8	002017	东信和平	38,988,750.50	7.39
9	603171	税友股份	38,390,873.00	7.28
10	601137	博威合金	38,241,657.10	7.25
11	300319	麦捷科技	36,648,969.84	6.95
12	600531	豫光金铅	36,336,558.92	6.89
13	600572	康恩贝	36,326,734.54	6.89
14	688408	中信博新能源	35,531,737.05	6.74
15	002635	安洁科技	35,497,646.73	6.73
16	600789	鲁抗医药	35,441,773.38	6.72
17	000061	农产品	34,985,667.90	6.63

18	002351	漫步者	34,546,641.81	6.55
19	300476	胜宏科技	34,507,239.38	6.54
20	601126	四方股份	34,459,239.54	6.53
21	603328	依顿电子	34,184,616.67	6.48
22	000582	北部湾港	34,116,811.20	6.47
23	603299	苏盐井神	34,042,654.04	6.45
24	000030	富奥股份	34,019,418.00	6.45
25	002158	汉钟精机	33,947,800.66	6.44
26	603236	移远通信	33,896,201.44	6.43
27	688425	铁建重工	33,851,449.06	6.42
28	600872	中炬高新	33,737,653.84	6.40
29	000682	东方电子	33,663,384.00	6.38
30	601801	皖新传媒	33,477,380.27	6.35
31	603396	金辰股份	33,457,900.53	6.34
32	601222	林洋能源	33,407,005.65	6.33
33	002461	珠江啤酒	33,363,515.02	6.32
34	002335	科华数据	33,022,815.49	6.26
35	600502	安徽建工	32,762,845.91	6.21
36	688083	中望软件	32,710,625.39	6.20
37	601019	山东出版	32,624,839.54	6.18
38	002020	京新药业	32,295,467.40	6.12
39	002206	海利得	32,111,041.00	6.09
40	002367	康力电梯	31,899,366.75	6.05
41	300735	光弘科技	31,875,239.64	6.04
42	000811	冰轮环境	31,788,552.64	6.03
43	300130	新国都	31,525,804.78	5.98
44	000758	中色股份	31,360,357.56	5.95
45	000528	柳工	31,337,797.55	5.94
46	002701	奥瑞金	31,310,427.00	5.94
47	603920	世运电路	31,160,551.90	5.91
48	000555	神州信息	31,123,483.68	5.90
49	600977	中国电影	31,123,215.65	5.90
50	002967	广电计量	31,051,645.74	5.89
51	600391	航发科技	31,006,326.00	5.88
52	300133	华策影视	30,885,228.80	5.86
53	300768	迪普科技	30,881,814.18	5.85
54	000597	东北制药	30,679,497.17	5.82
55	600761	安徽合力	30,505,040.00	5.78
56	600685	中船防务	30,259,144.28	5.74
57	600583	海油工程	30,246,051.00	5.73
58	300702	天宇股份	30,190,826.84	5.72
59	002204	大连重工	30,173,334.76	5.72
60	000517	荣安地产	30,066,687.52	5.70

61	600578	京能电力	30,025,599.36	5.69
62	300900	广联航空	29,948,196.60	5.68
63	002664	信质集团	29,768,350.92	5.64
64	600577	精达股份	29,766,943.62	5.64
65	002139	拓邦股份	29,691,130.00	5.63
66	601952	苏垦农发	29,663,551.60	5.62
67	002174	游族网络	29,659,999.00	5.62
68	300226	上海钢联	29,618,839.12	5.61
69	001696	宗申动力	29,581,484.57	5.61
70	002773	康弘药业	29,556,634.00	5.60
71	002085	万丰奥威	29,539,505.00	5.60
72	601311	骆驼股份	29,504,953.10	5.59
73	002061	浙江交科	29,421,078.50	5.58
74	000672	上峰水泥	29,367,196.00	5.57
75	002913	奥士康	29,333,839.00	5.56
76	600320	振华重工	29,216,614.60	5.54
77	300894	火星人	29,216,120.33	5.54
78	603915	国茂股份	29,037,551.54	5.50
79	000426	兴业银锡	28,539,505.28	5.41
80	000032	深桑达 A	28,512,497.30	5.41
81	301239	普瑞眼科	28,478,274.86	5.40
82	688018	乐鑫科技	28,444,762.55	5.39
83	603027	千禾味业	28,397,888.20	5.38
84	002435	长江健康	28,362,907.54	5.38
85	603505	金石资源	28,308,953.00	5.37
86	600458	时代新材	28,250,391.32	5.36
87	600850	电科数字	28,156,336.87	5.34
88	300183	东软载波	27,788,070.00	5.27
89	002727	一心堂	27,757,569.25	5.26
90	002990	盛视科技	27,719,348.00	5.25
91	300674	宇信科技	27,685,900.53	5.25
92	300102	乾照光电	27,576,870.00	5.23
93	000969	安泰科技	27,539,867.00	5.22
94	603983	丸美股份	27,443,249.20	5.20
95	600017	日照港	27,430,094.90	5.20
96	600562	国睿科技	27,325,172.56	5.18
97	688007	光峰科技	27,224,241.70	5.16
98	600098	广州发展	27,077,355.50	5.13
99	002859	洁美科技	27,045,152.00	5.13
100	000950	重药控股	27,037,399.97	5.13
101	300671	富满微	26,991,537.43	5.12
102	002171	楚江新材	26,977,262.00	5.11
103	002044	美年健康	26,872,723.85	5.09

104	002746	仙坛股份	26,793,110.28	5.08
105	600775	南京熊猫	26,759,928.34	5.07
106	002389	航天彩虹	26,554,001.47	5.03
107	603118	共进股份	26,501,460.70	5.02
108	601567	三星医疗	26,415,388.00	5.01
109	605123	派克新材	26,337,121.75	4.99
110	600966	博汇纸业	26,296,790.16	4.99
111	002312	川发龙蟒	26,220,881.00	4.97
112	002649	博彦科技	26,189,501.57	4.96
113	000860	顺鑫农业	26,185,676.49	4.96
114	002467	二六三	26,161,887.70	4.96
115	002036	联创电子	26,092,009.02	4.95
116	300206	理邦仪器	25,924,809.84	4.91
117	688368	晶丰明源半导 体	25,812,275.59	4.89
118	600480	凌云股份	25,715,271.71	4.87
119	002946	新乳业	25,709,398.00	4.87
120	002636	金安国纪	25,596,760.50	4.85
121	000657	中钨高新	25,520,369.14	4.84
122	688088	虹软科技	25,474,467.43	4.83
123	002583	海能达	25,469,727.59	4.83
124	300034	钢研高纳	25,456,320.93	4.83
125	300738	奥飞数据	25,319,794.78	4.80
126	002498	汉缆股份	25,075,920.25	4.75
127	600055	万东医疗	25,059,767.00	4.75
128	601101	昊华能源	25,022,474.08	4.74
129	688173	希荻微电子	24,978,822.79	4.74
130	600050	中国联通	24,896,570.90	4.72
131	301087	可孚医疗	24,745,413.80	4.69
132	600929	雪天盐业	24,708,699.85	4.68
133	688139	海尔生物	24,612,935.35	4.67
134	002550	千红制药	24,595,684.00	4.66
135	002534	西子洁能	24,576,598.64	4.66
136	300377	赢时胜	24,576,098.45	4.66
137	002463	沪电股份	24,551,679.50	4.65
138	300232	洲明科技	24,515,500.44	4.65
139	600797	浙大网新	24,478,797.32	4.64
140	601369	陕鼓动力	24,421,349.00	4.63
141	002706	良信股份	24,385,996.40	4.62
142	600210	紫江企业	24,368,996.32	4.62
143	600037	歌华有线	24,315,868.00	4.61
144	603919	金徽酒	24,281,881.00	4.60
145	000951	中国重汽	24,225,358.00	4.59

146	600776	东方通信	24,224,713.41	4.59
147	600984	建设机械	24,059,624.10	4.56
148	600456	宝钛股份	24,047,013.20	4.56
149	603733	仙鹤股份	24,004,891.40	4.55
150	603881	数据港	23,960,758.60	4.54
151	000543	皖能电力	23,942,486.00	4.54
152	002283	天润工业	23,773,471.00	4.51
153	002558	巨人网络	23,679,317.14	4.49
154	600197	伊力特	23,672,602.00	4.49
155	000028	国药一致	23,664,334.88	4.49
156	002641	公元股份	23,620,335.03	4.48
157	605589	圣泉集团	23,564,523.30	4.47
158	002651	利君股份	23,503,583.00	4.46
159	002130	沃尔核材	23,474,910.46	4.45
160	601619	嘉泽新能	23,470,023.00	4.45
161	603766	隆鑫通用	23,390,562.50	4.43
162	000921	海信家电	23,047,456.96	4.37
163	603063	禾望电气	23,033,003.05	4.37
164	603229	奥翔药业	22,636,274.68	4.29
165	688023	安恒信息	22,604,154.13	4.29
166	688128	中国电器研究院	22,597,720.68	4.28
167	600184	光电股份	22,578,890.93	4.28
168	002314	南山控股	22,569,097.81	4.28
169	603416	信捷电气	22,560,853.25	4.28
170	002107	沃华医药	22,499,375.24	4.27
171	002237	恒邦股份	22,496,286.00	4.26
172	000875	吉电股份	22,476,239.39	4.26
173	600335	国机汽车	22,426,574.84	4.25
174	600657	信达地产	22,386,638.96	4.24
175	603567	珍宝岛	22,313,096.24	4.23
176	600688	上海石化	22,294,288.78	4.23
177	603989	艾华集团	22,289,454.80	4.23
178	300303	聚飞光电	22,268,326.00	4.22
179	300188	国投智能	22,241,701.75	4.22
180	002815	崇达技术	22,234,351.00	4.22
181	300770	新媒股份	22,190,764.00	4.21
182	300114	中航电测	22,160,445.48	4.20
183	002378	章源钨业	22,068,824.10	4.18
184	600151	航天机电	22,043,722.00	4.18
185	600990	四创电子	22,009,683.72	4.17
186	688127	蓝特光学	21,972,561.07	4.17
187	002675	东诚药业	21,928,644.73	4.16

188	002402	和而泰	21,911,808.00	4.15
189	688318	财富趋势	21,866,354.32	4.15
190	603583	捷昌驱动	21,825,490.15	4.14
191	300747	锐科激光	21,810,337.37	4.13
192	002145	中核钛白	21,794,084.98	4.13
193	600642	申能股份	21,766,345.06	4.13
194	601677	明泰铝业	21,761,582.00	4.13
195	000006	深振业 A	21,742,732.58	4.12
196	000966	长源电力	21,728,242.43	4.12
197	000690	宝新能源	21,718,404.36	4.12
198	300271	华宇软件	21,692,024.25	4.11
199	600662	外服控股	21,643,225.12	4.10
200	300109	新开源	21,640,035.00	4.10
201	300065	海兰信	21,605,365.00	4.10
202	603601	再升科技	21,568,084.40	4.09
203	603636	南威软件	21,482,483.15	4.07
204	600201	生物股份	21,387,872.52	4.05
205	300180	华峰超纤	21,347,416.05	4.05
206	002544	普天科技	21,332,465.10	4.04
207	300634	彩讯股份	21,241,736.00	4.03
208	688468	科美诊断	21,185,795.42	4.02
209	300777	中简科技	21,182,408.00	4.02
210	002851	麦格米特	21,167,910.24	4.01
211	300638	广和通	21,154,654.72	4.01
212	600216	浙江医药	21,148,547.00	4.01
213	601212	白银有色	21,144,228.00	4.01
214	000801	四川九洲	21,134,201.72	4.01
215	688315	诺禾致源科技	21,105,147.33	4.00
216	688586	江航飞机装备	21,038,491.84	3.99
217	300502	新易盛	20,957,422.50	3.97
218	002911	佛燃能源	20,955,923.60	3.97
219	603169	兰石重装	20,924,589.42	3.97
220	603719	良品铺子	20,900,697.00	3.96
221	002481	双塔食品	20,848,848.92	3.95
222	002421	达实智能	20,801,048.07	3.94
223	002011	盾安环境	20,675,047.42	3.92
224	002611	东方精工	20,674,494.18	3.92
225	002125	湘潭电化	20,639,005.69	3.91
226	600073	上海梅林	20,638,651.28	3.91
227	300527	中船应急	20,619,297.85	3.91
228	600310	广西能源	20,563,417.00	3.90
229	002274	华昌化工	20,560,357.00	3.90
230	002276	万马股份	20,540,741.00	3.89

231	002405	四维图新	20,456,172.25	3.88
232	300315	掌趣科技	20,406,928.58	3.87
233	603916	苏博特	20,380,040.36	3.86
234	600869	远东股份	20,339,150.74	3.86
235	688711	江苏宏微科技	20,140,022.82	3.82
236	300327	中颖电子	20,136,238.40	3.82
237	002545	东方铁塔	20,111,946.16	3.81
238	600285	羚锐制药	20,009,388.77	3.79
239	600710	苏美达	20,000,872.20	3.79
240	002004	华邦健康	19,970,567.00	3.79
241	603279	景津装备	19,848,020.32	3.76
242	000928	中钢国际	19,776,217.38	3.75
243	603533	掌阅科技	19,768,398.00	3.75
244	301069	凯盛新材	19,673,982.20	3.73
245	000045	深纺织 A	19,670,853.00	3.73
246	688578	艾力斯医药科技	19,647,060.78	3.72
247	300068	南都电源	19,486,773.20	3.69
248	600825	新华传媒	19,426,226.00	3.68
249	600075	新疆天业	19,375,574.00	3.67
250	600312	平高电气	19,353,046.00	3.67
251	000917	电广传媒	19,341,024.97	3.67
252	300685	艾德生物	19,274,396.98	3.65
253	600812	华北制药	19,146,017.00	3.63
254	600446	金证股份	19,132,237.00	3.63
255	000600	建投能源	19,041,762.00	3.61
256	300039	上海凯宝	19,040,108.60	3.61
257	600618	氯碱化工	18,948,848.32	3.59
258	600248	陕建股份	18,936,232.00	3.59
259	600488	津药药业	18,887,449.20	3.58
260	600587	新华医疗	18,867,888.00	3.58
261	002695	煌上煌	18,755,636.00	3.56
262	000810	创维数字	18,529,052.00	3.51
263	600206	有研新材	18,526,839.00	3.51
264	000049	德赛电池	18,523,218.22	3.51
265	600754	锦江酒店	18,516,658.68	3.51
266	600610	中毅达	18,516,656.00	3.51
267	002446	盛路通信	18,503,123.25	3.51
268	300294	博雅生物	18,490,260.96	3.51
269	600750	江中药业	18,402,043.00	3.49
270	002537	海联金汇	18,371,627.88	3.48
271	002768	国恩股份	18,285,783.51	3.47
272	603530	神马电力	18,135,410.25	3.44

273	300616	尚品宅配	18,097,113.28	3.43
274	002978	安宁股份	18,036,757.19	3.42
275	688575	XD 亚辉龙生物	18,031,931.02	3.42
276	002737	葵花药业	17,887,975.00	3.39
277	000650	仁和药业	17,876,698.00	3.39
278	300803	指南针	17,832,630.78	3.38
279	300036	超图软件	17,810,307.39	3.38
280	688526	武汉科前生物	17,680,720.94	3.35
281	002053	云南能投	17,679,113.25	3.35
282	002600	领益智造	17,641,796.00	3.34
283	002041	登海种业	17,612,270.00	3.34
284	603010	万盛股份	17,595,988.52	3.34
285	601908	京运通	17,585,674.64	3.33
286	600063	皖维高新	17,577,170.28	3.33
287	605111	新洁能	17,534,325.46	3.32
288	002126	银轮股份	17,392,013.78	3.30
289	603305	旭升集团	17,385,246.54	3.30
290	000997	新大陆	17,382,907.00	3.30
291	603100	川仪股份	17,326,430.18	3.28
292	003012	东鹏控股	17,304,521.00	3.28
293	000767	晋控电力	17,271,862.19	3.27
294	301015	百洋医药	17,268,044.25	3.27
295	000989	九芝堂	17,255,214.97	3.27
296	600363	联创光电	17,233,874.98	3.27
297	600469	风神股份	17,223,466.00	3.27
298	603368	柳药集团	17,216,419.00	3.26
299	002646	天佑德酒	17,112,095.00	3.24
300	000729	燕京啤酒	17,103,947.03	3.24
301	600420	国药现代	17,089,232.23	3.24
302	600691	阳煤化工	17,088,519.12	3.24
303	600810	神马股份	17,025,245.59	3.23
304	601068	中铝国际	16,956,410.83	3.21
305	600635	大众公用	16,939,309.62	3.21
306	000727	冠捷科技	16,938,283.00	3.21
307	002747	埃斯顿	16,898,185.80	3.20
308	600717	天津港	16,867,432.04	3.20
309	002215	诺普信	16,811,682.24	3.19
310	300101	振芯科技	16,798,478.50	3.18
311	603906	龙蟠科技	16,797,653.08	3.18
312	300602	飞荣达	16,788,840.05	3.18
313	601208	东材科技	16,751,190.49	3.18
314	002239	奥特佳	16,736,108.70	3.17
315	603043	广州酒家	16,653,184.60	3.16

316	600114	东睦股份	16,648,852.80	3.16
317	002284	亚太股份	16,609,508.00	3.15
318	688223	晶科能源	16,576,524.33	3.14
319	600594	益佰制药	16,557,718.30	3.14
320	601399	国机重装	16,554,619.06	3.14
321	000725	京东方 A	16,509,052.00	3.13
322	603520	司太立	16,489,900.32	3.13
323	300653	正海生物	16,480,828.00	3.12
324	000058	深赛格	16,445,133.90	3.12
325	601918	新集能源	16,443,446.36	3.12
326	600284	浦东建设	16,387,735.46	3.11
327	601999	出版传媒	16,386,997.36	3.11
328	603439	贵州三力	16,222,646.00	3.08
329	603718	海利生物	16,186,072.00	3.07
330	688148	芳源股份	16,184,098.04	3.07
331	000795	英洛华	16,112,262.90	3.05
332	600477	杭萧钢构	16,033,630.40	3.04
333	002226	江南化工	15,968,624.92	3.03
334	600696	岩石股份	15,937,878.18	3.02
335	603218	日月股份	15,866,051.00	3.01
336	300696	爱乐达	15,834,675.18	3.00
337	301078	孩子王	15,796,751.72	2.99
338	600586	金晶科技	15,787,793.00	2.99
339	002344	海宁皮城	15,722,834.48	2.98
340	300394	天孚通信	15,701,591.10	2.98
341	002317	众生药业	15,647,233.59	2.97
342	300233	金城医药	15,631,985.00	2.96
343	003040	楚天龙	15,583,807.23	2.95
344	601965	中国汽研	15,527,082.77	2.94
345	600059	古越龙山	15,481,511.00	2.93
346	002567	唐人神	15,403,854.24	2.92
347	300693	盛弘股份	15,342,091.86	2.91
348	300406	九强生物	15,336,857.00	2.91
349	000612	焦作万方	15,327,809.00	2.91
350	603566	普莱柯	15,302,309.95	2.90
351	600645	中源协和	15,282,854.00	2.90
352	002060	粤水电	15,265,598.66	2.89
353	002987	京北方	15,256,054.70	2.89
354	600062	华润双鹤	15,254,864.00	2.89
355	688676	海南金盘智能科技	15,251,066.64	2.89
356	600129	太极集团	15,228,311.00	2.89
357	300031	宝通科技	15,222,659.97	2.89

358	002390	信邦制药	15,192,152.29	2.88
359	688559	海目星激光	15,170,265.23	2.88
360	002233	塔牌集团	15,051,666.00	2.85
361	301207	华兰疫苗	15,039,158.00	2.85
362	605507	国邦医药	15,030,716.96	2.85
363	300134	大富科技	15,012,638.94	2.85
364	601600	中国铝业	15,007,634.00	2.85
365	002063	远光软件	14,942,108.85	2.83
366	603306	华懋科技	14,941,189.00	2.83
367	002091	江苏国泰	14,917,150.19	2.83
368	601949	中国出版	14,895,008.00	2.82
369	603338	浙江鼎力	14,889,777.63	2.82
370	600266	城建发展	14,870,888.00	2.82
371	002612	朗姿股份	14,813,859.52	2.81
372	002324	普利特	14,799,056.00	2.81
373	000685	中山公用	14,779,613.80	2.80
374	300767	震安科技	14,746,349.92	2.80
375	002516	旷达科技	14,726,558.00	2.79
376	002518	科士达	14,687,277.00	2.78
377	300679	电连技术	14,658,975.51	2.78
378	605009	豪悦护理	14,656,210.95	2.78
379	600675	中华企业	14,651,991.97	2.78
380	688798	艾为电子	14,650,606.60	2.78
381	002190	成飞集成	14,649,692.00	2.78
382	601163	三角轮胎	14,638,356.00	2.78
383	603103	横店影视	14,617,418.60	2.77
384	300348	长亮科技	14,546,882.00	2.76
385	002891	中宠股份	14,535,797.01	2.76
386	688366	昊海生物科技	14,470,470.58	2.74
387	600386	北巴传媒	14,398,306.16	2.73
388	688238	和元生物	14,390,260.33	2.73
389	603060	国检集团	14,382,882.87	2.73
390	600682	南京新百	14,337,311.00	2.72
391	002100	天康生物	14,276,300.32	2.71
392	603088	宁波精达	14,242,058.20	2.70
393	300726	宏达电子	14,241,875.11	2.70
394	002454	松芝股份	14,214,619.09	2.69
395	601519	大智慧	14,173,778.00	2.69
396	000034	神州数码	14,171,751.00	2.69
397	000011	深物业 A	14,170,628.00	2.69
398	601728	中国电信	14,154,243.00	2.68
399	301050	雷电微力	14,133,722.96	2.68
400	600172	黄河旋风	14,123,336.00	2.68

401	300119	瑞普生物	14,123,264.26	2.68
402	000551	创元科技	14,058,471.00	2.67
403	603466	风语筑	14,047,794.40	2.66
404	300973	立高食品	14,041,976.00	2.66
405	601890	亚星锚链	14,041,511.30	2.66
406	000422	湖北宜化	13,970,098.68	2.65
407	300451	创业慧康	13,944,560.60	2.64
408	600711	盛屯矿业	13,931,618.00	2.64
409	002938	鹏鼎控股	13,878,194.06	2.63
410	002484	江海股份	13,872,073.00	2.63
411	600602	云赛智联	13,870,989.00	2.63
412	603993	洛阳钼业	13,848,186.00	2.63
413	300219	鸿利智汇	13,844,904.35	2.62
414	000919	金陵药业	13,841,795.00	2.62
415	301339	通行宝	13,808,779.10	2.62
416	002617	露笑科技	13,756,980.00	2.61
417	002287	奇正藏药	13,743,108.19	2.61
418	002038	双鹭药业	13,694,595.08	2.60
419	601882	海天精工	13,686,000.00	2.59
420	002644	佛慈制药	13,678,954.00	2.59
421	600105	永鼎股份	13,675,749.00	2.59
422	002724	海洋王	13,664,476.74	2.59
423	002677	浙江美大	13,662,620.26	2.59
424	301155	海力风电	13,653,594.00	2.59
425	600835	上海机电	13,605,321.27	2.58
426	600596	新安股份	13,582,130.80	2.57
427	002243	力合科创	13,567,964.00	2.57
428	002332	仙琚制药	13,509,033.00	2.56
429	000823	超声电子	13,479,582.07	2.56
430	002234	民和股份	13,445,708.00	2.55
431	600997	开滦股份	13,438,841.50	2.55
432	002254	泰和新材	13,404,871.00	2.54
433	600116	三峡水利	13,400,721.70	2.54
434	600277	亿利洁能	13,388,007.00	2.54
435	002097	山河智能	13,383,329.50	2.54
436	603228	景旺电子	13,362,593.30	2.53
437	600874	创业环保	13,297,345.87	2.52
438	600986	浙文互联	13,295,278.68	2.52
439	000885	城发环境	13,255,826.30	2.51
440	600664	哈药股份	13,231,131.00	2.51
441	300026	红日药业	13,221,350.14	2.51
442	600273	嘉化能源	13,216,641.00	2.51
443	002960	青鸟消防	13,208,360.90	2.50

444	601001	晋控煤业	13,205,555.00	2.50
445	600422	昆药集团	13,191,000.52	2.50
446	600031	三一重工	13,162,439.00	2.50
447	000718	苏宁环球	13,152,422.36	2.49
448	688209	英集芯科技	13,128,671.60	2.49
449	600211	西藏药业	13,091,290.80	2.48
450	002810	山东赫达	13,056,290.76	2.48
451	688403	汇成股份	13,047,820.05	2.47
452	603301	振德医疗	13,020,848.83	2.47
453	688590	新致软件	12,992,397.97	2.46
454	002106	莱宝高科	12,948,513.60	2.45
455	600120	浙江东方	12,915,037.32	2.45
456	000902	新洋丰	12,883,887.70	2.44
457	301047	义翘神州	12,873,160.50	2.44
458	600229	城市传媒	12,870,343.00	2.44
459	002267	陕天然气	12,868,637.00	2.44
460	002585	双星新材	12,864,273.00	2.44
461	002242	九阳股份	12,858,764.00	2.44
462	000019	深粮控股	12,856,250.90	2.44
463	300382	斯莱克	12,853,714.27	2.44
464	300229	拓尔思	12,846,317.00	2.44
465	000901	航天科技	12,838,354.00	2.43
466	000737	北方铜业	12,825,271.00	2.43
467	601928	凤凰传媒	12,795,497.00	2.43
468	002645	华宏科技	12,772,460.00	2.42
469	600888	新疆众和	12,769,321.40	2.42
470	600729	重庆百货	12,749,090.00	2.42
471	688206	概伦电子	12,734,548.95	2.41
472	600742	一汽富维	12,688,018.60	2.41
473	688187	时代电气	12,642,618.68	2.40
474	603730	岱美股份	12,632,206.71	2.39
475	002573	清新环境	12,604,880.16	2.39
476	688800	瑞可达连接系统	12,591,029.06	2.39
477	688106	金宏气体	12,561,337.91	2.38
478	600225	卓朗科技	12,523,391.21	2.37
479	000960	锡业股份	12,500,613.08	2.37
480	605168	三人行	12,469,262.01	2.36
481	300455	航天智装	12,453,694.00	2.36
482	002201	正威新材	12,447,880.35	2.36
483	002434	万里扬	12,428,255.00	2.36
484	600746	江苏索普	12,419,926.40	2.35
485	002895	川恒股份	12,390,983.00	2.35

486	002916	深南电路	12,383,843.48	2.35
487	300298	三诺生物	12,381,211.49	2.35
488	000688	国城矿业	12,379,401.00	2.35
489	603008	喜临门	12,348,184.00	2.34
490	300755	华致酒行	12,335,327.60	2.34
491	688331	荣昌生物	12,327,959.28	2.34
492	601319	中国人保	12,288,394.00	2.33
493	002782	可立克	12,286,783.54	2.33
494	300398	飞凯材料	12,281,414.03	2.33
495	600498	烽火通信	12,261,145.00	2.32
496	000060	中金岭南	12,205,006.00	2.31
497	002006	精工科技	12,177,157.00	2.31
498	300383	光环新网	12,165,561.00	2.31
499	002662	京威股份	12,093,497.50	2.29
500	000852	石化机械	12,090,408.20	2.29
501	603123	翠微股份	12,053,490.73	2.29
502	002124	天邦食品	12,036,941.00	2.28
503	002472	双环传动	12,000,055.00	2.27
504	600373	中文传媒	11,886,394.50	2.25
505	600308	华泰股份	11,868,594.14	2.25
506	603005	晶方科技	11,861,000.00	2.25
507	603933	睿能科技	11,839,679.00	2.24
508	002449	国星光电	11,835,290.00	2.24
509	601007	金陵饭店	11,792,810.00	2.24
510	001213	中铁特货	11,756,032.00	2.23
511	002838	道恩股份	11,737,073.45	2.23
512	600490	鹏欣资源	11,717,316.00	2.22
513	688680	海优新材	11,659,428.36	2.21
514	600027	华电国际	11,656,420.00	2.21
515	300267	尔康制药	11,628,152.00	2.20
516	000756	新华制药	11,585,883.00	2.20
517	600933	爱柯迪	11,569,851.00	2.19
518	600328	中盐化工	11,551,397.24	2.19
519	603208	江山欧派	11,527,259.60	2.19
520	300725	药石科技	11,526,883.28	2.19
521	002354	天娱数科	11,509,869.00	2.18
522	002605	姚记科技	11,508,927.26	2.18
523	600558	大西洋	11,505,356.65	2.18
524	688608	恒玄科技	11,488,130.50	2.18
525	603876	鼎胜新材	11,466,532.40	2.17
526	002436	兴森科技	11,454,551.00	2.17
527	002901	大博医疗	11,452,372.24	2.17
528	600483	福能股份	11,404,309.80	2.16

529	603693	江苏新能	11,362,346.90	2.15
530	603877	太平鸟	11,318,381.91	2.15
531	601606	长城军工	11,312,416.00	2.14
532	300276	三丰智能	11,299,938.11	2.14
533	600829	人民同泰	11,278,376.00	2.14
534	300910	瑞丰新材	11,277,545.16	2.14
535	603179	新泉股份	11,240,821.90	2.13
536	300723	一品红	11,233,891.70	2.13
537	000601	韶能股份	11,230,360.25	2.13
538	603387	基蛋生物	11,212,534.39	2.13
539	002048	宁波华翔	11,171,384.00	2.12
540	603960	克来机电	11,147,524.66	2.11
541	300263	隆华科技	11,113,082.07	2.11
542	002422	科伦药业	11,109,784.00	2.11
543	600163	中闽能源	11,097,596.92	2.10
544	002517	恺英网络	11,091,587.57	2.10
545	002929	润建股份	11,086,341.95	2.10
546	688508	芯朋微电子	11,053,472.50	2.10
547	300002	神州泰岳	11,041,277.00	2.09
548	300709	精研科技	11,040,415.15	2.09
549	603013	亚普股份	11,028,206.00	2.09
550	600125	铁龙物流	11,003,797.02	2.09
551	300458	全志科技	10,995,410.00	2.08
552	000423	东阿阿胶	10,989,329.00	2.08
553	002626	金达威	10,961,909.48	2.08
554	600770	综艺股份	10,938,688.25	2.07
555	002733	雄韬股份	10,897,992.65	2.07
556	002906	华阳集团	10,881,386.49	2.06
557	300433	蓝思科技	10,867,683.00	2.06
558	002218	拓日新能	10,865,508.80	2.06
559	002531	天顺风能	10,854,806.00	2.06
560	000589	贵州轮胎	10,834,037.00	2.05
561	300228	富瑞特装	10,814,687.34	2.05
562	603985	恒润股份	10,728,309.00	2.03
563	002950	奥美医疗	10,723,485.50	2.03
564	300443	金雷股份	10,720,263.00	2.03
565	301089	拓新药业	10,717,426.18	2.03
566	688700	东威科技	10,673,452.16	2.02
567	003021	兆威机电	10,658,600.37	2.02
568	300376	易事特	10,655,438.00	2.02
569	002984	森麒麟	10,642,800.00	2.02
570	000050	深天马 A	10,627,020.00	2.01
571	002043	兔宝宝	10,601,496.00	2.01

572	600400	红豆股份	10,588,628.84	2.01
573	003032	传智教育	10,587,951.00	2.01
574	000652	泰达股份	10,577,987.00	2.01
575	301363	美好医疗	10,577,816.00	2.01
576	002051	中工国际	10,562,346.00	2.00

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

#### 8.4.3 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	17,929,631,422.25
卖出股票收入（成交）总额	17,195,131,517.21

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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货。若本基金投资股指期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，综合考虑流动性、基差水平、与股票组合相关度等因素，以对冲投资组合的风险、有效管理

现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,413,120.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,787,300.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,200,420.69

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国泰君安中证 1000 指数增强 A	6,058	57,915.67	105,500,720.00	30.07%	245,352,426.00	69.93%
国泰君安中证 1000 指数增强 C	6,094	173,802.71	867,724,321.18	81.93%	191,429,373.77	18.07%
合计	12,152	116,030.85	973,225,041.18	69.02%	436,781,799.77	30.98%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国泰君安中证 1000 指数增强 A	2,373,262.22	0.6764%
	国泰君安中证 1000 指数增强 C	407,953.22	0.0385%
	合计	2,781,215.44	0.1972%

注：分类基金基金管理人所有从业人员持有本基金份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
----	------	--------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	国泰君安中证 1000 指数增强 A	>100
	国泰君安中证 1000 指数增强 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安中证 1000 指数增强 A	>100
	国泰君安中证 1000 指数增强 C	-
	合计	>100

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安中证 1000 指数 增强 A	国泰君安中证 1000 指数 增强 C
基金合同生效日（2022 年 08 月 16 日）基金份 额总额	332,110,120.07	277,282,091.55
本报告期初基金份额总额	309,802,278.63	273,418,758.21
本报告期基金总申购份额	357,057,144.74	1,544,188,135.89
减：本报告期基金总赎回份额	316,006,277.37	758,453,199.15
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	350,853,146.00	1,059,153,694.95

注：基金总申购份额含红利再投资及转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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：

2023 年 4 月 8 日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于完成公司法  
定代表人变更登记的公告》，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 4 月

6 日在上海市场监督管理局办理完毕。

2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

### 11.5 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。本基金本年度应支付给审计机构普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 4 万元人民币。其为本基金提供审计服务的连续年限为自 2022 年 08 月 16 日(基金合同生效日)至本报告期末。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 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。

#### 11.6.2 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	35,114,018,836.58	100.00%	2,503,131.27	100.00%	-
东方财富	2	-	-	-	-	-

富证券					
-----	--	--	--	--	--

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-01-20
2	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2022 年 4 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-01-20
3	国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2022 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-03-31
4	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-03-31
5	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于完成公司法定代表人变更登记的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2023-04-08
6	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下产品参与直销 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
7	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年 1 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-04-22
8	国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-04-23
9	关于旗下部分开放式证券投资基金在珠海盈米基金销售有限公司开通基金转换业务的公告	中国证券报、证券时报、证监会指定网站、公司官网	2023-07-03
10	关于调整旗下部分开放式基金在部分销售机构最低申购金额、最低追加申购金额、最低赎回份额和最低持有限额的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证监会指定网站、公司官网	2023-07-07
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 1000 指数增强在直销柜台开展申购费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2023-07-08
11	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下公募基金投资管理人关联方承销期内分销证券的公告	上海证券报、中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2023-07-08

12	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年 2 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	2023-07-21
13	国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年第二季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-07-21
14	国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（2023 年第 1 号）	证监会指定网站、公司官网	2023-08-15
15	国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2023-08-15
16	国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2023-08-15
17	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下公募基金的公告	证监会指定网站、公司官网	2023-08-21
18	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下公募基金的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-08-22
19	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-08-31
20	国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告	证监会指定网站、公司官网	2023-08-31
21	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年第 3 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	2023-10-25
22	国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年第三季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-10-25

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 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>。

### 13.3 查阅方式

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

上海国泰君安证券资产管理有限公司  
二〇二四年三月二十九日