

# 国泰君安中证 500 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:上海银行股份有限公司

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。

基金托管人上海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	8
2.4 信息披露方式	9
2.5 其他相关资料	9
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	11
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	19
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 .....	19
<b>§ 5 托管人报告 .....</b>	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	19
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 .....	19
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 .....	19
<b>§ 6 审计报告 .....</b>	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	19
6.2 审计报告的基本内容 .....	20
<b>§ 7 年度财务报表 .....</b>	<b>22</b>
7.1 资产负债表 .....	22
7.2 利润表 .....	24
7.3 净资产变动表 .....	25
7.4 报表附注 .....	27
<b>§ 8 投资组合报告 .....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	58
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 .....	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	93
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 .....	93
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 .....	93

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 .....	93
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 .....	93
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	93
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	93
8.12 投资组合报告附注 .....	94
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>95</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	95
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	95
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 .....	95
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>96</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>96</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	96
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 .....	96
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	97
11.4 基金投资策略的改变 .....	97
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	97
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 .....	97
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	97
11.8 其他重大事件 .....	97
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>99</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 .....	99
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	99

§ 13 备查文件目录 .....	99
13.1 备查文件目录 .....	100
13.2 存放地点 .....	100
13.3 查阅方式 .....	100

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	国泰君安中证 500 指数增强	
基金主代码	014155	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 15 日	
基金管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,595,692,397.40 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安中证 500 指数增强 A	国泰君安中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	014155	014156
报告期末下属分级基金的份额总额	1,513,115,108.29 份	1,082,577,289.11 份

### 2.2 基金产品说明

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

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上海国泰君安证券资产管理有限公司	上海银行股份有限公司



信息披露负责人	姓名	吕巍	周直毅
	联系电话	021-38676022	021-68475608
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	custody@bosscn.com
客户服务电话	95521	95594	
传真	021-38871190	021-68476901	
注册地址	上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号	
办公地址	上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 27 层	
邮政编码	200120	200120	
法定代表人	陶耿	金煜	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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		2021 年 12 月 15 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日	
	国泰君安中证 500 指数增强 A	国泰君安中证 500 指数增强 C	国泰君安中证 500 指数增强 A	国泰君安中证 500 指数增强 C	国泰君安中证 500 指数增强 A	国泰君安中证 500 指数增强 C
本期已实	-52,630,033.87	-40,550,274.89	-58,980,579.81	-38,870,650.6	2,117,444.15	1,216,752.84

现收益						
本期利润	-60,810,436.69	-47,665,725.12	-82,898,773.21	-52,702,521.24	10,755,833.57	6,498,554.62
加权平均基金份额本期利润	-0.0526	-0.0645	-0.1090	-0.1167	0.0149	0.0148
本期加权平均净值利润率	-5.62%	-6.97%	-11.72%	-12.57%	1.49%	1.47%
本期基金份额净值增长率	-2.60%	-2.98%	-11.34%	-11.70%	1.49%	1.47%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	-186,950,050.52	-141,512,532.46	-85,805,614.26	-55,776,463.74	2,117,788.83	1,217,397.57
期末可供分配基金份额利润	-0.1236	-0.1307	-0.1002	-0.1040	0.0029	0.0028
期末基金资产净值	1,326,165,057.77	941,064,756.65	770,119,749.37	480,552,447.98	731,816,002.77	447,384,542.36
期末基金份额	0.8764	0.8693	0.8998	0.8960	1.0149	1.0147

净值						
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	-12.36%	-13.07%	-10.02%	-10.40%	1.49%	1.47%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 国泰君安中证 500 指数增强 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.81%	0.81%	-4.36%	0.82%	-0.45%	-0.01%
过去六个月	-8.46%	0.82%	-9.01%	0.81%	0.55%	0.01%
过去一年	-2.60%	0.79%	-7.01%	0.78%	4.41%	0.01%
自基金合同生效起至今	-12.36%	1.07%	-24.61%	1.07%	12.25%	0.00%

##### 国泰君安中证 500 指数增强 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.90%	0.81%	-4.36%	0.82%	-0.54%	-0.01%
过去六个月	-8.64%	0.82%	-9.01%	0.81%	0.37%	0.01%
过去一年	-2.98%	0.79%	-7.01%	0.78%	4.03%	0.01%
自基金合同生效起至今	-13.07%	1.07%	-24.61%	1.07%	11.54%	0.00%

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

国泰君安中证500指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年12月15日-2023年12月31日)



国泰君安中证500指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年12月15日-2023年12月31日)



### 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：本基金于 2021 年 12 月 15 日成立，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。



注：本基金于 2021 年 12 月 15 日成立，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 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。	2021-12-15	-	12 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士，12 年证券从业经验，具备基金从业资格。曾任香港科技大学人工智能实验室访问学者，其后加盟方正证券研究所、国泰君安证券咨询部及研究所从事量化对冲模型的研发工作，2014 年加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，先后在量化投资部、权益与衍生品部担任高级投资经理，从事量化投资和策略研发工作，在 Alpha 量化策略以及基于机器学习的投资方面有独到且深入的研究。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部总经理，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。

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，消费板块表现疲弱。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。

2023 年 A 股整体表现较弱，从主要宽基指数涨跌幅来看，沪深 300 全年下跌 11.38%，中证 500 下跌 7.42%，中证 1000 下跌 6.28%，万得全 A 指数跌幅 5.19%，从年初冲高后震荡下行，全年波动较大。

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 500 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 21 倍和 22 倍左右，依然处于历史较为低估的水平，在历史上的分位数为 10% 左右，而用 PB 估值的话，则历史分位数更低，在市场主要宽基指数当中是历史相对估值最低的指数之一，处于历史分位数 5% 之内。另外一方面，即便剔除中证 500 指数中煤炭、有色、石油石化、钢铁和基础化工等五大强周期行业的成分股，从历史纵向来分析，其加权 PE 历史分位数也仍处极端低位，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。未来随着经济的逐步企稳向好，作为市场中优质中盘股的代表，中证 500 指数有望迎来估值和盈利的双击。我们认为做为一个价值股和成长股、周期股和非周期股、新兴行业和传统行业均相对均衡的中盘宽基指数，中证 500 指数依然是当前市场环境下进可攻、退可守的选择。

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 500 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 500 指数当前依然处于历史低估阶段，成长性良好，指数未来上涨的空间依然远大于下跌的空间，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 500 指数增强 A 基金份额净值为 0.8764 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.60%，同期业绩比较基准收益率为-7.01%；截至报告期末国泰君安中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 0.8693 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.98%，同期业绩比较基准收益率为-7.01%。

#### 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 500 指数作为市场当前中盘股的典型代表，兼具成长和价值双重属性，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，诚然过去几年随着公私募量化行业以及场外衍生品的快速发展，中证 500 指数的波动率变得越来越低，在中证 500 上博取超额收益的难度越来越受到挑战。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

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

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

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

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

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

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

### § 6 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 21324 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 500 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 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“国泰君安中证 500 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 500 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 500 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 500 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 500 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 500 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 500 指数增强基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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>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 500 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 500 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>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>薛 竞 段 黄 霖</p>

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 500 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	288,213,888.11	82,350,580.82
结算备付金		19,607,250.57	6,469,542.93
存出保证金		1,435,315.20	2,796,309.60
交易性金融资产	7.4.7.2	2,132,056,415.86	1,162,187,263.14
其中：股票投资		2,132,056,415.86	1,162,187,263.14
基金投资		-	0
债券投资		-	0
资产支持证券投资		-	0
贵金属投资		-	0
其他投资		-	0
衍生金融资产	7.4.7.3	-	0
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	0
债权投资		-	0
其中：债券投资		-	0
资产支持证券投资		-	0
其他投资		-	0

应收清算款		-	0
应收股利		-	0
应收申购款		1,780,876.92	1,484,101.69
递延所得税资产		-	0
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		2,443,093,746.66	1,255,287,798.18
<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		-	0
交易性金融负债		-	0
衍生金融负债	7.4.7.3	-	0
卖出回购金融资产款		-	0
应付清算款		-	0
应付赎回款		173,072,051.18	3,231,908.38
应付管理人报酬		1,964,989.84	969,871.11
应付托管费		294,748.47	145,480.67
应付销售服务费		360,936.83	143,036.49
应付投资顾问费		-	0
应交税费		-	0
应付利润		-	0
递延所得税负债		-	0
其他负债	7.4.7.6	171,205.92	125,304.18
负债合计		175,863,932.24	4,615,600.83

<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	2,595,692,397.40	1,392,254,275.35
未分配利润	7.4.7.8	-328,462,582.98	-141,582,078.00
净资产合计		2,267,229,814.42	1,250,672,197.35
负债和净资产总计		2,443,093,746.66	1,255,287,798.18

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,595,692,397.40 份。其中国泰君安中证 500 指数增强 A 基金份额净值 0.8764 元，基金份额总额 1,513,115,108.29 份；国泰君安中证 500 指数增强 C 基金份额净值 0.8693 元，基金份额总额 1,082,577,289.11 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 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 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-85,381,295.01	-120,892,620.88
1. 利息收入		819,394.54	545,573.68
其中：存款利息收入	7.4.7.9	819,394.54	545,573.68
债券利息收入		-	0
资产支持证券利息收入		-	0
买入返售金融资产收入		-	0
其他利息收入		-	0
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-73,762,280.14	-84,908,003.83
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-93,801,093.64	-94,879,690.07
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	-2,602,411.06	-3,320,737.13
股利收益	7.4.7.12	22,641,224.56	13,292,423.37
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	0
其他投资收益		-	0
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	-15,295,853.05	-37,750,064.04
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	2,857,443.64	1,219,873.31
<b>减：二、营业总支出</b>		23,094,866.80	14,708,673.57
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	17,567,318.27	11,229,421.44
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,635,097.67	1,684,413.10
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,717,417.25	1,672,640.81
4. 投资顾问费		-	0
5. 利息支出		-	0
其中：卖出回购金融资产支出		-	0
6. 信用减值损失		-	0
7. 税金及附加		4,907.61	0
8. 其他费用	7.4.7.15	170,126.00	122,198.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-108,476,161.81	-135,601,294.45
减：所得税费用		-	0
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-108,476,161.81	-135,601,294.45
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-108,476,161.81	-135,601,294.45

### 7.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 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	1,392,254,275.35	-141,582,078	1,250,672,197.35
二、本期期初净资产	1,392,254,275.35	-141,582,078	1,250,672,197.35
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,203,438,122.05	-186,880,504.98	1,016,557,617.07
（一）、综合收益总额	-	-108,476,161.81	-108,476,161.81
（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）	1,203,438,122.05	-78,404,343.17	1,125,033,778.88
其中：1. 基金申购款	2,768,082,073.14	-195,523,765.84	2,572,558,307.30
2. 基金赎回款	-1,564,643,951.09	117,119,422.67	-1,447,524,528.42
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	2,595,692,397.40	-328,462,582.98	2,267,229,814.42
项 目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 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	1,161,946,276.66	17,254,268.47	1,179,200,545.13
加：会计政策变更	-	0	0
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	1,161,946,276.66	17,254,268.47	1,179,200,545.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	230,307,998.69	-158,836,346.47	71,471,652.22
（一）、综合收益总额	-	-135,601,294.45	-135,601,294.45
（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）	230,307,998.69	-23,235,052.02	207,072,946.67
其中：1. 基金申购款	949,670,956.86	-73,396,743.65	876,274,213.21
2. 基金赎回款	-719,362,958.17	50,161,691.63	-669,201,266.54
（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)	0	0	0
四、本期期末净资产	1,392,254,275.35	-141,582,078	1,250,672,197.35

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 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]3391 号《关于准予国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册,由上海国泰君安证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,160,406,264.46 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 1179 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2021 年 12 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,160,704,146.74 份,其中认购资金利息折合 297,882.28 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,基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购费、申购费,但不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资者认购、申购时不收取认购费、申购费,而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份券(包括存托凭证)、备选成份券(包括存托凭证)、其他国内依法发行上市的股票和存托凭证(包括主板、创业板和其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转换债)、可交换债、次级债、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、中期票据等)、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票、存托凭证资产的比例不低于基金资产的 80%,投资于中证 500 指数成份券及其备选成份券的资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,待履行适当程序后,以变更后的规定为准。本基金的业绩比较基准为中证 500 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 500 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。

##### 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 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	199,396,393.60	41,351,778.40
等于：本金	199,376,499.48	41,343,156.31
加：应计利息	19,894.12	8,622.09
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	0
等于：本金	-	0
加：应计利息	-	0
减：坏账准备	-	0
其中：存款期限 1 个月以内	-	0
存款期限 1-3 个月	-	0
存款期限 3 个月以上	-	0
其他存款	88,817,494.51	40,998,802.42
等于：本金	88,811,139.69	40,993,868.82
加：应计利息	6,354.82	4,933.60
减：坏账准备	-	-
合计	288,213,888.11	82,350,580.82

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	2,171,268,187.63	-	2,132,056,415.86	-39,211,771.77
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	2,171,268,187.63	-	2,132,056,415.86	-39,211,771.77
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	1,185,978,082.75	-	1,162,187,263.14	-23,790,819.61
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		0	0	-	0
基金		0	-	0	0
其他		0	0	-	0
合计		1,185,978,082.75	0	1,162,187,263.14	-23,790,819.61

#### 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	11,874,914.12	0.00	-	-
股指期货	11,874,914.12	0.00	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,874,914.12	-	-	-
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	20,012,693.23	0	-	-
股指期货	20,012,693.23	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	20,012,693.23	0	-	-

##### 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
IC2401	IC2401	11	11,960,960.00	86,045.88
合计				86,045.88
减：可抵销期货暂收款				86,045.88

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	-	0
应付赎回费	1,205.92	304.18
应付证券出借违约金	-	0
应付交易费用	-	0
其中：交易所市场	-	0
银行间市场	-	0
应付利息	-	0
预提信息披露费	120,000.00	75,000
预提审计费	50,000.00	50,000
合计	171,205.92	125,304.18

##### 7.4.7.7 实收基金

###### 国泰君安中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	855,925,363.63	855,925,363.63
本期申购	1,246,215,133.48	1,246,215,133.48
本期赎回（以“-”号填列）	-589,025,388.82	-589,025,388.82
本期末	1,513,115,108.29	1,513,115,108.29

**国泰君安中证 500 指数增强 C**

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	536,328,911.72	536,328,911.72
本期申购	1,521,866,939.66	1,521,866,939.66
本期赎回（以“-”号填列）	-975,618,562.27	-975,618,562.27
本期末	1,082,577,289.11	1,082,577,289.11

注：申购含红利再投、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 500 指数增强 A**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-67,351,917.65	-18,453,696.61	-85,805,614.26
本期期初	-67,351,917.65	-18,453,696.61	-85,805,614.26
本期利润	-52,630,033.87	-8,180,402.82	-60,810,436.69
本期基金份额交易产生的变动数	-23,175,256.96	-17,158,742.61	-40,333,999.57
其中：基金申购款	-54,082,721.82	-28,876,719.95	-82,959,441.77
基金赎回款	30,907,464.86	11,717,977.34	42,625,442.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-143,157,208.48	-43,792,842.04	-186,950,050.52

**国泰君安中证 500 指数增强 C**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-44,240,537.77	-11,535,925.97	-55,776,463.74
本期期初	-44,240,537.77	-11,535,925.97	-55,776,463.74
本期利润	-40,550,274.89	-7,115,450.23	-47,665,725.12
本期基金份额交易产生的变动数	-25,520,220.51	-12,550,123.09	-38,070,343.60
其中：基金申购款	-76,861,747.71	-35,702,576.36	-112,564,324.07
基金赎回款	51,341,527.20	23,152,453.27	74,493,980.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-110,311,033.17	-31,201,499.29	-141,512,532.46

#### 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 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	389,144.10	250,315.32
定期存款利息收入	-	0
其他存款利息收入	217,121.86	174,820.97
结算备付金利息收入	213,128.58	120,437.39
其他	-	0
合计	819,394.54	545,573.68

#### 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 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	36,982,054,103.23	28,238,711,275.14
减：卖出股票成本总额	37,034,168,768.64	28,296,790,211.69

减：交易费用	41,686,428.23	36,800,753.52
买卖股票差价收入	-93,801,093.64	-94,879,690.07

#### 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 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-2,337,979.11	-3,180,826.77
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	40,896.61	-
减：交易费用	223,535.34	139,910.36
合计	-2,602,411.06	-3,320,737.13

#### 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 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	22,641,224.56	13,292,423.37
其中：证券出借权益补偿收入	-	0
基金投资产生的股利收益	-	0
合计	22,641,224.56	13,292,423.37

#### 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 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-15,420,952.16	-37,711,010.81
——股票投资	-15,420,952.16	-37,711,010.81
——债券投资	-	0
——资产支持证券投资	-	0
——基金投资	-	0
——贵金属投资	-	0
——其他	-	-
2. 衍生工具	125,099.11	-39,053.23
——权证投资	-	0
——期货投资	125,099.11	-39,053.23
3. 其他	-	0
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	0
合计	-15,295,853.05	-37,750,064.04

#### 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 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,857,443.64	1,219,873.31
合计	2,857,443.64	1,219,873.31

#### 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 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	71,662.22
证券出借违约金	-	0
银行汇划费	126.00	536
合计	170,126.00	122,198.22

#### 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
上海银行股份有限公司(以下简称“上海银行”)	基金托管人、代销机构
国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君	基金管理人的股东、代销机构



安证券” )	
--------	--

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 01 月 01 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	74,989,407,044.99	100.00%	56,608,931,439.29	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	5,346,233.26	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 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	3,863,860.36	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 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	17,567,318.27	11,229,421.44
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,742,471.55	5,153,958.89
应支付基金管理人的净管理费	10,824,846.72	6,075,462.55

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

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

##### 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 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,635,097.67	1,684,413.1

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

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

##### 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 500 指数增强 A	国泰君安中证 500 指数增强 C	合计
国泰君安资管	-	859,031.21	859,031.21
国泰君安证券	-	1,068,337.21	1,068,337.21
上海银行	-	1,274.43	1,274.43
合计	-	1,928,642.85	1,928,642.85

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 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 500 指数增强 A	国泰君安中证 500 指数增强 C	合计
国泰君安资管	-	55,210.74	55,210.74
国泰君安证券	-	1,375,622.57	1,375,622.57
上海银行	-	919.02	919.02
合计	-	1,431,752.33	1,431,752.33

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

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值  $\times$  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自有资金投资本基金的情况

##### 国泰君安中证 500 指数增强 A

份额单位：份

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2021 年 12 月 15 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	9,999,450	9,999,450
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	9,999,450.00	-
报告期末持有的基金份额	0.00	9,999,450
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	1.17%

##### 国泰君安中证 500 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 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2021 年 12 月 15 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	0	-
报告期间申购/买入总份额	-	-

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	0
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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 01 月 01 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
上海银行	199,396,393.60	389,144.10	41,351,778.4	250,315.32
国泰君安证券	88,817,494.51	217,121.86	40,998,802.42	174,820.97

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

#### 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 01 月 01 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	1-6 个月(含)	网下新股限售	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
301559	中集环科	2023 年 09 月 26 日	1-6 个月(含)	网下新股限售	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
301525	儒竞科技	2023 年 08 月 23 日	1-6 个月(含)	网下新股限售	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
688627	精智达技术	2023 年 07 月 11 日	1-6 个月(含)	网下新股限售	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
301468	博盈特焊	2023 年 07 月 12 日	1-6 个月(含)	网下新股限售	47.58	30.22	598	28,452.84	18,071.56	-
301509	金凯生	2023 年 07 月 26 日	1-6 个月(含)	网下新股限售	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-

	科									
601096	宏盛华源铁塔集团	2023 年 12 月 15 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
688610	埃科光电	2023 年 07 月 10 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301456	盘古智能	2023 年 07 月 06 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
688602	康鹏科技	2023 年 07 月 13 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688719	爱科赛博	2023 年 09 月 20 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
301508	中机认检	2023 年 11 月 23 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301251	威尔高	2023 年 08 月 30 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
688592	司南导航	2023 年 08 月 07 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
688603	天承科技	2023 年 06 月 30 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-

688653	康希通信	2023 年 11 月 10 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688716	中研股份	2023 年 09 月 13 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
301413	安培龙	2023 年 12 月 11 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023 年 08 月 10 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301516	中远通	2023 年 12 月 01 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301272	英华特	2023 年 07 月 06 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301469	恒达新材	2023 年 08 月 10 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-
301518	长华化学	2023 年 07 月 26 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301568	思泰克	2023 年 11 月 21 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301520	万邦医药	2023 年 09 月 18 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
688638	誉辰智能	2023 年 07 月 04 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	83.90	59.68	141	11,829.90	8,414.88	-
301459	丰茂股份	2023 年 12 月 06 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-

688720	艾森股份	2023 年 11 月 29 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-
301517	陕西华达	2023 年 10 月 09 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301578	辰奕智能	2023 年 12 月 21 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
301548	崇德科技	2023 年 09 月 11 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
688657	浩辰软件	2023 年 09 月 25 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688646	逸飞激光	2023 年 07 月 21 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688693	锆威特	2023 年 08 月 10 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
603062	麦加芯彩	2023 年 10 月 31 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
301555	惠柏新材	2023 年 10 月 24 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301505	苏州规划	2023 年 07 月 12 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301529	福赛科技	2023 年 08 月 31 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
688648	中	2023 年	1-6 个	网下	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-



	邮科技	11 月 06 日	月 (含)	新股限售							
603004	鼎龙科技	2023 年 12 月 20 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-	
603107	上海汽配	2023 年 10 月 25 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	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	1-6 个月 (含)	网下新股限售	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-	
001306	夏厦精密	2023 年 11 月 09 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-	
603075	热威科技股份	2023 年 09 月 01 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-	
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-	
603231	索宝蛋白	2023 年 12 月 06 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-	
603373	安邦护卫集团股	2023 年 12 月 13 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-	

	份									
--	---	--	--	--	--	--	--	--	--	--

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上海银行股份有限公司，其他银行存款为国泰君安证券券商保证金，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2023 年 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	288,213,888.11	-	-	-	288,213,888.11
结算备付金	19,607,250.57	-	-	-	19,607,250.57
存出保证金	1,435,315.20	-	-	-	1,435,315.20
交易性金融 资产	-	-	-	2,132,056,415.86	2,132,056,415.86
应收申购款	-	-	-	1,780,876.92	1,780,876.92
资产总计	309,256,453.88	-	-	2,133,837,292.78	2,443,093,746.66

负债					
应付赎回款	-	-	-	173,072,051.18	173,072,051.18
应付管理人 报酬	-	-	-	1,964,989.84	1,964,989.84
应付托管费	-	-	-	294,748.47	294,748.47
应付销售服 务费	-	-	-	360,936.83	360,936.83
其他负债	-	-	-	171,205.92	171,205.92
负债总计	-	-	-	175,863,932.24	175,863,932.24
利率敏感度 缺口	309,256,453.88	-	-	1,957,973,360.54	2,267,229,814.42
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	82,350,580.82	0	0	-	82,350,580.82
结算备付金	6,469,542.93	-	-	0	6,469,542.93
存出保证金	2,796,309.60	-	-	0	2,796,309.60
交易性金融 资产	0	0	0	1,162,187,263.14	1,162,187,263.14
应收申购款	0	-	-	1,484,101.69	1,484,101.69
资产总计	91,616,433.35	-	-	1,163,671,364.83	1,255,287,798.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,231,908.38	3,231,908.38
应付管理人 报酬	-	-	-	969,871.11	969,871.11
应付托管费	-	-	-	145,480.67	145,480.67
应付销售服 务费	-	-	-	143,036.49	143,036.49
其他负债	-	-	-	125,304.18	125,304.18
负债总计	-	-	-	4,615,600.83	4,615,600.83
利率敏感度 缺口	91,616,433.35	-	-	1,159,055,764.00	1,250,672,197.35

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

#### 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	2,132,056,415.86	94.04	1,162,187,263.14	92.93
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,132,056,415.86	94.04	1,162,187,263.14	92.93

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 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%	111,458,169.05	61,633,390.40
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-111,458,169.05	-61,633,390.40

#### 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	2,130,673,151.99	1,153,710,000.39
第二层次	898,742.02	7,200,604.32
第三层次	484,521.85	1,276,658.43
合计	2,132,056,415.86	1,162,187,263.14

###### 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	-	1,276,658.43	1,276,658.43
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,069,836.67	1,069,836.67
转出第三层次	-	2,079,590.14	2,079,590.14

当期利得或损失总额	-	217,616.89	217,616.89
其中：计入损益的利得或损失	-	217,616.89	217,616.89
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	484,521.85	484,521.85
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	-	35,473.31	35,473.31
项目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 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	-	907,243.20	907,243.20
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,781,500.66	1,781,500.66
转出第三层次	-	1,771,768.75	1,771,768.75
当期利得或损失总额	-	359,683.32	359,683.32
其中：计入损益的利得或损失	-	359,683.32	359,683.32
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,276,658.43	1,276,658.43
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	-	-48,649.50	-48,649.50

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	484,521.85	亚式期权	预期年化波动率	14.62%~217.75%	负相关



性折扣估值处于限售期的股票投资		模型			
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	1,276,658.43	平均价格 亚式期权 模型	预期年化波动率	18.91%~247.56%	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	2,132,056,415.86	87.27
	其中：股票	2,132,056,415.86	87.27
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	307,821,138.68	12.60
8	其他各项资产	3,216,192.12	0.13
9	合计	2,443,093,746.66	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	2,481,807.00	0.11
B	采矿业	48,175,747.00	2.12
C	制造业	1,153,022,544.23	50.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	67,890,589.04	2.99
E	建筑业	22,472,688.82	0.99
F	批发和零售业	24,611,751.61	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	41,978,423.00	1.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	140,947,187.56	6.22
J	金融业	140,173,868.21	6.18
K	房地产业	2,005,490.90	0.09
L	租赁和商务服务业	3,652,224.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	16,686,164.00	0.74
N	水利、环境和公共设施管理业	93,840.00	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	15,505,403.00	0.68
R	文化、体育和娱乐业	17,759,698.08	0.78
S	综合	5,508,408.00	0.24

	合计	1,702,965,834.45	75.11
--	----	------------------	-------

### 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	2,520,315.00	0.11
B	采矿业	14,925,625.20	0.66
C	制造业	295,689,841.95	13.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,927,845.00	0.83
E	建筑业	9,753,650.97	0.43
F	批发和零售业	4,528,119.30	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	26,668,199.95	1.18
H	住宿和餐饮业	80,730.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,085,748.48	1.02
J	金融业	4,203,039.00	0.19
K	房地产业	782,301.00	0.03
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	407,488.46	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	51,344.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	27,463,275.10	1.21
S	综合	-	-
	合计	429,090,581.41	18.93

### 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	600096	云天化	1,729,500	26,980,200.00	1.19
2	600867	通化东宝	2,428,600	26,301,738.00	1.16
3	002673	西部证券	4,106,565	26,158,819.05	1.15
4	600497	驰宏锌锗	5,108,400	25,797,420.00	1.14
5	000519	中兵红箭	1,796,300	25,220,052.00	1.11
6	600498	烽火通信	1,513,900	25,191,296.00	1.11

7	600141	兴发集团	1,370,240	25,006,880.00	1.10
8	002558	巨人网络	2,224,900	24,785,386.00	1.09
9	000060	中金岭南	5,682,600	24,548,832.00	1.08
10	000960	锡业股份	1,711,400	24,507,248.00	1.08
11	002152	广电运通	1,972,900	24,187,754.00	1.07
12	600582	天地科技	4,427,302	24,084,522.88	1.06
13	000987	越秀资本	3,980,968	23,965,427.36	1.06
14	300558	贝达药业	460,245	23,725,629.75	1.05
15	002600	领益智造	3,437,500	23,237,500.00	1.02
16	000738	航发控制	1,157,282	23,029,911.80	1.02
17	600062	华润双鹤	1,237,100	23,010,060.00	1.01
18	002423	中粮资本	3,417,300	22,827,564.00	1.01
19	601000	唐山港	6,507,200	22,775,200.00	1.00
20	002563	森马服饰	3,742,400	21,593,648.00	0.95
21	600580	卧龙电驱	1,823,800	21,393,174.00	0.94
22	002056	横店东磁	1,536,600	20,805,564.00	0.92
23	000959	首钢股份	5,853,700	20,253,802.00	0.89
24	600637	东方明珠	2,614,900	19,664,048.00	0.87
25	603317	天味食品	1,478,114	19,644,135.06	0.87
26	603456	九洲药业	795,034	19,247,773.14	0.85
27	000050	深天马 A	1,786,100	19,021,965.00	0.84
28	300861	美畅股份	556,500	18,525,885.00	0.82
29	601216	君正集团	4,952,400	18,521,976.00	0.82
30	600737	中粮糖业	2,215,300	18,254,072.00	0.81
31	300253	卫宁健康	2,530,200	18,192,138.00	0.80
32	688006	浙江杭可科技	768,672	18,048,418.56	0.80
33	603228	景旺电子	790,800	17,840,448.00	0.79
34	688819	天能电池集团 股份	631,971	17,644,630.32	0.78
35	300357	我武生物	589,200	17,086,800.00	0.75
36	300724	捷佳伟创	229,076	16,953,914.76	0.75
37	601577	长沙银行	2,395,600	16,337,992.00	0.72
38	600970	中材国际	1,718,323	16,049,136.82	0.71
39	000598	兴蓉环境	2,775,800	15,794,302.00	0.70
40	688385	复旦微电	403,904	15,602,811.52	0.69
41	601139	深圳燃气	2,256,800	15,549,352.00	0.69
42	601298	青岛港	2,511,700	15,522,306.00	0.68
43	000887	中鼎股份	1,253,600	15,507,032.00	0.68
44	000729	燕京啤酒	1,790,300	15,450,289.00	0.68
45	300682	朗新集团	938,500	15,382,015.00	0.68
46	003035	南网能源	2,920,400	15,361,304.00	0.68
47	000932	华菱钢铁	2,913,700	15,005,555.00	0.66
48	002373	千方科技	1,284,300	14,397,003.00	0.64

49	600528	中铁工业	1,932,784	14,379,912.96	0.63
50	300383	光环新网	1,473,900	14,326,308.00	0.63
51	002608	江苏国信	2,179,900	14,321,943.00	0.63
52	002064	华峰化学	2,128,500	14,282,235.00	0.63
53	000739	普洛药业	926,300	14,255,757.00	0.63
54	002044	美年健康	2,355,700	14,157,757.00	0.62
55	603156	养元饮品	660,400	14,040,104.00	0.62
56	002791	坚朗五金	331,000	13,402,190.00	0.59
57	000559	万向钱潮	2,508,000	13,016,520.00	0.57
58	600765	中航重机	681,000	13,013,910.00	0.57
59	600546	山煤国际	737,800	12,918,878.00	0.57
60	300595	欧普康视	557,612	12,590,878.96	0.56
61	688276	长春百克生物 科技	224,362	12,297,281.22	0.54
62	000830	鲁西化工	1,205,400	12,090,162.00	0.53
63	600390	五矿资本	2,546,700	11,918,556.00	0.53
64	601928	凤凰传媒	1,348,468	11,880,003.08	0.52
65	601608	中信重工	3,016,400	11,643,304.00	0.51
66	000783	长江证券	2,163,100	11,637,478.00	0.51
67	600885	宏发股份	405,000	11,194,200.00	0.49
68	688772	珠海冠宇电池	499,893	11,002,644.93	0.49
69	603267	鸿远电子	216,200	10,853,240.00	0.48
70	600271	航天信息	1,005,000	10,693,200.00	0.47
71	002532	天山铝业	1,765,900	10,613,059.00	0.47
72	601158	重庆水务	1,850,100	10,490,067.00	0.46
73	300529	健帆生物	468,970	10,425,203.10	0.46
74	601636	旗滨集团	1,492,100	10,205,964.00	0.45
75	002407	多氟多	655,840	9,981,884.80	0.44
76	600642	申能股份	1,514,992	9,726,248.64	0.43
77	603517	绝味食品	358,030	9,616,685.80	0.42
78	000728	国元证券	1,376,800	9,403,544.00	0.41
79	000636	风华高科	674,008	9,206,949.28	0.41
80	688234	天岳先进	139,203	9,197,142.21	0.41
81	603866	桃李面包	1,130,100	8,656,566.00	0.38
82	688099	晶晨半导体	137,856	8,633,921.28	0.38
83	600535	天士力	505,800	8,608,716.00	0.38
84	600959	江苏有线	2,515,600	7,898,984.00	0.35
85	300136	信维通信	333,000	7,858,800.00	0.35
86	601231	环旭电子	507,600	7,669,836.00	0.34
87	002340	格林美	1,367,600	7,467,096.00	0.33
88	300088	长信科技	1,092,500	7,308,825.00	0.32
89	002092	中泰化学	1,179,100	7,192,510.00	0.32
90	002683	广东宏大	341,700	6,861,336.00	0.30

91	600928	西安银行	1,997,600	6,652,008.00	0.29
92	300009	安科生物	642,200	6,563,284.00	0.29
93	600161	天坛生物	208,400	6,447,896.00	0.28
94	600820	隧道股份	1,115,200	6,423,552.00	0.28
95	002384	东山精密	352,100	6,401,178.00	0.28
96	000039	中集集团	822,780	6,294,267.00	0.28
97	600060	海信视像	290,798	6,077,678.20	0.27
98	603816	顾家家居	164,892	5,771,220.00	0.25
99	600699	均胜电子	314,500	5,648,420.00	0.25
100	605358	立昂微	202,600	5,549,214.00	0.24
101	000009	中国宝安	469,200	5,508,408.00	0.24
102	002268	电科网安	238,428	5,355,092.88	0.24
103	600998	九州通	760,761	5,332,934.61	0.24
104	603185	弘元绿能	160,077	5,327,362.56	0.23
105	600801	华新水泥	426,035	5,295,615.05	0.23
106	688521	芯原微电子	103,540	5,172,858.40	0.23
107	600166	福田汽车	1,867,300	5,097,729.00	0.22
108	603927	中科软	167,100	5,009,658.00	0.22
109	300296	利亚德	806,400	4,838,400.00	0.21
110	002408	齐翔腾达	915,160	4,832,044.80	0.21
111	600967	内蒙一机	580,700	4,796,582.00	0.21
112	002185	华天科技	544,488	4,639,037.76	0.20
113	002128	电投能源	312,900	4,465,083.00	0.20
114	688107	安路科技	110,725	4,072,465.50	0.18
115	603650	彤程新材	121,800	4,055,940.00	0.18
116	688114	华大智造	45,294	3,896,189.88	0.17
117	600500	中化国际	831,486	3,675,168.12	0.16
118	600415	小商品城	483,700	3,540,684.00	0.16
119	600704	物产中大	792,300	3,509,889.00	0.15
120	000563	陕国投 A	1,136,100	3,453,744.00	0.15
121	002429	兆驰股份	618,800	3,452,904.00	0.15
122	300144	宋城演艺	340,600	3,361,722.00	0.15
123	603160	汇顶科技	46,300	3,199,330.00	0.14
124	600481	双良节能	367,600	3,109,896.00	0.14
125	001203	大中矿业	303,000	3,081,510.00	0.14
126	600038	中直股份	76,400	2,943,692.00	0.13
127	600109	国金证券	318,600	2,892,888.00	0.13
128	601179	中国西电	583,100	2,874,683.00	0.13
129	300285	国瓷材料	119,200	2,755,904.00	0.12
130	003022	联泓新科	150,210	2,750,345.10	0.12
131	000937	冀中能源	368,300	2,629,662.00	0.12
132	603338	浙江鼎力	48,298	2,471,408.66	0.11
133	600859	王府井	149,800	2,392,306.00	0.11

134	002120	韵达股份	320,500	2,390,930.00	0.11
135	300026	红日药业	559,600	2,372,704.00	0.10
136	000021	深科技	144,000	2,334,240.00	0.10
137	000630	铜陵有色	679,800	2,229,744.00	0.10
138	600549	厦门钨业	129,500	2,224,810.00	0.10
139	002409	雅克科技	37,800	2,106,594.00	0.09
140	600879	航天电子	258,460	1,992,726.60	0.09
141	601098	中南传媒	175,100	1,780,767.00	0.08
142	002244	滨江集团	244,700	1,778,969.00	0.08
143	600968	海油发展	623,000	1,775,550.00	0.08
144	601568	北元集团	369,500	1,751,430.00	0.08
145	300003	乐普医疗	107,300	1,733,968.00	0.08
146	002138	顺络电子	64,000	1,728,640.00	0.08
147	300866	安克创新	19,200	1,701,120.00	0.08
148	688297	中航无人机	44,139	1,691,847.87	0.07
149	600598	北大荒	140,500	1,681,785.00	0.07
150	002508	老板电器	76,200	1,659,636.00	0.07
151	601555	东吴证券	219,900	1,607,469.00	0.07
152	002414	高德红外	219,500	1,602,350.00	0.07
153	300395	菲利华	42,500	1,553,800.00	0.07
154	688331	荣昌生物	22,771	1,413,168.26	0.06
155	688002	睿创微纳	30,900	1,366,398.00	0.06
156	000883	湖北能源	320,880	1,357,322.40	0.06
157	300244	迪安诊断	56,600	1,347,646.00	0.06
158	300012	华测检测	93,300	1,324,860.00	0.06
159	002065	东华软件	194,800	1,201,916.00	0.05
160	000683	远兴能源	204,600	1,201,002.00	0.05
161	300024	机器人	100,900	1,197,683.00	0.05
162	300373	扬杰科技	32,200	1,181,740.00	0.05
163	601958	金铂股份	114,500	1,082,025.00	0.05
164	688208	道通科技	44,987	1,068,441.25	0.05
165	603056	德邦股份	73,300	1,060,651.00	0.05
166	603589	口子窖	23,400	1,060,020.00	0.05
167	002025	航天电器	21,600	1,037,232.00	0.05
168	600392	盛和资源	94,600	963,028.00	0.04
169	300207	欣旺达	64,100	946,116.00	0.04
170	688779	长远锂科	125,953	919,456.90	0.04
171	002507	涪陵榨菜	60,300	861,687.00	0.04
172	600517	国网英大	179,800	857,646.00	0.04
173	002511	中顺洁柔	85,600	856,000.00	0.04
174	002463	沪电股份	37,200	822,864.00	0.04
175	000547	航天发展	91,979	769,864.23	0.03
176	002506	协鑫集成	270,500	741,170.00	0.03

177	002472	双环传动	27,500	715,550.00	0.03
178	600901	江苏金租	144,100	697,444.00	0.03
179	300114	中航电测	15,600	682,500.00	0.03
180	688516	奥特维科技	7,300	660,650.00	0.03
181	601666	平煤股份	55,000	635,800.00	0.03
182	600909	华安证券	119,760	584,428.80	0.03
183	600977	中国电影	47,200	577,728.00	0.03
184	601168	西部矿业	39,600	565,092.00	0.02
185	000930	中粮科技	78,000	517,920.00	0.02
186	002430	杭氧股份	17,600	514,096.00	0.02
187	002517	恺英网络	41,900	468,023.00	0.02
188	600988	赤峰黄金	32,200	451,122.00	0.02
189	600482	中国动力	24,600	443,046.00	0.02
190	002299	圣农发展	24,900	427,782.00	0.02
191	600985	淮北矿业	25,300	420,739.00	0.02
192	002557	洽洽食品	11,900	414,358.00	0.02
193	600348	华阳股份	42,050	410,408.00	0.02
194	600369	西南证券	93,900	384,051.00	0.02
195	603868	飞科电器	7,600	383,800.00	0.02
196	000878	云南铜业	35,100	382,239.00	0.02
197	600398	海澜之家	50,900	377,678.00	0.02
198	000998	隆平高科	26,400	372,240.00	0.02
199	002385	大北农	60,800	362,368.00	0.02
200	002465	海格通信	27,700	355,945.00	0.02
201	600529	山东药玻	13,100	335,360.00	0.01
202	000591	太阳能	59,600	332,568.00	0.01
203	601077	渝农商行	79,000	322,320.00	0.01
204	000970	中科三环	30,200	312,570.00	0.01
205	000997	新大陆	15,600	305,916.00	0.01
206	002372	伟星新材	19,700	285,059.00	0.01
207	002958	青农商行	107,100	280,602.00	0.01
208	002572	索菲亚	17,000	271,150.00	0.01
209	000703	恒逸石化	37,900	254,688.00	0.01
210	600511	国药股份	8,500	243,270.00	0.01
211	000031	大悦城	76,270	226,521.90	0.01
212	000400	许继电气	10,300	226,188.00	0.01
213	600827	百联股份	22,600	214,474.00	0.01
214	000401	冀东水泥	33,086	211,419.54	0.01
215	688169	石头科技	726	205,421.70	0.01
216	002078	太阳纸业	15,800	192,286.00	0.01
217	600079	人福医药	7,300	181,478.00	0.01
218	603529	爱玛科技	7,100	177,784.00	0.01
219	600008	首创环保	62,400	167,856.00	0.01



220	600373	中文传媒	12,100	159,478.00	0.01
221	601228	广州港	50,000	156,500.00	0.01
222	002624	完美世界	13,000	153,920.00	0.01
223	600863	内蒙华电	38,700	150,930.00	0.01
224	600927	永安期货	9,300	146,103.00	0.01
225	688005	容百科技	3,600	143,280.00	0.01
226	300073	当升科技	3,200	122,240.00	0.01
227	002266	浙富控股	27,600	93,840.00	0.00
228	002030	达安基因	8,800	85,184.00	0.00
229	000785	居然之家	24,700	81,510.00	0.00
230	300601	康泰生物	3,000	81,450.00	0.00
231	601598	中国外运	13,900	72,836.00	0.00
232	601108	财通证券	5,900	45,784.00	0.00
233	002010	传化智联	6,500	30,030.00	0.00
234	300776	帝尔激光	20	1,205.20	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	002913	奥士康	593,900	18,203,035.00	0.80
2	600578	京能电力	5,824,100	17,239,336.00	0.76
3	300709	精研科技	472,500	14,737,275.00	0.65
4	601949	中国出版	1,625,000	13,130,000.00	0.58
5	600798	宁波海运	3,283,400	12,017,244.00	0.53
6	600623	华谊集团	1,856,180	11,953,799.20	0.53
7	002546	新联电子	1,857,900	9,289,500.00	0.41
8	688439	振华风光	102,078	9,096,170.58	0.40
9	601399	国机重装	3,201,900	9,061,377.00	0.40
10	300102	乾照光电	1,172,200	8,615,670.00	0.38
11	688252	天德钰科技	429,013	8,563,099.48	0.38
12	600479	千金药业	789,800	8,506,146.00	0.38
13	002662	京威股份	2,355,200	8,266,752.00	0.36
14	002364	中恒电气	1,045,100	8,047,270.00	0.35
15	688095	福昕软件开发	113,009	7,893,678.65	0.35
16	600789	鲁抗医药	1,056,000	7,539,840.00	0.33
17	002745	木林森	813,600	7,045,776.00	0.31
18	601600	中国铝业	1,237,000	6,976,680.00	0.31
19	603993	洛阳钼业	1,238,101	6,438,125.20	0.28
20	000507	珠海港	1,212,400	6,377,224.00	0.28
21	002204	大连重工	1,377,500	6,295,175.00	0.28
22	600489	中金黄金	620,900	6,184,164.00	0.27

23	002145	中核钛白	1,341,380	6,009,382.40	0.27
24	002614	奥佳华	781,000	5,857,500.00	0.26
25	002916	深南电路	78,000	5,537,220.00	0.24
26	688468	科美诊断	509,716	5,499,835.64	0.24
27	600757	长江传媒	713,200	5,313,340.00	0.23
28	688049	炬芯科技	139,049	5,293,595.43	0.23
29	000597	东北制药	979,400	5,239,790.00	0.23
30	600966	博汇纸业	791,300	4,913,973.00	0.22
31	603583	捷昌驱动	225,000	4,506,750.00	0.20
32	002284	亚太股份	513,100	4,499,887.00	0.20
33	300319	麦捷科技	458,800	4,422,832.00	0.20
34	600664	哈药股份	1,305,500	4,373,425.00	0.19
35	000582	北部湾港	576,300	4,328,013.00	0.19
36	002276	万马股份	419,500	4,287,290.00	0.19
37	002083	孚日股份	799,900	4,031,496.00	0.18
38	002206	海利得	800,500	4,018,510.00	0.18
39	600105	永鼎股份	720,000	3,988,800.00	0.18
40	000338	潍柴动力	282,400	3,854,760.00	0.17
41	600595	中孚实业	1,088,500	3,787,980.00	0.17
42	002274	华昌化工	487,176	3,678,178.80	0.16
43	688138	清溢光电	162,555	3,676,994.10	0.16
44	600351	亚宝药业	531,700	3,668,730.00	0.16
45	600812	华北制药	617,700	3,520,890.00	0.16
46	603429	集友股份	420,800	3,501,056.00	0.15
47	601968	宝钢包装	653,100	3,350,403.00	0.15
48	600825	新华传媒	725,100	3,241,197.00	0.14
49	601801	皖新传媒	429,058	2,981,953.10	0.13
50	600829	人民同泰	380,065	2,972,108.30	0.13
51	600368	五洲交通	730,581	2,885,794.95	0.13
52	600488	津药药业	559,600	2,742,040.00	0.12
53	000800	一汽解放	312,900	2,659,650.00	0.12
54	688503	聚和材料股份 公司	48,637	2,606,943.20	0.11
55	002390	信邦制药	574,800	2,552,112.00	0.11
56	600531	豫光金铅	418,400	2,531,320.00	0.11
57	002041	登海种业	190,500	2,520,315.00	0.11
58	300292	吴通控股	659,300	2,452,596.00	0.11
59	002029	七匹狼	425,800	2,439,834.00	0.11
60	601900	南方传媒	185,400	2,408,346.00	0.11
61	002534	西子洁能	187,500	2,341,875.00	0.10
62	300219	鸿利智汇	275,300	2,318,026.00	0.10
63	601606	长城军工	172,200	2,097,396.00	0.09
64	300628	亿联网络	70,380	2,079,729.00	0.09

65	600050	中国联通	468,100	2,050,278.00	0.09
66	002701	奥瑞金	469,215	1,942,550.10	0.09
67	000045	深纺织 A	158,500	1,870,300.00	0.08
68	300303	聚飞光电	291,300	1,727,409.00	0.08
69	600362	江西铜业	94,100	1,680,626.00	0.07
70	688475	萤石网络	37,242	1,672,165.80	0.07
71	002522	浙江众成	321,600	1,546,896.00	0.07
72	603093	南华期货	125,100	1,501,200.00	0.07
73	000650	仁和药业	222,700	1,476,501.00	0.07
74	300441	鲍斯股份	205,600	1,416,584.00	0.06
75	600310	广西能源	374,900	1,402,126.00	0.06
76	601857	中国石油	197,200	1,392,232.00	0.06
77	002946	新乳业	117,200	1,345,456.00	0.06
78	002255	海陆重工	251,800	1,332,022.00	0.06
79	603833	欧派家居	18,900	1,315,629.00	0.06
80	300476	胜宏科技	70,300	1,297,035.00	0.06
81	600577	精达股份	308,600	1,277,604.00	0.06
82	000617	中油资本	228,400	1,233,360.00	0.05
83	600409	三友化工	219,090	1,202,804.10	0.05
84	000682	东方电子	144,900	1,166,445.00	0.05
85	601878	浙商证券	111,800	1,166,074.00	0.05
86	603618	杭电股份	180,900	1,157,760.00	0.05
87	600776	东方通信	95,400	1,077,066.00	0.05
88	600584	长电科技	35,300	1,054,058.00	0.05
89	002644	佛慈制药	100,400	978,900.00	0.04
90	601952	苏垦农发	90,100	922,624.00	0.04
91	688003	天准科技	24,427	916,501.04	0.04
92	688717	艾罗能源	16,147	898,742.02	0.04
93	002866	传艺科技	40,300	855,166.00	0.04
94	000852	石化机械	137,500	845,625.00	0.04
95	301301	川宁生物	98,700	829,080.00	0.04
96	002303	美盈森	230,900	810,459.00	0.04
97	000969	安泰科技	85,200	765,948.00	0.03
98	000417	合肥百货	152,700	761,973.00	0.03
99	601908	京运通	160,900	735,313.00	0.03
100	688586	中航飞机装备	59,508	659,943.72	0.03
101	000919	金陵药业	83,400	656,358.00	0.03
102	002697	红旗连锁	129,900	646,902.00	0.03
103	601633	长城汽车	25,600	645,632.00	0.03
104	601107	四川成渝	140,600	617,234.00	0.03
105	603766	隆鑫通用	115,000	593,400.00	0.03
106	000049	德赛电池	21,210	575,215.20	0.03
107	600028	中国石化	97,400	543,492.00	0.02

108	002202	金风科技	66,200	529,600.00	0.02
109	002611	东方精工	101,800	504,928.00	0.02
110	600696	岩石股份	26,900	483,931.00	0.02
111	688599	天合光能	15,000	427,950.00	0.02
112	002636	金安国纪	46,400	413,424.00	0.02
113	002298	中电兴发	70,200	404,352.00	0.02
114	601311	骆驼股份	49,800	398,898.00	0.02
115	300145	中金环境	129,400	390,788.00	0.02
116	002129	TCL 中环	24,400	381,616.00	0.02
117	300376	易事特	59,800	380,926.00	0.02
118	002601	龙佰集团	21,900	375,147.00	0.02
119	600667	太极实业	52,899	371,879.97	0.02
120	002043	兔宝宝	40,200	356,172.00	0.02
121	600875	东方电气	23,600	345,032.00	0.02
122	601965	中国汽研	15,400	339,724.00	0.01
123	000006	深振业 A	70,500	323,595.00	0.01
124	603989	艾华集团	13,700	294,824.00	0.01
125	600619	海立股份	40,800	277,848.00	0.01
126	002090	金智科技	26,500	264,470.00	0.01
127	000951	中国重汽	19,300	257,848.00	0.01
128	002208	合肥城建	40,200	257,682.00	0.01
129	600188	兖矿能源	12,900	255,549.00	0.01
130	603166	福达股份	36,800	254,288.00	0.01
131	601921	浙版传媒	31,600	241,424.00	0.01
132	601319	中国人保	49,600	240,064.00	0.01
133	002454	松芝股份	31,800	238,818.00	0.01
134	601018	宁波港	66,300	236,028.00	0.01
135	002757	南兴股份	14,500	226,780.00	0.01
136	002467	二六三	48,400	224,576.00	0.01
137	002116	中国海诚	21,400	220,206.00	0.01
138	600035	楚天高速	54,100	206,662.00	0.01
139	600748	上实发展	57,600	201,024.00	0.01
140	603416	信捷电气	5,100	191,556.00	0.01
141	300109	新开源	10,200	184,008.00	0.01
142	600267	海正药业	19,600	183,456.00	0.01
143	600098	广州发展	32,900	176,673.00	0.01
144	600586	金晶科技	26,200	175,016.00	0.01
145	601126	四方股份	10,900	154,344.00	0.01
146	600713	南京医药	30,400	147,136.00	0.01
147	600551	时代出版	13,500	147,015.00	0.01
148	688368	晶丰明源半导 体	1,300	140,322.00	0.01
149	600547	山东黄金	4,900	112,063.00	0.00

150	600523	贵航股份	8,100	111,537.00	0.00
151	300228	富瑞特装	15,500	110,050.00	0.00
152	002479	富春环保	23,000	109,710.00	0.00
153	300307	慈星股份	16,800	107,856.00	0.00
154	601789	宁波建工	24,200	100,188.00	0.00
155	601339	百隆东方	20,000	97,400.00	0.00
156	600929	雪天盐业	13,600	87,720.00	0.00
157	301035	润丰股份	1,157	80,990.00	0.00
158	600754	锦江酒店	2,700	80,730.00	0.00
159	600501	航天晨光	5,400	73,872.00	0.00
160	300773	拉卡拉	4,500	72,180.00	0.00
161	300048	合康新能	13,000	65,780.00	0.00
162	002142	宁波银行	3,100	62,341.00	0.00
163	002057	中钢天源	7,600	61,104.00	0.00
164	688588	凌志软件	5,000	59,500.00	0.00
165	600132	重庆啤酒	800	53,160.00	0.00
166	301071	力量钻石	1,600	51,680.00	0.00
167	301267	华夏眼科	1,600	51,344.00	0.00
168	301047	义翘神州	500	41,200.00	0.00
169	002007	华兰生物	1,700	37,621.00	0.00
170	600288	大恒科技	3,300	37,554.00	0.00
171	000541	佛山照明	5,100	33,915.00	0.00
172	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
173	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
174	600810	神马股份	3,200	23,808.00	0.00
175	002609	捷顺科技	1,900	21,698.00	0.00
176	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
177	688627	精智达技术	222	19,473.84	0.00
178	301468	博盈特焊	598	18,071.56	0.00
179	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
180	601096	宏盛华源铁塔集团	3,918	15,907.08	0.00
181	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
182	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
183	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
184	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
185	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
186	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
187	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
188	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
189	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
190	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
191	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00

192	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
193	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
194	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
195	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
196	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
197	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
198	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
199	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
200	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
201	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
202	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
203	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
204	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
205	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
206	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
207	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
208	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
209	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
210	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
211	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
212	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
213	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
214	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
215	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
216	603193	润本生物技术 股份	303	5,047.98	0.00
217	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
218	603075	热威科技股份	182	4,242.42	0.00
219	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
220	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
221	603373	安邦护卫集团 股份	88	3,058.00	0.00
222	688018	乐鑫科技	22	2,264.90	0.00
223	688010	福光股份	38	914.28	0.00
224	688579	山大地纬软件	32	406.40	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	002152	广电运通	172,511,640.10	13.79

2	600498	烽火通信	165,541,828.00	13.24
3	300724	捷佳伟创	165,065,661.98	13.20
4	002422	科伦药业	156,488,986.29	12.51
5	600489	中金黄金	154,369,050.98	12.34
6	600580	卧龙电驱	151,967,094.54	12.15
7	600497	驰宏锌锗	151,525,414.86	12.12
8	603228	景旺电子	144,896,060.78	11.59
9	600535	天士力	143,666,488.96	11.49
10	600827	百联股份	136,766,007.85	10.94
11	300088	长信科技	135,138,536.17	10.81
12	002739	万达电影	134,661,617.00	10.77
13	600380	健康元	133,295,661.16	10.66
14	601168	西部矿业	131,073,833.67	10.48
15	688006	浙江杭可科技	130,976,991.57	10.47
16	600582	天地科技	130,533,640.34	10.44
17	600528	中铁工业	130,264,809.04	10.42
18	300136	信维通信	130,248,001.25	10.41
19	601231	环旭电子	129,300,944.45	10.34
20	300558	贝达药业	129,203,798.49	10.33
21	688772	珠海冠宇电池	128,156,958.05	10.25
22	002056	横店东磁	126,963,693.40	10.15
23	601555	东吴证券	125,573,441.24	10.04
24	002249	大洋电机	124,768,491.93	9.98
25	600062	华润双鹤	124,403,289.13	9.95
26	603338	浙江鼎力	123,931,290.04	9.91
27	002128	电投能源	123,162,895.08	9.85
28	000739	普洛药业	122,767,550.97	9.82
29	600316	洪都航空	121,017,682.87	9.68
30	603317	天味食品	120,416,336.74	9.63
31	300026	红日药业	119,658,036.00	9.57
32	600258	首旅酒店	117,799,091.65	9.42
33	601098	中南传媒	117,461,605.38	9.39
34	601000	唐山港	117,192,968.55	9.37
35	002563	森马服饰	116,145,528.20	9.29
36	600765	中航重机	116,101,057.65	9.28
37	000559	万向钱潮	115,719,101.80	9.25
38	300003	乐普医疗	114,607,755.61	9.16
39	601608	中信重工	114,013,575.83	9.12
40	601801	皖新传媒	113,790,056.55	9.10
41	000987	越秀资本	113,787,970.77	9.10
42	600373	中文传媒	113,591,371.01	9.08
43	300144	宋城演艺	113,524,521.57	9.08
44	002299	圣农发展	113,250,476.48	9.06

45	600707	彩虹股份	111,417,794.04	8.91
46	002423	中粮资本	111,407,318.00	8.91
47	603456	九洲药业	110,659,990.83	8.85
48	601139	深圳燃气	110,376,328.91	8.83
49	601636	旗滨集团	108,834,830.11	8.70
50	600968	海油发展	108,652,227.00	8.69
51	600667	太极实业	108,175,299.79	8.65
52	000050	深天马 A	108,070,992.15	8.64
53	600166	福田汽车	107,790,566.00	8.62
54	601108	财通证券	107,434,395.97	8.59
55	002745	木林森	106,699,618.76	8.53
56	300308	中际旭创	106,316,059.53	8.50
57	600909	华安证券	105,436,040.10	8.43
58	000027	深圳能源	105,300,942.59	8.42
59	600271	航天信息	105,261,123.86	8.42
60	603517	绝味食品	104,296,834.09	8.34
61	000060	中金岭南	104,172,749.13	8.33
62	603883	老百姓	103,666,605.55	8.29
63	688819	天能电池集团 股份	103,354,770.00	8.26
64	600623	华谊集团	102,767,051.99	8.22
65	000887	中鼎股份	102,441,601.61	8.19
66	000039	中集集团	101,852,486.74	8.14
67	601928	凤凰传媒	101,323,110.96	8.10
68	600161	天坛生物	101,248,857.33	8.10
69	600315	上海家化	100,708,892.65	8.05
70	002065	东华软件	99,869,836.42	7.99
71	002384	东山精密	99,830,477.60	7.98
72	600637	东方明珠	99,768,799.54	7.98
73	000728	国元证券	99,752,903.14	7.98
74	000738	航发控制	99,140,370.46	7.93
75	002683	广东宏大	98,452,877.69	7.87
76	601058	赛轮轮胎	97,839,426.48	7.82
77	000636	风华高科	96,265,761.05	7.70
78	601717	郑煤机	96,047,904.77	7.68
79	600435	北方导航	95,821,442.65	7.66
80	600967	内蒙一机	95,668,129.47	7.65
81	000683	远兴能源	94,784,406.26	7.58
82	603858	步长制药	93,726,292.60	7.49
83	300861	美畅股份	93,163,056.81	7.45
84	600863	内蒙华电	92,920,278.42	7.43
85	300017	网宿科技	92,587,118.31	7.40
86	688009	中国通号	92,508,728.91	7.40



87	688390	固德威电源	92,455,072.72	7.39
88	000960	锡业股份	92,263,854.39	7.38
89	002568	百润股份	92,111,159.08	7.36
90	600879	航天电子	91,878,724.45	7.35
91	002673	西部证券	91,510,851.30	7.32
92	600517	国网英大	91,463,392.20	7.31
93	002373	千方科技	91,180,071.11	7.29
94	300866	安克创新	91,159,591.90	7.29
95	603218	日月股份	90,819,741.01	7.26
96	300357	我武生物	90,014,739.90	7.20
97	000967	盈峰环境	89,704,054.89	7.17
98	688029	南微医学科技	89,394,063.77	7.15
99	600642	申能股份	88,901,700.96	7.11
100	600390	五矿资本	88,793,823.80	7.10
101	601958	金钼股份	88,516,138.97	7.08
102	600050	中国联通	87,942,930.00	7.03
103	000729	燕京啤酒	87,824,780.00	7.02
104	002532	天山铝业	87,280,563.00	6.98
105	000932	华菱钢铁	86,862,449.12	6.95
106	600369	西南证券	86,810,315.57	6.94
107	601665	齐鲁银行	86,604,424.54	6.92
108	000031	大悦城	86,378,210.96	6.91
109	600409	三友化工	85,932,529.57	6.87
110	000997	新大陆	85,483,150.90	6.83
111	600885	宏发股份	84,803,859.47	6.78
112	600820	隧道股份	84,501,826.80	6.76
113	002600	领益智造	84,410,238.54	6.75
114	688425	铁建重工	84,110,953.91	6.73
115	002465	海格通信	84,097,998.98	6.72
116	002273	水晶光电	84,051,689.82	6.72
117	002500	山西证券	82,996,849.52	6.64
118	600109	国金证券	81,980,706.03	6.55
119	601966	玲珑轮胎	81,755,980.25	6.54
120	002138	顺络电子	81,645,083.00	6.53
121	000898	鞍钢股份	80,470,790.47	6.43
122	002625	光启技术	79,845,373.34	6.38
123	601298	青岛港	79,594,217.56	6.36
124	603816	顾家家居	79,100,457.76	6.32
125	600673	东阳光	79,080,948.96	6.32
126	603267	鸿远电子	78,701,729.00	6.29
127	600699	均胜电子	78,624,276.96	6.29
128	600521	华海药业	78,593,872.10	6.28
129	600655	豫园股份	78,519,108.32	6.28

130	600867	通化东宝	78,355,608.29	6.27
131	000778	新兴铸管	78,307,452.67	6.26
132	688208	道通科技	77,815,819.89	6.22
133	600170	上海建工	77,706,121.61	6.21
134	600737	中粮糖业	77,242,322.67	6.18
135	002508	老板电器	76,782,336.97	6.14
136	300009	安科生物	76,675,642.00	6.13
137	600325	华发股份	76,641,694.20	6.13
138	603236	移远通信	76,308,945.04	6.10
139	000783	长江证券	75,881,082.00	6.07
140	600482	中国动力	75,829,072.00	6.06
141	002463	沪电股份	75,775,924.39	6.06
142	601179	中国西电	75,718,146.89	6.05
143	600927	永安期货	75,655,430.00	6.05
144	002985	北摩高科	75,354,297.65	6.03
145	600970	中材国际	74,716,901.89	5.97
146	600027	华电国际	74,652,646.31	5.97
147	600801	华新水泥	74,535,651.10	5.96
148	002531	天顺风能	74,396,308.18	5.95
149	600597	光明乳业	74,233,592.27	5.94
150	300383	光环新网	73,696,005.18	5.89
151	300296	利亚德	73,477,718.06	5.88
152	002203	海亮股份	72,868,653.35	5.83
153	603160	汇顶科技	71,925,539.20	5.75
154	600143	金发科技	71,586,121.00	5.72
155	600160	巨化股份	71,255,369.85	5.70
156	300699	光威复材	70,951,883.10	5.67
157	600398	海澜之家	70,078,904.00	5.60
158	300115	长盈精密	70,054,056.00	5.60
159	000830	鲁西化工	69,989,734.66	5.60
160	600598	北大荒	69,702,659.39	5.57
161	603345	安井食品	69,420,106.14	5.55
162	600566	济川药业	69,399,613.47	5.55
163	002081	金螳螂	69,250,367.04	5.54
164	002244	滨江集团	69,210,711.00	5.53
165	601077	渝农商行	69,078,578.04	5.52
166	603233	大参林	68,857,381.29	5.51
167	000807	云铝股份	68,807,795.80	5.50
168	000400	许继电气	68,147,356.84	5.45
169	601598	中国外运	67,748,299.50	5.42
170	300285	国瓷材料	66,865,468.10	5.35
171	002938	鹏鼎控股	66,456,086.08	5.31
172	000785	居然之家	66,231,588.00	5.30

173	603658	安图生物	66,204,032.10	5.29
174	600808	马钢股份	65,872,328.62	5.27
175	002966	苏州银行	65,760,182.78	5.26
176	600959	江苏有线	65,356,807.98	5.23
177	600755	厦门国贸	65,349,655.41	5.23
178	002572	索菲亚	65,278,017.00	5.22
179	002429	兆驰股份	64,819,039.63	5.18
180	000021	深科技	64,713,813.00	5.17
181	600339	中油工程	64,664,264.24	5.17
182	600928	西安银行	64,321,916.00	5.14
183	002372	伟星新材	64,186,875.32	5.13
184	600839	四川长虹	64,136,683.00	5.13
185	600705	中航产融	64,052,342.00	5.12
186	003035	南网能源	64,042,140.00	5.12
187	002608	江苏国信	63,727,102.04	5.10
188	000513	丽珠集团	63,487,536.67	5.08
189	000563	陕国投 A	63,458,876.66	5.07
190	600031	三一重工	63,041,130.00	5.04
191	600096	云天化	63,029,421.62	5.04
192	000623	吉林敖东	62,957,640.27	5.03
193	600038	中直股份	62,690,963.83	5.01
194	002025	航天电器	62,638,738.20	5.01
195	600195	中牧股份	62,596,105.30	5.00
196	688223	晶科能源	62,329,668.42	4.98
197	688234	天岳先进	61,819,851.48	4.94
198	002396	星网锐捷	61,553,408.98	4.92
199	603719	良品铺子	61,499,920.57	4.92
200	601600	中国铝业	60,578,743.00	4.84
201	002701	奥瑞金	60,483,830.24	4.84
202	600487	亨通光电	59,511,520.32	4.76
203	600131	国网信通	59,445,261.66	4.75
204	600583	海油工程	59,375,669.00	4.75
205	000598	兴蓉环境	58,960,351.00	4.71
206	603866	桃李面包	58,687,549.56	4.69
207	600718	东软集团	58,549,517.50	4.68
208	600906	财达证券	58,355,521.00	4.67
209	600348	华阳股份	58,327,407.90	4.66
210	600350	山东高速	57,994,309.15	4.64
211	002266	浙富控股	57,434,160.88	4.59
212	600985	淮北矿业	57,374,216.60	4.59
213	000725	京东方 A	57,286,639.00	4.58
214	002557	洽洽食品	57,238,277.05	4.58
215	000750	国海证券	56,785,348.97	4.54

216	601611	中国核建	56,670,756.68	4.53
217	002250	联化科技	56,325,922.16	4.50
218	002294	信立泰	56,309,772.35	4.50
219	600862	中航高科	55,849,110.88	4.47
220	002925	盈趣科技	55,751,106.36	4.46
221	000878	云南铜业	55,678,199.38	4.45
222	600415	小商品城	55,636,238.69	4.45
223	600704	物产中大	55,353,251.00	4.43
224	600572	康恩贝	55,138,715.00	4.41
225	600529	山东药玻	54,993,944.55	4.40
226	601728	中国电信	54,442,770.18	4.35
227	600418	江淮汽车	54,430,931.00	4.35
228	600259	广晟有色	54,352,931.49	4.35
229	300146	汤臣倍健	54,170,164.00	4.33
230	600664	哈药股份	54,137,455.00	4.33
231	603056	德邦股份	54,056,205.64	4.32
232	600488	津药药业	54,015,593.00	4.32
233	601163	三角轮胎	53,524,563.83	4.28
234	600299	安迪苏	53,421,644.88	4.27
235	000959	首钢股份	53,224,457.00	4.26
236	600859	王府井	52,922,395.94	4.23
237	603650	彤程新材	52,883,347.00	4.23
238	002926	华西证券	52,806,940.47	4.22
239	688002	睿创微纳	52,662,327.67	4.21
240	300058	蓝色光标	52,630,213.99	4.21
241	002511	中顺洁柔	52,261,894.36	4.18
242	600201	生物股份	52,077,496.72	4.16
243	601319	中国人保	51,894,178.89	4.15
244	600500	中化国际	51,820,288.18	4.14
245	600977	中国电影	51,676,044.10	4.13
246	600141	兴发集团	51,545,937.40	4.12
247	601456	国联证券	51,319,435.64	4.10
248	688099	晶晨半导体	50,618,715.79	4.05
249	603355	莱克电气	50,350,598.85	4.03
250	000825	太钢不锈	49,991,714.36	4.00
251	600998	九州通	49,738,003.06	3.98
252	601997	贵阳银行	49,342,556.71	3.95
253	603127	昭衍新药	49,053,983.47	3.92
254	600377	宁沪高速	49,027,790.36	3.92
255	601607	上海医药	48,909,922.00	3.91
256	601921	浙版传媒	48,840,345.16	3.91
257	600873	梅花生物	48,834,557.00	3.90
258	601399	国机重装	48,726,885.20	3.90

259	600782	新钢股份	48,162,607.11	3.85
260	002518	科士达	48,053,088.96	3.84
261	600066	宇通客车	47,929,923.24	3.83
262	603893	瑞芯微	47,566,245.24	3.80
263	603868	飞科电器	47,262,691.46	3.78
264	000975	银泰黄金	47,234,152.16	3.78
265	603596	伯特利	47,223,523.60	3.78
266	603939	益丰药房	47,222,746.02	3.78
267	000937	冀中能源	47,213,591.00	3.78
268	600531	豫光金铅	47,052,810.24	3.76
269	002212	天融信	47,009,196.00	3.76
270	002653	海思科	46,956,862.50	3.75
271	600825	新华传媒	46,914,476.00	3.75
272	002110	三钢闽光	46,798,990.48	3.74
273	002831	裕同科技	46,793,471.34	3.74
274	300433	蓝思科技	46,732,759.00	3.74
275	002111	威海广泰	46,265,798.00	3.70
276	601118	海南橡胶	46,174,614.34	3.69
277	001914	招商积余	46,123,772.00	3.69
278	688777	中控技术	45,954,984.01	3.67
279	300529	健帆生物	45,888,545.24	3.67
280	300253	卫宁健康	45,888,147.52	3.67
281	000589	贵州轮胎	45,665,732.05	3.65
282	002284	亚太股份	45,568,277.00	3.64
283	603444	吉比特	45,560,913.96	3.64
284	002916	深南电路	45,501,463.46	3.64
285	002223	鱼跃医疗	45,456,820.00	3.63
286	300373	扬杰科技	45,329,176.31	3.62
287	000597	东北制药	45,232,019.17	3.62
288	603605	珀莱雅	44,985,273.20	3.60
289	300776	帝尔激光	44,683,979.64	3.57
290	688521	芯原微电子	44,672,443.10	3.57
291	601106	中国一重	44,644,255.00	3.57
292	002048	宁波华翔	44,452,040.85	3.55
293	002468	申通快递	44,346,024.00	3.55
294	002409	雅克科技	44,088,405.62	3.53
295	600026	中远海能	43,960,933.50	3.51
296	002064	华峰化学	43,811,242.00	3.50
297	600352	浙江龙盛	43,761,485.00	3.50
298	300595	欧普康视	43,687,042.66	3.49
299	603613	国联股份	43,508,120.00	3.48
300	000998	隆平高科	43,415,568.60	3.47
301	600183	生益科技	43,224,477.11	3.46

302	300012	华测检测	42,694,384.20	3.41
303	002092	中泰化学	42,590,430.32	3.41
304	600511	国药股份	42,451,416.17	3.39
305	002078	太阳纸业	42,274,579.99	3.38
306	600167	联美控股	42,267,157.30	3.38
307	300376	易事特	42,243,298.11	3.38
308	600789	鲁抗医药	42,175,692.78	3.37
309	600966	博汇纸业	42,108,181.00	3.37
310	605358	立昂微	41,964,726.47	3.36
311	600549	厦门钨业	41,957,045.07	3.35
312	688169	石头科技	41,954,512.52	3.35
313	300888	稳健医疗	41,951,001.80	3.35
314	000009	中国宝安	41,465,992.96	3.32
315	688779	长远锂科	41,408,813.76	3.31
316	300482	万孚生物	41,408,299.05	3.31
317	000883	湖北能源	41,365,244.12	3.31
318	000519	中兵红箭	41,207,608.61	3.29
319	000045	深纺织 A	41,102,340.00	3.29
320	600229	城市传媒	40,930,926.15	3.27
321	600563	法拉电子	40,730,850.93	3.26
322	601666	平煤股份	40,481,673.08	3.24
323	603993	洛阳钼业	40,379,694.00	3.23
324	002268	电科网安	40,356,492.88	3.23
325	688088	虹软科技	40,176,900.43	3.21
326	002027	分众传媒	40,100,767.00	3.21
327	688276	长春百克生物 科技	39,915,726.69	3.19
328	688139	海尔生物	39,814,097.74	3.18
329	300257	开山股份	39,801,123.50	3.18
330	002901	大博医疗	39,744,377.61	3.18
331	600282	南钢股份	39,741,739.45	3.18
332	000402	金融街	39,508,500.37	3.16
333	688385	复旦微电	39,495,590.61	3.16
334	603299	苏盐井神	39,378,239.42	3.15
335	002705	新宝股份	39,107,348.00	3.13
336	000066	中国长城	38,938,954.00	3.11
337	600728	佳都科技	38,614,153.84	3.09
338	688187	时代电气	38,370,877.92	3.07
339	002632	道明光学	38,271,568.00	3.06
340	603171	税友股份	38,165,673.00	3.05
341	300073	当升科技	37,619,829.00	3.01
342	601158	重庆水务	37,547,231.00	3.00
343	601577	长沙银行	37,496,281.48	3.00

344	002419	天虹股份	37,478,176.00	3.00
345	688063	派能科技	37,346,979.23	2.99
346	603688	石英股份	36,973,464.00	2.96
347	601568	北元集团	36,694,945.10	2.93
348	601019	山东出版	36,683,628.00	2.93
349	601216	君正集团	36,655,105.72	2.93
350	300682	朗新集团	36,601,159.82	2.93
351	600216	浙江医药	36,500,397.67	2.92
352	603737	三棵树	36,483,143.10	2.92
353	002215	诺普信	36,466,847.00	2.92
354	001203	大中矿业	36,286,211.40	2.90
355	603589	口子窖	35,870,942.27	2.87
356	600546	山煤国际	35,689,412.00	2.85
357	601696	中银证券	35,595,213.00	2.85
358	002540	亚太科技	35,542,154.66	2.84
359	002044	美年健康	35,242,960.00	2.82
360	002913	奥士康	35,177,852.00	2.81
361	600469	风神股份	35,142,379.00	2.81
362	000852	石化机械	35,119,423.44	2.81
363	603707	健友股份	34,833,543.26	2.79
364	600456	宝钛股份	34,822,145.57	2.78
365	601137	博威合金	34,811,595.00	2.78
366	601872	招商轮船	34,538,086.17	2.76
367	600594	益佰制药	34,495,151.00	2.76
368	600329	达仁堂	34,479,308.99	2.76
369	002558	巨人网络	34,185,245.00	2.73
370	300251	光线传媒	34,151,445.00	2.73
371	002958	青农商行	34,135,987.00	2.73
372	600483	福能股份	34,074,468.30	2.72
373	301029	怡合达	33,882,018.08	2.71
374	600764	中国海防	33,853,879.69	2.71
375	601949	中国出版	33,841,874.10	2.71
376	600748	上实发展	33,451,485.00	2.67
377	300182	捷成股份	33,371,459.00	2.67
378	688107	安路科技	33,309,175.06	2.66
379	002145	中核钛白	33,197,563.27	2.65
380	300709	精研科技	32,948,192.00	2.63
381	688778	厦钨新能源	32,890,080.48	2.63
382	002206	海利得	32,839,512.94	2.63
383	601003	柳钢股份	32,775,011.00	2.62
384	002444	巨星科技	32,747,591.00	2.62
385	300869	康泰医学	32,654,898.22	2.61
386	603927	中科软	32,650,981.72	2.61

387	002603	以岭药业	32,492,959.32	2.60
388	600032	浙江新能	32,376,344.19	2.59
389	002791	坚朗五金	32,376,088.00	2.59
390	603712	七一二	32,168,410.88	2.57
391	601998	中信银行	32,113,063.58	2.57
392	688173	希荻微电子	32,106,019.95	2.57
393	002390	信邦制药	32,105,922.96	2.57
394	600153	建发股份	32,092,758.92	2.57
395	002408	齐翔腾达	32,044,933.60	2.56
396	002312	川发龙蟒	31,896,365.00	2.55
397	600682	南京新百	31,893,531.00	2.55
398	601991	大唐发电	31,710,846.48	2.54
399	600079	人福医药	31,675,719.00	2.53
400	002454	松芝股份	31,610,565.78	2.53
401	601699	潞安环能	31,493,021.10	2.52
402	002073	软控股份	31,469,879.00	2.52
403	002010	传化智联	31,310,483.44	2.50
404	601001	晋控煤业	31,273,027.35	2.50
405	002421	达实智能	31,235,595.00	2.50
406	300072	海新能科	31,122,288.48	2.49
407	300726	宏达电子	31,080,255.77	2.49
408	000919	金陵药业	31,076,404.33	2.48
409	603118	共进股份	31,039,993.99	2.48
410	002019	亿帆医药	31,011,006.14	2.48
411	002430	杭氧股份	30,837,038.79	2.47
412	002867	周大生	30,772,976.77	2.46
413	600351	亚宝药业	30,600,816.00	2.45
414	603915	国茂股份	30,349,734.00	2.43
415	603328	依顿电子	30,348,487.42	2.43
416	600155	华创云信	30,191,254.92	2.41
417	000576	甘化科工	30,165,167.00	2.41
418	600197	伊力特	30,137,201.36	2.41
419	600754	锦江酒店	29,905,007.00	2.39
420	300476	胜宏科技	29,713,189.90	2.38
421	002690	美亚光电	29,534,322.20	2.36
422	300438	鹏辉能源	29,482,936.00	2.36
423	600006	东风汽车	29,325,771.00	2.34
424	300457	赢合科技	29,078,302.00	2.33
425	000301	东方盛虹	28,940,015.00	2.31
426	688095	福昕软件开发	28,875,769.71	2.31
427	603103	横店影视	28,759,275.40	2.30
428	600685	中船防务	28,625,004.00	2.29
429	002624	完美世界	28,595,335.00	2.29



430	002757	南兴股份	28,568,093.33	2.28
431	601116	三江购物	28,555,513.00	2.28
432	002185	华天科技	28,296,354.07	2.26
433	300319	麦捷科技	28,294,705.95	2.26
434	002274	华昌化工	28,278,276.45	2.26
435	601016	节能风电	28,123,668.44	2.25
436	000703	恒逸石化	28,042,412.80	2.24
437	300759	康龙化成	27,945,899.79	2.23
438	000950	重药控股	27,615,855.50	2.21
439	600105	永鼎股份	27,572,988.75	2.20
440	002017	东信和平	27,569,424.40	2.20
441	688049	炬芯科技	27,519,436.95	2.20
442	601567	三星医疗	27,010,071.50	2.16
443	688072	拓荆科技	27,009,121.25	2.16
444	002434	万里扬	26,990,154.00	2.16
445	603379	三美股份	26,946,090.00	2.15
446	601187	厦门银行	26,839,837.00	2.15
447	002340	格林美	26,777,953.89	2.14
448	002368	太极股份	26,768,297.08	2.14
449	002919	名臣健康	26,757,985.00	2.14
450	688318	财富趋势	26,627,587.94	2.13
451	300377	赢时胜	26,594,161.00	2.13
452	600578	京能电力	26,546,824.00	2.12
453	603638	艾迪精密	26,503,130.02	2.12
454	688185	康希诺生物	26,488,112.55	2.12
455	002204	大连重工	26,423,268.16	2.11
456	601866	中远海发	26,213,487.00	2.10
457	000999	华润三九	26,173,258.80	2.09
458	600060	海信视像	26,100,239.68	2.09
459	600829	人民同泰	26,082,787.55	2.09
460	603305	旭升集团	25,983,168.00	2.08
461	002399	海普瑞	25,802,811.42	2.06
462	600114	东睦股份	25,710,371.68	2.06
463	600556	天下秀	25,709,403.00	2.06
464	688707	振华新材料	25,569,985.11	2.04
465	002353	杰瑞股份	25,539,022.00	2.04
466	603708	家家悦	25,432,204.85	2.03
467	002519	银河电子	25,364,551.40	2.03
468	601633	长城汽车	25,306,157.00	2.02
469	601606	长城军工	25,130,646.76	2.01
470	000553	安道麦 A	25,097,265.00	2.01
471	601778	晶科科技	25,057,372.00	2.00

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

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	002422	科伦药业	172,445,355.81	13.79
2	300724	捷佳伟创	150,503,468.80	12.03
3	002152	广电运通	149,612,929.83	11.96
4	600489	中金黄金	148,333,481.95	11.86
5	601168	西部矿业	148,302,495.05	11.86
6	600380	健康元	145,552,840.56	11.64
7	600535	天士力	141,083,914.51	11.28
8	600580	卧龙电驱	139,193,327.52	11.13
9	600498	烽火通信	138,972,055.28	11.11
10	002739	万达电影	135,667,411.05	10.85
11	601231	环旭电子	134,836,963.40	10.78
12	600827	百联股份	134,805,547.13	10.78
13	600497	驰宏锌锗	133,717,772.13	10.69
14	002249	大洋电机	132,680,635.72	10.61
15	300136	信维通信	130,957,405.75	10.47
16	603228	景旺电子	130,834,635.62	10.46
17	601555	东吴证券	128,480,593.26	10.27
18	300088	长信科技	125,445,415.68	10.03
19	603338	浙江鼎力	122,762,923.72	9.82
20	688772	珠海冠宇电池	122,700,632.53	9.81
21	601108	财通证券	121,011,558.48	9.68
22	002128	电投能源	120,186,554.27	9.61
23	601098	中南传媒	119,943,155.24	9.59
24	300144	宋城演艺	118,873,011.71	9.50
25	600528	中铁工业	118,282,763.29	9.46
26	600316	洪都航空	118,135,859.94	9.45
27	600373	中文传媒	117,875,219.95	9.42
28	600582	天地科技	117,715,561.13	9.41
29	002299	圣农发展	116,705,679.20	9.33
30	600258	首旅酒店	116,074,317.30	9.28
31	000739	普洛药业	115,611,678.57	9.24
32	688006	浙江杭可科技	115,296,577.94	9.22
33	600707	彩虹股份	114,924,400.80	9.19
34	300026	红日药业	113,816,237.42	9.10
35	600909	华安证券	112,627,196.45	9.01
36	600968	海油发展	112,324,063.70	8.98
37	300003	乐普医疗	110,975,034.06	8.87
38	300308	中际旭创	110,896,451.74	8.87

39	600667	太极实业	108,646,766.88	8.69
40	601801	皖新传媒	108,252,211.29	8.66
41	002056	横店东磁	107,075,066.80	8.56
42	300866	安克创新	106,612,741.84	8.52
43	601058	赛轮轮胎	106,511,711.59	8.52
44	603317	天味食品	105,917,982.48	8.47
45	300017	网宿科技	105,756,911.01	8.46
46	600062	华润双鹤	105,568,056.38	8.44
47	000027	深圳能源	104,825,231.65	8.38
48	000728	国元证券	104,719,788.50	8.37
49	601139	深圳燃气	104,076,228.07	8.32
50	300558	贝达药业	103,050,267.87	8.24
51	603883	老百姓	102,427,908.96	8.19
52	601608	中信重工	102,262,834.83	8.18
53	002065	东华软件	102,004,718.49	8.16
54	000559	万向钱潮	101,280,402.87	8.10
55	601717	郑煤机	101,273,711.73	8.10
56	600166	福田汽车	101,176,409.00	8.09
57	002745	木林森	100,822,503.58	8.06
58	002384	东山精密	99,399,103.78	7.95
59	002563	森马服饰	98,519,359.20	7.88
60	600161	天坛生物	98,491,069.22	7.88
61	600967	内蒙一机	98,295,514.07	7.86
62	600271	航天信息	98,241,344.81	7.86
63	600315	上海家化	98,015,528.15	7.84
64	000683	远兴能源	97,966,154.42	7.83
65	600765	中航重机	97,378,214.59	7.79
66	601636	旗滨集团	96,772,988.37	7.74
67	000039	中集集团	96,756,929.69	7.74
68	000050	深天马 A	96,338,055.01	7.70
69	688029	南微医学科技	95,962,790.01	7.67
70	600435	北方导航	95,601,866.45	7.64
71	601000	唐山港	94,718,104.75	7.57
72	002683	广东宏大	94,302,964.60	7.54
73	600517	国网英大	94,297,271.04	7.54
74	688819	天能电池集团 股份	93,269,429.02	7.46
75	600863	内蒙华电	93,172,329.80	7.45
76	688009	中国通号	92,081,292.13	7.36
77	688390	固德威电源	91,990,367.79	7.36
78	603456	九洲药业	91,906,415.86	7.35
79	002273	水晶光电	91,865,561.77	7.35
80	601665	齐鲁银行	91,292,193.71	7.30

81	000987	越秀资本	91,235,079.64	7.29
82	000887	中鼎股份	91,111,725.90	7.29
83	603858	步长制药	91,055,076.38	7.28
84	600879	航天电子	90,892,008.18	7.27
85	600623	华谊集团	90,096,712.88	7.20
86	603517	绝味食品	90,052,242.84	7.20
87	002465	海格通信	89,982,224.52	7.19
88	600699	均胜电子	89,504,594.62	7.16
89	000778	新兴铸管	89,327,508.71	7.14
90	601958	金钼股份	89,116,622.57	7.13
91	000967	盈峰环境	88,820,178.63	7.10
92	300861	美畅股份	88,524,471.55	7.08
93	000997	新大陆	88,340,832.33	7.06
94	002568	百润股份	88,337,020.53	7.06
95	002463	沪电股份	87,845,223.60	7.02
96	600369	西南证券	86,824,385.36	6.94
97	300009	安科生物	86,150,324.16	6.89
98	000636	风华高科	86,000,586.17	6.88
99	600050	中国联通	85,003,896.00	6.80
100	002423	中粮资本	84,948,227.00	6.79
101	603218	日月股份	84,889,482.17	6.79
102	600170	上海建工	84,797,962.39	6.78
103	000031	大悦城	84,260,260.47	6.74
104	600637	东方明珠	84,081,609.36	6.72
105	300115	长盈精密	83,794,481.94	6.70
106	601928	凤凰传媒	83,755,836.62	6.70
107	002500	山西证券	83,580,620.26	6.68
108	600160	巨化股份	83,456,653.04	6.67
109	600143	金发科技	83,346,240.50	6.66
110	600409	三友化工	83,328,977.54	6.66
111	600885	宏发股份	82,807,741.04	6.62
112	000729	燕京啤酒	82,695,399.40	6.61
113	002625	光启技术	82,523,704.04	6.60
114	688425	铁建重工	82,233,463.59	6.58
115	600109	国金证券	81,891,526.83	6.55
116	600398	海澜之家	81,778,677.45	6.54
117	601966	玲珑轮胎	81,683,577.92	6.53
118	601598	中国外运	81,384,855.58	6.51
119	000738	航发控制	80,985,835.34	6.48
120	000898	鞍钢股份	80,780,282.37	6.46
121	002138	顺络电子	80,746,395.65	6.46
122	600820	隧道股份	79,920,232.90	6.39
123	600642	申能股份	78,024,580.06	6.24

124	600325	华发股份	77,848,636.00	6.22
125	000400	许继电气	77,731,386.66	6.22
126	600927	永安期货	77,476,670.57	6.19
127	600598	北大荒	77,402,992.39	6.19
128	600655	豫园股份	77,310,266.72	6.18
129	600673	东阳光	77,187,320.48	6.17
130	600521	华海药业	75,980,347.42	6.08
131	002203	海亮股份	75,755,207.81	6.06
132	000060	中金岭南	75,630,321.91	6.05
133	600027	华电国际	75,618,194.88	6.05
134	600482	中国动力	75,595,587.00	6.04
135	002532	天山铝业	74,964,044.37	5.99
136	002985	北摩高科	74,786,620.14	5.98
137	603233	大参林	74,667,420.19	5.97
138	600390	五矿资本	74,575,604.70	5.96
139	000807	云铝股份	74,429,699.99	5.95
140	688208	道通科技	74,308,784.68	5.94
141	002373	千方科技	74,226,674.26	5.93
142	603345	安井食品	74,157,090.36	5.93
143	603236	移远通信	73,895,555.44	5.91
144	600597	光明乳业	72,585,388.62	5.80
145	002508	老板电器	72,391,181.58	5.79
146	300357	我武生物	72,259,032.15	5.78
147	601179	中国西电	72,129,723.57	5.77
148	603816	顾家家居	72,117,844.39	5.77
149	002531	天顺风能	71,913,714.73	5.75
150	603267	鸿远电子	71,782,990.00	5.74
151	600801	华新水泥	71,773,993.85	5.74
152	002572	索菲亚	71,436,430.71	5.71
153	600566	济川药业	71,094,719.96	5.68
154	000785	居然之家	70,724,429.26	5.65
155	300699	光威复材	70,433,156.10	5.63
156	600959	江苏有线	70,182,420.82	5.61
157	000513	丽珠集团	69,881,848.38	5.59
158	002938	鹏鼎控股	69,820,792.82	5.58
159	000932	华菱钢铁	69,589,621.22	5.56
160	603658	安图生物	69,224,888.50	5.54
161	601077	渝农商行	69,008,925.32	5.52
162	002244	滨江集团	68,613,502.55	5.49
163	600808	马钢股份	68,540,838.82	5.48
164	002081	金螳螂	68,535,886.10	5.48
165	600755	厦门国贸	67,823,223.39	5.42
166	600705	中航产融	67,069,835.00	5.36

167	002673	西部证券	67,026,487.90	5.36
168	300296	利亚德	66,945,913.81	5.35
169	603160	汇顶科技	66,444,267.71	5.31
170	000960	锡业股份	66,362,750.17	5.31
171	603719	良品铺子	66,138,909.94	5.29
172	002966	苏州银行	65,886,382.94	5.27
173	600985	淮北矿业	65,497,544.65	5.24
174	600839	四川长虹	65,022,025.22	5.20
175	600038	中直股份	65,001,212.23	5.20
176	002396	星网锐捷	64,726,718.44	5.18
177	002025	航天电器	64,383,843.01	5.15
178	600339	中油工程	64,096,180.62	5.12
179	000623	吉林敖东	63,997,540.07	5.12
180	600195	中牧股份	63,777,733.79	5.10
181	601298	青岛港	63,583,010.63	5.08
182	002372	伟星新材	63,281,236.55	5.06
183	002250	联化科技	62,971,142.90	5.03
184	002429	兆驰股份	62,906,468.86	5.03
185	600031	三一重工	62,736,855.00	5.02
186	600415	小商品城	62,633,368.06	5.01
187	600970	中材国际	62,409,126.16	4.99
188	300285	国瓷材料	61,867,811.00	4.95
189	688223	晶科能源	61,731,706.99	4.94
190	600718	东软集团	61,670,417.58	4.93
191	002600	领益智造	61,665,132.00	4.93
192	000021	深科技	61,495,131.31	4.92
193	000783	长江证券	61,402,378.00	4.91
194	600131	国网信通	60,966,227.88	4.87
195	002557	洽洽食品	60,753,700.45	4.86
196	600737	中粮糖业	60,324,951.41	4.82
197	600259	广晟有色	60,288,414.47	4.82
198	000563	陕国投 A	60,270,399.88	4.82
199	002294	信立泰	59,704,533.19	4.77
200	600583	海油工程	59,569,299.04	4.76
201	600487	亨通光电	59,562,083.90	4.76
202	000975	银泰黄金	59,403,649.48	4.75
203	600906	财达证券	59,208,741.77	4.73
204	603355	莱克电气	58,778,710.36	4.70
205	603939	益丰药房	58,200,247.38	4.65
206	600350	山东高速	58,107,695.11	4.65
207	300058	蓝色光标	58,077,524.88	4.64
208	002701	奥瑞金	58,013,636.45	4.64
209	300383	光环新网	57,935,867.62	4.63

210	600928	西安银行	57,692,974.95	4.61
211	600348	华阳股份	57,426,212.63	4.59
212	600862	中航高科	57,369,990.00	4.59
213	000725	京东方 A	56,923,828.00	4.55
214	601607	上海医药	56,700,563.65	4.53
215	002266	浙富控股	56,245,023.83	4.50
216	601611	中国核建	56,223,593.49	4.50
217	000750	国海证券	56,159,197.42	4.49
218	600418	江淮汽车	56,084,935.00	4.48
219	600873	梅花生物	55,969,374.02	4.48
220	002925	盈趣科技	55,667,748.05	4.45
221	601319	中国人保	55,570,011.14	4.44
222	601163	三角轮胎	55,352,792.13	4.43
223	000878	云南铜业	55,326,814.95	4.42
224	600299	安迪苏	55,239,507.62	4.42
225	002048	宁波华翔	55,226,386.57	4.42
226	600377	宁沪高速	55,121,443.39	4.41
227	600549	厦门钨业	54,949,526.06	4.39
228	601728	中国电信	54,753,924.73	4.38
229	300146	汤臣倍健	54,529,275.70	4.36
230	601600	中国铝业	54,482,806.83	4.36
231	000589	贵州轮胎	54,358,993.71	4.35
232	600529	山东药玻	54,327,674.22	4.34
233	600572	康恩贝	54,284,519.00	4.34
234	000830	鲁西化工	53,940,142.44	4.31
235	600782	新钢股份	53,750,367.96	4.30
236	603127	昭衍新药	53,389,632.86	4.27
237	600201	生物股份	53,308,822.24	4.26
238	002926	华西证券	52,610,044.69	4.21
239	600867	通化东宝	52,546,825.43	4.20
240	600704	物产中大	52,448,864.50	4.19
241	600977	中国电影	52,130,062.55	4.17
242	688002	睿创微纳	51,855,869.99	4.15
243	601456	国联证券	51,589,944.34	4.12
244	601666	平煤股份	51,481,377.76	4.12
245	600859	王府井	51,453,731.80	4.11
246	688234	天岳先进	51,091,229.87	4.09
247	603650	彤程新材	50,690,671.64	4.05
248	603613	国联股份	50,373,056.48	4.03
249	603056	德邦股份	50,036,908.87	4.00
250	002831	裕同科技	49,724,162.03	3.98
251	002705	新宝股份	49,611,215.97	3.97
252	002608	江苏国信	49,574,449.86	3.96

253	603866	桃李面包	49,529,255.96	3.96
254	600488	津药药业	49,493,924.00	3.96
255	688777	中控技术	49,432,607.11	3.95
256	300073	当升科技	49,423,715.50	3.95
257	601921	浙版传媒	49,179,243.14	3.93
258	002511	中顺洁柔	49,073,635.96	3.92
259	000598	兴蓉环境	48,944,637.00	3.91
260	000825	太钢不锈	48,903,857.92	3.91
261	002653	海思科	48,786,001.00	3.90
262	600664	哈药股份	48,767,164.39	3.90
263	003035	南网能源	48,709,080.71	3.89
264	600066	宇通客车	48,625,694.90	3.89
265	601997	贵阳银行	48,504,974.14	3.88
266	603893	瑞芯微	48,257,470.43	3.86
267	603596	伯特利	48,109,606.00	3.85
268	300433	蓝思科技	47,990,761.00	3.84
269	600500	中化国际	47,862,484.30	3.83
270	001914	招商积余	47,798,137.67	3.82
271	000883	湖北能源	46,963,950.16	3.76
272	603605	珀莱雅	46,847,367.48	3.75
273	002409	雅克科技	46,807,006.28	3.74
274	603868	飞科电器	46,393,647.67	3.71
275	601118	海南橡胶	46,065,770.79	3.68
276	002212	天融信	46,028,446.46	3.68
277	002110	三钢闽光	46,002,621.82	3.68
278	002444	巨星科技	45,768,437.00	3.66
279	300373	扬杰科技	45,645,304.94	3.65
280	002518	科士达	45,638,445.84	3.65
281	601106	中国一重	45,412,617.62	3.63
282	002223	鱼跃医疗	45,342,375.60	3.63
283	600998	九州通	45,267,287.30	3.62
284	600026	中远海能	45,213,633.00	3.62
285	603444	吉比特	45,175,470.24	3.61
286	002078	太阳纸业	44,728,209.03	3.58
287	000937	冀中能源	44,701,116.49	3.57
288	600531	豫光金铅	44,549,386.04	3.56
289	002111	威海广泰	44,522,227.40	3.56
290	300776	帝尔激光	43,747,631.28	3.50
291	600282	南钢股份	43,570,361.55	3.48
292	300482	万孚生物	43,174,078.18	3.45
293	688088	虹软科技	43,149,650.15	3.45
294	002468	申通快递	43,073,253.18	3.44
295	600825	新华传媒	42,964,167.00	3.44



296	688169	石头科技	42,598,199.26	3.41
297	000998	隆平高科	42,572,298.08	3.40
298	002284	亚太股份	42,428,515.00	3.39
299	300376	易事特	42,265,582.58	3.38
300	300012	华测检测	42,153,297.60	3.37
301	600511	国药股份	42,024,167.00	3.36
302	600167	联美控股	41,916,229.75	3.35
303	002901	大博医疗	41,533,891.08	3.32
304	600183	生益科技	41,425,299.17	3.31
305	601019	山东出版	41,223,500.00	3.30
306	600352	浙江龙盛	41,171,693.78	3.29
307	688099	晶晨半导体	41,013,388.35	3.28
308	600229	城市传媒	40,892,584.20	3.27
309	688779	长远锂科	40,881,525.28	3.27
310	300257	开山股份	40,479,086.36	3.24
311	300888	稳健医疗	40,358,929.60	3.23
312	002916	深南电路	40,293,868.02	3.22
313	002027	分众传媒	40,094,351.00	3.21
314	603299	苏盐井神	39,639,316.99	3.17
315	000402	金融街	39,258,012.25	3.14
316	688521	芯原微电子	39,165,325.64	3.13
317	000597	东北制药	39,104,990.20	3.13
318	603328	依顿电子	39,087,336.20	3.13
319	002540	亚太科技	39,031,441.72	3.12
320	688139	海尔生物	38,999,639.94	3.12
321	601399	国机重装	38,926,770.86	3.11
322	000045	深纺织 A	38,760,824.04	3.10
323	600728	佳都科技	38,670,227.08	3.09
324	600563	法拉电子	38,612,729.38	3.09
325	688187	时代电气	38,295,578.18	3.06
326	600114	东睦股份	38,281,625.95	3.06
327	601696	中银证券	37,934,927.00	3.03
328	688778	厦钨新能源	37,546,345.26	3.00
329	002419	天虹股份	36,827,738.86	2.94
330	002632	道明光学	36,797,527.00	2.94
331	603171	税友股份	36,683,323.99	2.93
332	603688	石英股份	36,674,830.90	2.93
333	600469	风神股份	36,445,181.82	2.91
334	000066	中国长城	36,351,557.00	2.91
335	300529	健帆生物	36,348,165.01	2.91
336	600966	博汇纸业	36,309,114.15	2.90
337	002867	周大生	36,307,446.42	2.90
338	002268	电科网安	36,283,221.00	2.90

339	000009	中国宝安	35,943,410.21	2.87
340	600216	浙江医药	35,870,530.93	2.87
341	600096	云天化	35,854,250.75	2.87
342	601699	潞安环能	35,842,698.80	2.87
343	688063	派能科技	35,816,480.67	2.86
344	300251	光线传媒	35,813,628.00	2.86
345	603737	三棵树	35,622,158.00	2.85
346	605358	立昂微	35,576,158.57	2.84
347	002215	诺普信	35,266,299.00	2.82
348	600594	益佰制药	34,967,444.83	2.80
349	600789	鲁抗医药	34,927,054.90	2.79
350	601872	招商轮船	34,785,031.52	2.78
351	600456	宝钛股份	34,712,719.09	2.78
352	002958	青农商行	34,494,150.00	2.76
353	002092	中泰化学	34,491,985.60	2.76
354	601568	北元集团	34,467,349.30	2.76
355	600748	上实发展	34,416,016.03	2.75
356	603589	口子窖	34,195,747.88	2.73
357	600764	中国海防	34,112,747.02	2.73
358	601137	博威合金	34,003,776.75	2.72
359	000852	石化机械	33,777,377.04	2.70
360	603708	家家悦	33,556,755.75	2.68
361	600483	福能股份	33,538,471.94	2.68
362	601003	柳钢股份	33,412,515.00	2.67
363	603707	健友股份	33,371,787.47	2.67
364	600329	达仁堂	33,283,383.73	2.66
365	301029	怡合达	33,254,864.02	2.66
366	300182	捷成股份	33,230,653.00	2.66
367	002603	以岭药业	33,106,293.63	2.65
368	601991	大唐发电	33,097,954.24	2.65
369	001203	大中矿业	32,929,278.77	2.63
370	600153	建发股份	32,707,068.73	2.62
371	300869	康泰医学	32,690,012.63	2.61
372	603993	洛阳钼业	32,581,621.83	2.61
373	600079	人福医药	32,404,297.00	2.59
374	600032	浙江新能	32,391,445.86	2.59
375	603712	七一二	32,384,334.39	2.59
376	601998	中信银行	32,135,842.74	2.57
377	601001	晋控煤业	32,054,566.21	2.56
378	600682	南京新百	32,003,401.00	2.56
379	002019	亿帆医药	31,931,496.41	2.55
380	601198	东兴证券	31,924,240.44	2.55
381	601992	金隅集团	31,872,152.00	2.55

382	002421	达实智能	31,684,103.00	2.53
383	000919	金陵药业	31,473,987.50	2.52
384	002073	软控股份	31,466,793.00	2.52
385	002312	川发龙蟒	31,373,257.00	2.51
386	600685	中船防务	31,161,632.00	2.49
387	688173	希荻微电子	31,077,659.77	2.48
388	002010	传化智联	31,041,596.04	2.48
389	300726	宏达电子	31,029,400.54	2.48
390	600754	锦江酒店	30,899,603.60	2.47
391	002454	松芝股份	30,858,178.68	2.47
392	000959	首钢股份	30,841,691.00	2.47
393	300072	海新能科	30,699,427.90	2.45
394	600155	华创云信	30,625,444.74	2.45
395	600006	东风汽车	30,618,968.30	2.45
396	600197	伊力特	30,002,568.64	2.40
397	600298	安琪酵母	29,995,754.12	2.40
398	300595	欧普康视	29,875,444.75	2.39
399	002430	杭氧股份	29,868,857.39	2.39
400	300476	胜宏科技	29,831,109.71	2.39
401	002624	完美世界	29,736,608.66	2.38
402	002064	华峰化学	29,628,543.00	2.37
403	300438	鹏辉能源	29,432,780.03	2.35
404	000576	甘化科工	29,323,839.00	2.34
405	603915	国茂股份	29,291,441.00	2.34
406	002390	信邦制药	29,220,375.28	2.34
407	002690	美亚光电	29,213,845.14	2.34
408	002757	南兴股份	29,158,311.56	2.33
409	000553	安道麦 A	29,036,311.51	2.32
410	000301	东方盛虹	29,004,419.00	2.32
411	601116	三江购物	28,972,502.60	2.32
412	300457	赢合科技	28,851,550.83	2.31
413	300377	赢时胜	28,684,543.00	2.29
414	002206	海利得	28,552,130.70	2.28
415	002017	东信和平	28,340,420.10	2.27
416	600210	紫江企业	28,280,758.55	2.26
417	002919	名臣健康	28,175,938.18	2.25
418	603118	共进股份	28,131,812.00	2.25
419	603103	横店影视	28,105,976.40	2.25
420	603379	三美股份	28,070,570.11	2.24
421	601016	节能风电	28,066,376.86	2.24
422	002368	太极股份	27,946,646.88	2.23
423	601567	三星医疗	27,911,062.94	2.23
424	300759	康龙化成	27,871,341.63	2.23

425	000950	重药控股	27,822,326.00	2.22
426	603305	旭升集团	27,806,639.78	2.22
427	000703	恒逸石化	27,695,136.25	2.21
428	688107	安路科技	27,660,951.02	2.21
429	300253	卫宁健康	27,597,295.31	2.21
430	688276	长春百克生物 科技	27,383,190.63	2.19
431	600797	浙大网新	27,349,743.00	2.19
432	603927	中科软	27,203,633.56	2.18
433	603638	艾迪精密	27,132,744.87	2.17
434	688318	财富趋势	27,124,736.40	2.17
435	002434	万里扬	27,118,774.00	2.17
436	601158	重庆水务	27,113,329.00	2.17
437	600351	亚宝药业	27,006,965.00	2.16
438	002145	中核钛白	26,934,431.63	2.15
439	688072	拓荆科技	26,833,892.84	2.15
440	002408	齐翔腾达	26,819,001.40	2.14
441	601187	厦门银行	26,586,376.00	2.13
442	600556	天下秀	26,354,901.00	2.11
443	000999	华润三九	26,259,594.90	2.10
444	600105	永鼎股份	26,188,698.14	2.09
445	688185	康希诺生物	26,147,143.92	2.09
446	002004	华邦健康	26,089,196.81	2.09
447	002399	海普瑞	25,853,312.64	2.07
448	002519	银河电子	25,725,764.90	2.06
449	601866	中远海发	25,628,203.00	2.05
450	002353	杰瑞股份	25,615,511.00	2.05
451	688707	振华新材料	25,357,240.72	2.03
452	600141	兴发集团	25,208,826.00	2.02
453	300194	福安药业	25,170,992.13	2.01
454	600739	辽宁成大	25,155,425.50	2.01
455	601778	晶科科技	25,079,227.00	2.01
456	600020	中原高速	25,063,700.70	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	38,019,458,873.52
卖出股票收入（成交）总额	36,982,054,103.23

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

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

## 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

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

## 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西部证券股份有限公司，2023 年 9 月因投行业务违规，被证监会处以责令改正的处罚。

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

### 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	1,435,315.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,780,876.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,216,192.12

### 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## § 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 500 指数增强 A	555,927	2,721.79	374,484,054.68	24.75%	1,138,631,053.61	75.25%
国泰君安中证 500 指数增强 C	13,938	77,670.92	749,369,041.57	69.22%	333,208,247.54	30.78%
合计	569,865	4,554.93	1,123,853,096.25	43.30%	1,471,839,301.15	56.70%

### 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 500 指数增强 A	2,954,935.52	0.1953%
	国泰君安中证 500 指数增强 C	2,418,728.53	0.2234%
	合计	5,373,664.05	0.2070%

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 500 指数增强 A	>100
	国泰君安中证 500 指数增强 C	50~100
	合计	>100

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

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 500 指数增强 A	国泰君安中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2021 年 12 月 15 日）基金份额总额	720,641,928.72	440,062,218.02
本报告期期初基金份额总额	855,925,363.63	536,328,911.72
本报告期基金总申购份额	1,246,215,133.48	1,521,866,939.66
减：本报告期基金总赎回份额	589,025,388.82	975,618,562.27
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	1,513,115,108.29	1,082,577,289.11

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、本报告期内本基金托管人重大人事变动如下：

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



### 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 5 万元人民币。其为本基金提供审计服务的连续年限为自 2021 年 12 月 15 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	74,989,407,044.99	100.00%	5,346,233.26	100.00%	-

### 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	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在直销柜台开展申购费率优惠活动的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2023-01-14
2	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-01-20
3	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2022 年 4 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-01-20
4	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-03-31
5	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-03-31
6	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于完成公司法定代表人变更登记的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2023-04-08
7	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下产品参与直销 APP 费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2023-04-17
8	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年 1 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-04-22
9	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-04-23
10	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金 A 类基金份额在直销柜台开展赎回费率优惠活动的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2023-06-16
11	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
12	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
13	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

14	国泰君安中证 500 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
15	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
16	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
17	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
18	国泰君安中证 500 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
19	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
20	国泰君安中证 500 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
21	国泰君安中证 500 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	2023-12-14
22	国泰君安中证 500 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	2023-12-14
23	国泰君安中证 500 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	2023-12-14

## § 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、中国证监会准予国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、法律意见书；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

### 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