

# 国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

## 2023 年年度报告

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:上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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04月19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	8
2.5 其他相关资料	8
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	16
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 .....	16
<b>§ 5 托管人报告 .....</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	17
<b>§ 6 审计报告 .....</b>	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	17
6.2 审计报告的基本内容 .....	17
<b>§ 7 年度财务报表 .....</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表 .....	19
7.2 利润表 .....	21
7.3 净资产变动表 .....	23
7.4 报表附注 .....	24
<b>§ 8 投资组合报告 .....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	46
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 .....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	57
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 .....	57
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 .....	57

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 .....	58
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 .....	58
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	58
8.12 投资组合报告附注 .....	58
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>59</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
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 .....	60
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	60
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>60</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>61</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
11.4 基金投资策略的改变 .....	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
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 .....	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8 其他重大事件 .....	62
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>63</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 .....	64

12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	64
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>64</b>
13.1 备查文件目录 .....	64
13.2 存放地点 .....	65
13.3 查阅方式 .....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	国泰君安沪深 300 指数增强发起	
基金主代码	018257	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 04 月 19 日	
基金管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	170,985,415.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C
下属分级基金的交易代码	018257	018258
报告期末下属分级基金的份额总额	64,205,788.82 份	106,779,627.00 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金为增强型指数产品，在标的指数成份券权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。如果标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照份额持有人利益优先原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。</p> <p>本基金的投资策略包括股票投资策略、债券投资策略、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略、资产支持证券投资策略、参与股指期货交易策略、参与国债期货交易策略、融资及转融通证券出借业务投资策略。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

	本基金通过指数化投资，争取获得与标的指数相似的总回报，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	--

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海国泰君安证券资产管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	朱萍
	联系电话	021-38676022	021-31888888
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		95521	95528
传真		021-38871190	021-63602540
注册地址		上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室	上海市中山东一路 12 号
办公地址		上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		200120	200126
法定代表人		陶耿	张为忠

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金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 04 月 19 日（基金合同生效日）-2023 年 12 月 31 日	
	国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C
本期已实现收益	-4,055,049.28	-6,383,571.28
本期利润	-4,978,624.97	-8,072,921.83
加权平均基金份额本期利润	-0.1452	-0.1650
本期加权平均净值利润率	-15.67%	-17.92%
本期基金份额净值增长率	-11.60%	-11.85%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	
期末可供分配利润	-7,448,070.37	-12,650,444.47
期末可供分配基金份额利润	-0.1160	-0.1185
期末基金资产净值	56,757,718.45	94,129,182.53
期末基金份额净值	0.8840	0.8815
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	
基金份额累计净值增长率	-11.60%	-11.85%

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

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 国泰君安沪深 300 指数增强发起 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.94%	0.73%	-6.65%	0.75%	-0.29%	-0.02%
过去六个月	-9.40%	0.79%	-10.17%	0.81%	0.77%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-11.60%	0.77%	-16.73%	0.81%	5.13%	-0.04%

#### 国泰君安沪深 300 指数增强发起 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.03%	0.73%	-6.65%	0.75%	-0.38%	-0.02%
过去六个月	-9.58%	0.79%	-10.17%	0.81%	0.59%	-0.02%

自基金合同生效起至今	-11.85%	0.77%	-16.73%	0.81%	4.88%	-0.04%
------------	---------	-------	---------	-------	-------	--------

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

国泰君安沪深300指数增强发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2023年04月19日-2023年12月31日)



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

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

国泰君安沪深300指数增强发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2023年04月19日-2023年12月31日)



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

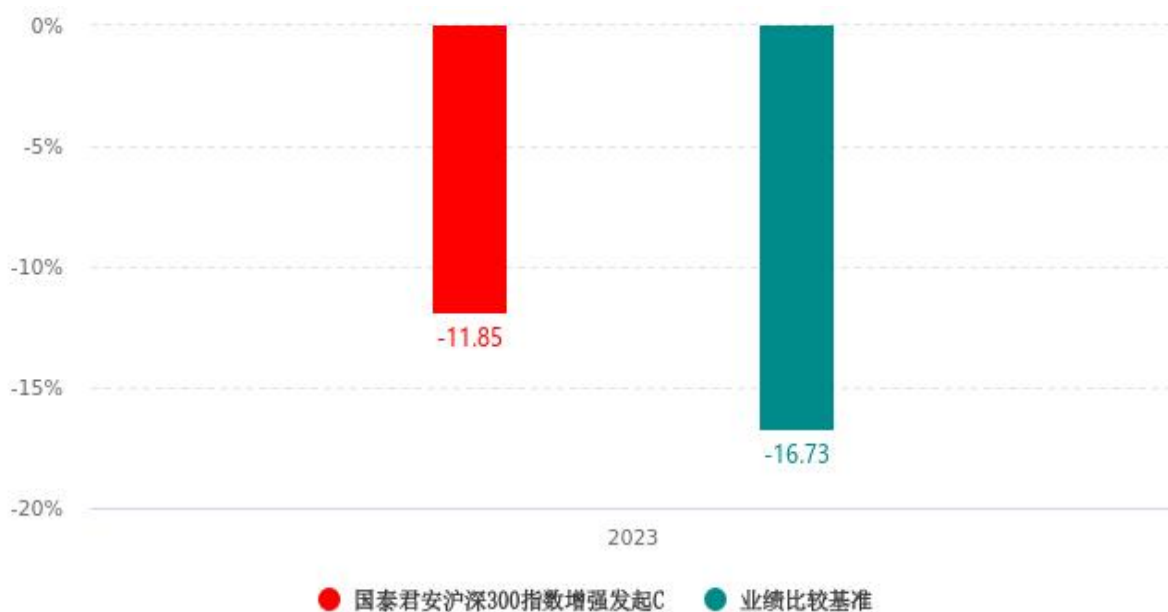
2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比

例符合基金合同的有关约定。

### 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：2023 年按实际存续期计算。



注：2023 年按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金未进行利润分配。

## § 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。	2023-04-19	-	12 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士，12 年证券从业经验，具备基金从业资格。曾任香港科技大学人工智能实验室访问学者，其后加盟方正证券研究所、国泰君安证券咨询部及研究所从事量化对冲模型的研发工作，2014 年加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，先后在量化投资部、权益与衍生品部担任高级投资经理，从事量化投资和策略研发工作，在 Alpha 量化策略以及基于机器学习的投资方面有独到且深入的研究。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部总经理，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，消费板块表现疲软。房地产行业在 2023 年获得显著的政策支持，但是由于实际的去化和债务问题，行业表现不及预期。展望 2024 年，科技成长板块和高技术制造业估值已经处于低位，加上持续的政策支持，有不错的成长机会。政策的发力方向仍然会持续在地产和科创上，同时以大宗消费、文旅消费为抓手的扩内需政策将继续推进。

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

从沪深 300 指数当前的估值水平来看，截至四季度其加权 PE 和整体 PE 分别在 11 倍和 8 倍左右，依然处于历史较为低估的水平，整体 PE 在历史上的分位数低于 5%，而用整体 PB 估值的话，则历史分位数更低，处于历史分位数 3% 之内。从业绩的可持续角度来看，估值进一步向下的空间要显著小于向上的空间。未来随着经济的全面逐步复苏，有望迎来估值和盈利的双击。我们认为做为一个大盘成长和大盘价值股的代表，沪深 300 指数从长期来看依然有其特殊的配置价值。

随着 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，且市场热点依然较为分散，相对于主观选股来说，量化投资仍具有很高的性价比。尽管市场风格和行业走势会发生变化，但我们仍将坚持一贯的投资理念和投资组合管理体系。在本基金中，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高频量价信号，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沪深 300 指数。由于基本面量化和高频量价在

信号层面较低的相关性，我们相信能够在兼顾两者的情况下追求稳健的 Alpha。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。我们认为沪深 300 指数当前整体估值低于历史均值，是中国核心资产的最好的代表，从中长期维度指数未来上涨的空间依然大于下跌的空间，我们将努力通过科学的手段增强量化模型的超额收益率水平，以此不断为客户增厚投资收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安沪深 300 指数增强发起 A 基金份额净值为 0.8840 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.60%，同期业绩比较基准收益率为-16.73%；截至报告期末国泰君安沪深 300 指数增强发起 C 基金份额净值为 0.8815 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-11.85%，同期业绩比较基准收益率为-16.73%。

#### 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，大盘成长股有望迎来显著的修复性行情。沪深 300 指数作为市场当前核心的典型代表，经过过去几年成分股的不断调整，其大盘成长的属性已不断提升，而且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，中证 500 和中证 1000 逐步成为量化的主战场，反而缓解了沪深 300 成分股的拥挤度，在沪深 300 上博取超额收益的难度有望持续改善。立足当前，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，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、成分股有针对性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

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



## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

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

## § 6 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 21326 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	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“国泰君安沪深 300 指数增强发起基金”)的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年 04 月 19

	<p>日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间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沪深 300 指数增强发起基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 04 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间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沪深 300 指数增强发起基金,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>国泰君安沪深 300 指数增强发起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沪深 300 指数增强发起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沪深 300 指数增强发起基金、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沪深 300 指数增强发起基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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>(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风</p>

	<p>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，就可能对导致对国泰君安沪深 300 指数增强发起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沪深 300 指数增强发起基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	薛竞 段黄霖
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2024-03-25

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
货币资金	7.4.7.1	9,173,073.58
结算备付金		890,661.07

存出保证金		249,729.48
交易性金融资产	7.4.7.2	140,626,531.14
其中：股票投资		140,626,531.14
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		170,134.33
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		151,110,129.60
<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>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		21,276.29

应付管理人报酬		123,205.59
应付托管费		18,480.84
应付销售服务费		30,261.14
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	30,004.76
负债合计		223,228.62
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.7	170,985,415.82
未分配利润	7.4.7.8	-20,098,514.84
净资产合计		150,886,900.98
负债和净资产总计		151,110,129.60

注：1. 报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 170,985,415.82 份，其中国泰君安沪深 300 指数增强 A 类基金份额净值 0.884 元，基金份额 64,205,788.82 份；国泰君安沪深 300 指数增强 C 类基金份额净值 0.8815 元，基金份额 106,779,627.00 份。2. 本财务报表的实际编制期间为 2023 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-12,278,875.96
1. 利息收入		14,497.38

其中：存款利息收入	7.4.7.9	14,497.38
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-9,688,371.23
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-9,659,256.46
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	-709,886.37
股利收益	7.4.7.12	680,771.60
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	-2,612,926.24
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	7,924.13
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>772,670.84</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	536,639.10
2. 托管费	7.4.10.2.2	80,495.90
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	125,135.84
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		-

8. 其他费用	7. 4. 7. 15	30,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,051,546.80
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,051,546.80
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-13,051,546.80

注：本基金合同生效日为 2023 年 4 月 19 日，无上年度同期对比数据。

### 7.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	15,019,999.00	-	15,019,999.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	155,965,416.82	-20,098,514.84	135,866,901.98
（一）、综合收益总额	-	-13,051,546.80	-13,051,546.80
（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）	155,965,416.82	-7,046,968.04	148,918,448.78
其中：1. 基金申购款	177,106,179.47	-8,916,972.52	168,189,206.95
2. 基金赎回款	-21,140,762.65	1,870,004.48	-19,270,758.17
（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	170,985,415.82	-20,098,514.84	150,886,900.98

注：本基金合同生效日为 2023 年 4 月 19 日，无上年度同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 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

国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]568 号《关于准予国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由上海国泰君安证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 15,019,999.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0237 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 15,019,999.00 份,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购费、申购费,但不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资者认购、申购时不收取认购费、申购费,而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 15,019,000.00 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数的成份券(包括存托凭证、下同)、备选成份券(包括存托凭证、下同)、其他国内依法发行上市的股票和存托凭证(包括主板、创业板和其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转换债)、可交换债、公开发行的次级债、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、中期票据等)、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票、存托凭证资产的比例不低于基金资产的 80%,投资于沪深 300 指数成份券及其备选成份券的资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,待履行适当程序后,以变更后的规定为准。



本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

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》、《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 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 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为 2023 年 4 月 19 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。(1)金融资产金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。债务工具本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具,分别采用以下两种方式进行计量:以摊余成本计量:本基金管理以摊余成本计

量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。以公允价值计量且其变动计入当期损益：本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。权益工具权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。(2)金融负债金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。(3)衍生金融工具本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	3,532,213.11
等于：本金	3,531,581.23

加：应计利息	631.88
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	5,640,860.47
等于：本金	5,640,569.60
加：应计利息	290.87
减：坏账准备	-
合计	9,173,073.58

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	143,288,323.63	-	140,626,531.14	-2,661,792.49
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	143,288,323.63	-	140,626,531.14	-2,661,792.49

#### 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	2,015,013.75	0.00	-	-

股指期货	2,015,013.75	0.00	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,015,013.75	-	-	-

#### 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
IF2401	IF2401	2	2,063,880.00	48,866.25
合计				48,866.25
减：可抵销期货暂收款				48,866.25
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

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

##### 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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4.76
应付证券出借违约金	-



应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	30,000.00
合计	30,004.76

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 国泰君安沪深 300 指数增强发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	10,009,999.00	10,009,999.00
本期申购	54,976,931.99	54,976,931.99
本期赎回（以“-”号填列）	-781,142.17	-781,142.17
本期末	64,205,788.82	64,205,788.82

##### 国泰君安沪深 300 指数增强发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	5,010,000.00	5,010,000.00
本期申购	122,129,247.48	122,129,247.48
本期赎回（以“-”号填列）	-20,359,620.48	-20,359,620.48
本期末	106,779,627.00	106,779,627.00

注：1. 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。2. 本基金自 2023 年 04 月 17 日至 2023 年 04 月 17 日止公开发售，共募集有效净认购资金人民币 15,019,999.00 元，折合为 15,019,999.00 份基金份额（其中 A 类基金份额 10,009,999.00 份，C 类基金份额 5,010,000.00 份）。本基金在募集期间未产生利息折份额。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 国泰君安沪深 300 指数增强发起 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-4,055,049.28	-923,575.69	-4,978,624.97

本期基金份额交易产生的变动数	-439,639.25	-2,029,806.15	-2,469,445.40
其中：基金申购款	-464,925.45	-2,069,956.30	-2,534,881.75
基金赎回款	25,286.20	40,150.15	65,436.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,494,688.53	-2,953,381.84	-7,448,070.37

**国泰君安沪深 300 指数增强发起 C**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-6,383,571.28	-1,689,350.55	-8,072,921.83
本期基金份额交易产生的变动数	-1,359,722.02	-3,217,800.62	-4,577,522.64
其中：基金申购款	-2,080,945.37	-4,301,145.40	-6,382,090.77
基金赎回款	721,223.35	1,083,344.78	1,804,568.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,743,293.30	-4,907,151.17	-12,650,444.47

**7.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	5,417.75
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	7,668.96
结算备付金利息收入	1,410.67
其他	-
合计	14,497.38

#### 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 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	743,137,591.27
减：卖出股票成本总额	752,131,948.44
减：交易费用	664,899.29
买卖股票差价收入	-9,659,256.46

#### 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 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-701,046.25
减：交易费用	8,840.12
合计	-709,886.37

#### 7.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	680,771.60
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	680,771.60

#### 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 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-2,661,792.49
——股票投资	-2,661,792.49
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	48,866.25
——权证投资	-
——期货投资	48,866.25

3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,612,926.24

#### 7.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	7,924.13
合计	7,924.13

#### 7.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
证券账户开户费	400.00
合计	30,400.00

#### 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
上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦东发展银行”)	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君安证券”)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券	1,638,545,167.34	100.00%

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内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

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）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	116,821.12	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 04 月 19 日（基金合同生效日）至
----	-------------------------------

	2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	536,639.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	47,799.37
应支付基金管理人的净管理费	488,839.73

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$  H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。2. 本基金于 2023 年 4 月 19 日合同生效，无上年度同期可比数据。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	80,495.90

注：1. 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$  H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。2. 本基金于 2023 年 4 月 19 日合同生效，无上年度同期可比数据。

#### 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 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C	合计
国泰君安资管	-	95,735.51	95,735.51
国泰君安证券	-	2,015.47	2,015.47
合计	-	97,750.98	97,750.98

注：1. 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。销售服务费计算方法如下： $H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$  H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。2. 本基金于 2023 年 4 月 19 日合同生效，无上年度同期可比数据。

#### 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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国泰君安沪深 300 指数增强发起 A

份额单位：份

项目	本期 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2023 年 04 月 19 日）持有的基金份额	10,009,000.00
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	20,963,312.37
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	30,972,312.37
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	48.24%

国泰君安沪深 300 指数增强发起 C

份额单位：份

项目	本期 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2023 年 04 月 19 日）持有的基金份额	5,010,000.00
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	5,010,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.69%

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 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入

国泰君安证券	5,640,860.47	7,668.96
浦东发展银行	3,532,213.11	5,417.75

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，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

本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须做说明的其他关联方交易事项。

#### 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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

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

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

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

于 2023 年 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	9,173,073.58	-	-	-	9,173,073.58

结算备付金	890,661.07	-	-	-	890,661.07
存出保证金	249,729.48	-	-	-	249,729.48
交易性金融资产	-	-	-	140,626,531.14	140,626,531.14
应收申购款	-	-	-	170,134.33	170,134.33
资产总计	10,313,464.13	-	-	140,796,665.47	151,110,129.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	21,276.29	21,276.29
应付管理人报酬	-	-	-	123,205.59	123,205.59
应付托管费	-	-	-	18,480.84	18,480.84
应付销售服务费	-	-	-	30,261.14	30,261.14
其他负债	-	-	-	30,004.76	30,004.76
负债总计	-	-	-	223,228.62	223,228.62
利率敏感度缺口	10,313,464.13	-	-	140,573,436.85	150,886,900.98

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%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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
----	----------------------

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	140,626,531.14	93.20
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	140,626,531.14	93.20

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 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

于 2023 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

#### 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
第一层次	140,626,531.14
第二层次	-
第三层次	-
合计	140,626,531.14

###### 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

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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	140,626,531.14	93.06
	其中：股票	140,626,531.14	93.06
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	10,063,734.65	6.66
8	其他各项资产	419,863.81	0.28

9	合计	151,110,129.60	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	-	-
B	采矿业	6,344,322.00	4.20
C	制造业	68,480,075.70	45.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,852,614.00	1.89
E	建筑业	3,853,629.00	2.55
F	批发和零售业	103,726.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	134,841.00	0.09
H	住宿和餐饮业	173,420.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,895,142.00	3.91
J	金融业	23,630,770.73	15.66
K	房地产业	39,748.00	0.03
L	租赁和商务服务业	1,171,727.00	0.78
M	科学研究和技术服务业	1,804,448.00	1.20
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	694,498.00	0.46
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	115,178,961.43	76.33

### 8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	88,880.00	0.06
C	制造业	18,526,415.11	12.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,260,553.00	0.84
E	建筑业	367,334.00	0.24
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,852,719.00	1.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,278,795.60	0.85
J	金融业	1,723,017.00	1.14
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	349,856.00	0.23
S	综合	-	-
	合计	25,447,569.71	16.87

### 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	600519	贵州茅台	4,100	7,076,600.00	4.69
2	300750	宁德时代	19,989	3,263,404.14	2.16
3	601318	中国平安	60,700	2,446,210.00	1.62
4	000725	京东方 A	567,200	2,212,080.00	1.47
5	000100	TCL 科技	503,500	2,165,050.00	1.43
6	600036	招商银行	75,700	2,105,974.00	1.40
7	002415	海康威视	58,500	2,031,120.00	1.35
8	600050	中国联通	436,900	1,913,622.00	1.27
9	603259	药明康德	24,800	1,804,448.00	1.20
10	000338	潍柴动力	127,500	1,740,375.00	1.15
11	601998	中信银行	318,700	1,685,923.00	1.12
12	601633	长城汽车	62,600	1,578,772.00	1.05
13	000651	格力电器	48,700	1,566,679.00	1.04
14	601600	中国铝业	271,500	1,531,260.00	1.01
15	603993	洛阳钼业	293,700	1,527,240.00	1.01
16	601766	中国中车	282,400	1,485,424.00	0.98
17	002916	深南电路	20,500	1,455,295.00	0.96
18	002142	宁波银行	69,932	1,406,332.52	0.93
19	600132	重庆啤酒	21,100	1,402,095.00	0.93
20	600028	中国石化	247,100	1,378,818.00	0.91
21	600887	伊利股份	51,400	1,374,950.00	0.91
22	000568	泸州老窖	7,600	1,363,592.00	0.90
23	600584	长电科技	44,300	1,322,798.00	0.88

24	600438	通威股份	51,600	1,291,548.00	0.86
25	601857	中国石油	182,900	1,291,274.00	0.86
26	601668	中国建筑	265,400	1,276,574.00	0.85
27	601390	中国中铁	223,200	1,267,776.00	0.84
28	600745	闻泰科技	29,300	1,239,683.00	0.82
29	601288	农业银行	334,200	1,216,488.00	0.81
30	600276	恒瑞医药	26,500	1,198,595.00	0.79
31	600309	万华化学	15,300	1,175,346.00	0.78
32	601878	浙商证券	110,300	1,150,429.00	0.76
33	601985	中国核电	148,800	1,116,000.00	0.74
34	002601	龙佰集团	64,700	1,108,311.00	0.73
35	600030	中信证券	54,300	1,106,091.00	0.73
36	002007	华兰生物	49,400	1,093,222.00	0.72
37	601398	工商银行	223,300	1,067,374.00	0.71
38	601728	中国电信	195,300	1,056,573.00	0.70
39	601899	紫金矿业	84,300	1,050,378.00	0.70
40	002001	新和成	61,600	1,044,736.00	0.69
41	000858	五粮液	7,300	1,024,263.00	0.68
42	600900	长江电力	42,700	996,618.00	0.66
43	601319	中国人保	204,200	988,328.00	0.66
44	600362	江西铜业	53,900	962,654.00	0.64
45	600690	海尔智家	45,700	959,700.00	0.64
46	600875	东方电气	64,100	937,142.00	0.62
47	000001	平安银行	99,400	933,366.00	0.62
48	002555	三七互娱	49,400	929,214.00	0.62
49	300433	蓝思科技	69,200	913,440.00	0.61
50	000617	中油资本	168,100	907,740.00	0.60
51	600150	中国船舶	30,200	889,088.00	0.59
52	000063	中兴通讯	33,500	887,080.00	0.59
53	601877	正泰电器	40,800	877,608.00	0.58
54	002938	鹏鼎控股	36,400	812,448.00	0.54
55	601888	中国中免	9,500	795,055.00	0.53
56	600016	民生银行	209,000	781,660.00	0.52
57	600019	宝钢股份	130,600	774,458.00	0.51
58	601688	华泰证券	54,900	765,855.00	0.51
59	601169	北京银行	167,700	759,681.00	0.50
60	601818	光大银行	258,400	749,360.00	0.50
61	601988	中国银行	185,800	741,342.00	0.49
62	688396	华润微电子	16,500	737,385.00	0.49
63	601939	建设银行	107,011	696,641.61	0.46
64	688111	金山办公	2,200	695,640.00	0.46
65	300015	爱尔眼科	43,900	694,498.00	0.46
66	000800	一汽解放	80,300	682,550.00	0.45



67	603833	欧派家居	9,800	682,178.00	0.45
68	300628	亿联网络	22,400	661,920.00	0.44
69	000938	紫光股份	33,000	638,550.00	0.42
70	002736	国信证券	72,200	616,588.00	0.41
71	601800	中国交建	81,100	616,360.00	0.41
72	002202	金风科技	75,000	600,000.00	0.40
73	002304	洋河股份	5,400	593,460.00	0.39
74	000661	长春高新	4,000	583,200.00	0.39
75	601328	交通银行	101,300	581,462.00	0.39
76	601238	广汽集团	66,100	578,375.00	0.38
77	300999	金龙鱼	17,300	577,474.00	0.38
78	688187	时代电气	15,772	572,996.76	0.38
79	601615	明阳智能	45,300	568,062.00	0.38
80	600489	中金黄金	55,200	549,792.00	0.36
81	600346	恒力石化	41,500	546,555.00	0.36
82	603369	今世缘	11,000	536,250.00	0.36
83	600104	上汽集团	38,900	526,317.00	0.35
84	600918	中泰证券	74,100	508,326.00	0.34
85	600015	华夏银行	90,000	505,800.00	0.34
86	002236	大华股份	26,300	485,235.00	0.32
87	000333	美的集团	8,700	475,281.00	0.31
88	300454	深信服	6,500	469,885.00	0.31
89	600332	白云山	16,000	457,600.00	0.30
90	688599	天合光能	15,500	442,215.00	0.29
91	600188	兖矿能源	21,600	427,896.00	0.28
92	002493	荣盛石化	41,200	426,420.00	0.28
93	600958	东方证券	48,668	423,411.60	0.28
94	601788	光大证券	27,100	417,882.00	0.28
95	003816	中国广核	131,600	409,276.00	0.27
96	603659	璞泰来	19,400	406,042.00	0.27
97	600372	中航机载	30,000	395,400.00	0.26
98	600436	片仔癀	1,600	387,184.00	0.26
99	600570	恒生电子	13,400	385,384.00	0.26
100	600183	生益科技	20,700	379,017.00	0.25
101	002027	分众传媒	59,600	376,672.00	0.25
102	002594	比亚迪	1,800	356,400.00	0.24
103	601669	中国电建	71,400	349,146.00	0.23
104	600795	国电电力	79,500	330,720.00	0.22
105	600741	华域汽车	20,000	325,600.00	0.22
106	601601	中国太保	13,600	323,408.00	0.21
107	300450	先导智能	12,400	317,440.00	0.21
108	600426	华鲁恒升	11,500	317,285.00	0.21
109	601138	工业富联	20,900	316,008.00	0.21

110	002129	TCL 中环	20,200	315,928.00	0.21
111	600219	南山铝业	104,900	308,406.00	0.20
112	600176	中国巨石	29,200	287,036.00	0.19
113	601186	中国铁建	36,900	280,809.00	0.19
114	000538	云南白药	5,600	275,240.00	0.18
115	603806	福斯特	10,800	262,116.00	0.17
116	600893	航发动力	6,800	254,184.00	0.17
117	002179	中航光电	6,500	253,500.00	0.17
118	688036	传音控股	1,818	251,611.20	0.17
119	300014	亿纬锂能	5,600	236,320.00	0.16
120	600406	国电南瑞	10,000	223,200.00	0.15
121	601989	中国重工	51,200	211,456.00	0.14
122	603260	合盛硅业	4,100	209,100.00	0.14
123	000425	徐工机械	35,300	192,738.00	0.13
124	300919	中伟股份	3,900	191,607.00	0.13
125	600600	青岛啤酒	2,500	186,875.00	0.12
126	600919	江苏银行	27,600	184,644.00	0.12
127	600089	特变电工	12,900	178,020.00	0.12
128	688223	晶科能源	19,900	176,314.00	0.12
129	600754	锦江酒店	5,800	173,420.00	0.11
130	601100	恒立液压	2,900	158,572.00	0.11
131	600999	招商证券	11,000	150,040.00	0.10
132	600585	海螺水泥	6,500	146,640.00	0.10
133	000596	古井贡酒	600	139,680.00	0.09
134	002311	海大集团	3,100	139,221.00	0.09
135	002410	广联达	8,000	137,120.00	0.09
136	002648	卫星化学	8,900	131,275.00	0.09
137	002459	晶澳科技	6,300	130,536.00	0.09
138	601628	中国人寿	4,400	124,740.00	0.08
139	600547	山东黄金	5,200	118,924.00	0.08
140	000157	中联重科	18,200	118,846.00	0.08
141	600760	中航沈飞	2,620	110,511.60	0.07
142	002271	东方雨虹	5,700	109,440.00	0.07
143	601006	大秦铁路	15,100	108,871.00	0.07
144	601607	上海医药	6,200	103,726.00	0.07
145	600926	杭州银行	10,100	101,101.00	0.07
146	601166	兴业银行	5,700	92,397.00	0.06
147	601838	成都银行	6,100	68,686.00	0.05
148	002252	上海莱士	8,400	67,200.00	0.04
149	601117	中国化学	9,900	62,964.00	0.04
150	600588	用友网络	3,400	60,486.00	0.04
151	000002	万科 A	3,800	39,748.00	0.03
152	603288	海天味业	1,000	37,950.00	0.03

153	600196	复星医药	1,400	35,042.00	0.02
154	000792	盐湖股份	2,100	33,495.00	0.02
155	600018	上港集团	5,300	25,970.00	0.02
156	300496	中科创达	300	24,018.00	0.02
157	601658	邮储银行	5,400	23,490.00	0.02

### 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	002152	广电运通	75,000	919,500.00	0.61
2	000987	越秀资本	138,400	833,168.00	0.55
3	600966	博汇纸业	121,500	754,515.00	0.50
4	600867	通化东宝	60,700	657,381.00	0.44
5	002913	奥士康	21,000	643,650.00	0.43
6	601952	苏垦农发	61,500	629,760.00	0.42
7	002204	大连重工	129,800	593,186.00	0.39
8	002600	领益智造	86,500	584,740.00	0.39
9	600578	京能电力	196,300	581,048.00	0.39
10	002946	新乳业	49,200	564,816.00	0.37
11	600623	华谊集团	87,500	563,500.00	0.37
12	002745	木林森	61,800	535,188.00	0.35
13	000582	北部湾港	67,900	509,929.00	0.34
14	002673	西部证券	72,700	463,099.00	0.31
15	600872	中炬高新	16,400	460,840.00	0.31
16	000729	燕京啤酒	49,100	423,733.00	0.28
17	000597	东北制药	78,600	420,510.00	0.28
18	600582	天地科技	74,500	405,280.00	0.27
19	000650	仁和药业	61,000	404,430.00	0.27
20	002614	奥佳华	51,200	384,000.00	0.25
21	600664	哈药股份	114,000	381,900.00	0.25
22	600717	天津港	89,800	369,078.00	0.24
23	601399	国机重装	129,800	367,334.00	0.24
24	600637	东方明珠	47,900	360,208.00	0.24
25	002390	信邦制药	80,100	355,644.00	0.24
26	002206	海利得	70,200	352,404.00	0.23
27	688819	天能电池集团 股份	11,527	321,833.84	0.21
28	601139	深圳燃气	46,600	321,074.00	0.21
29	603317	天味食品	23,600	313,644.00	0.21
30	600096	云天化	19,800	308,880.00	0.20
31	601018	宁波港	84,400	300,464.00	0.20

32	300682	朗新集团	18,100	296,659.00	0.20
33	600498	烽火通信	17,800	296,192.00	0.20
34	600409	三友化工	50,900	279,441.00	0.19
35	601216	君正集团	74,300	277,882.00	0.18
36	600812	华北制药	47,800	272,460.00	0.18
37	600798	宁波海运	72,300	264,618.00	0.18
38	600696	岩石股份	14,600	262,654.00	0.17
39	688009	中国通号	56,801	248,788.38	0.16
40	000959	首钢股份	69,800	241,508.00	0.16
41	300102	乾照光电	30,600	224,910.00	0.15
42	601949	中国出版	26,700	215,736.00	0.14
43	300441	鲍斯股份	31,300	215,657.00	0.14
44	603989	艾华集团	9,900	213,048.00	0.14
45	600928	西安银行	63,800	212,454.00	0.14
46	300558	贝达药业	4,000	206,200.00	0.14
47	000049	德赛电池	6,600	178,992.00	0.12
48	000739	普洛药业	11,600	178,524.00	0.12
49	600789	鲁抗医药	24,700	176,358.00	0.12
50	603228	景旺电子	7,600	171,456.00	0.11
51	601298	青岛港	27,200	168,096.00	0.11
52	603456	九洲药业	6,900	167,049.00	0.11
53	600033	福建高速	53,400	165,540.00	0.11
54	603583	捷昌驱动	8,200	164,246.00	0.11
55	000852	石化机械	26,300	161,745.00	0.11
56	600737	中粮糖业	19,000	156,560.00	0.10
57	688003	天准科技	4,100	153,832.00	0.10
58	601369	陕鼓动力	19,000	151,620.00	0.10
59	688138	清溢光电	6,300	142,506.00	0.09
60	000519	中兵红箭	9,800	137,592.00	0.09
61	002461	珠江啤酒	17,300	136,670.00	0.09
62	002274	华昌化工	17,600	132,880.00	0.09
63	601608	中信重工	34,400	132,784.00	0.09
64	002608	江苏国信	19,800	130,086.00	0.09
65	002073	软控股份	19,300	126,801.00	0.08
66	002662	京威股份	34,700	121,797.00	0.08
67	603927	中科软	4,000	119,920.00	0.08
68	300383	光环新网	12,100	117,612.00	0.08
69	300219	鸿利智汇	13,800	116,196.00	0.08
70	600062	华润双鹤	6,100	113,460.00	0.08
71	002479	富春环保	23,600	112,572.00	0.07
72	688006	浙江杭可科技	4,600	108,008.00	0.07
73	300319	麦捷科技	11,100	107,004.00	0.07
74	000969	安泰科技	11,600	104,284.00	0.07

75	002701	奥瑞金	25,171	104,207.94	0.07
76	601577	长沙银行	15,200	103,664.00	0.07
77	601126	四方股份	6,800	96,288.00	0.06
78	002249	大洋电机	18,700	92,939.00	0.06
79	002276	万马股份	8,800	89,936.00	0.06
80	688475	萤石网络	2,000	89,800.00	0.06
81	600497	驰宏锌锗	17,600	88,880.00	0.06
82	603766	隆鑫通用	17,100	88,236.00	0.06
83	300376	易事特	13,477	85,848.49	0.06
84	300476	胜宏科技	4,600	84,870.00	0.06
85	002268	电科网安	3,700	83,102.00	0.06
86	600479	千金药业	7,700	82,929.00	0.05
87	300253	卫宁健康	11,000	79,090.00	0.05
88	601158	重庆水务	13,900	78,813.00	0.05
89	300468	四方精创	6,900	74,865.00	0.05
90	600528	中铁工业	10,000	74,400.00	0.05
91	600757	长江传媒	9,700	72,265.00	0.05
92	002534	西子洁能	5,600	69,944.00	0.05
93	601801	皖新传媒	8,900	61,855.00	0.04
94	301301	川宁生物	7,300	61,320.00	0.04
95	603093	南华期货	5,100	61,200.00	0.04
96	000682	东方电子	6,600	53,130.00	0.04
97	000960	锡业股份	3,600	51,552.00	0.03
98	000507	珠海港	9,400	49,444.00	0.03
99	002423	中粮资本	7,400	49,432.00	0.03
100	002064	华峰化学	7,100	47,641.00	0.03
101	002056	横店东磁	3,400	46,036.00	0.03
102	002384	东山精密	2,300	41,814.00	0.03
103	002563	森马服饰	7,100	40,967.00	0.03
104	688252	天德钰科技	2,000	39,920.00	0.03
105	601968	宝钢包装	7,600	38,988.00	0.03
106	002636	金安国纪	4,300	38,313.00	0.03
107	002522	浙江众成	7,900	37,999.00	0.03
108	600420	国药现代	3,800	37,202.00	0.02
109	000875	吉电股份	8,400	36,960.00	0.02
110	300111	向日葵	11,900	36,176.00	0.02
111	000060	中金岭南	8,300	35,856.00	0.02
112	002043	兔宝宝	4,000	35,440.00	0.02
113	300595	欧普康视	1,500	33,870.00	0.02
114	601908	京运通	6,600	30,162.00	0.02
115	300292	吴通控股	8,100	30,132.00	0.02
116	600691	阳煤化工	8,600	27,606.00	0.02
117	600141	兴发集团	1,400	25,550.00	0.02

118	601000	唐山港	7,300	25,550.00	0.02
119	002537	海联金汇	3,260	21,711.60	0.01
120	600718	东软集团	2,300	21,275.00	0.01
121	002303	美盈森	5,700	20,007.00	0.01
122	688018	乐鑫科技	28	2,882.60	0.00
123	688468	科美诊断	34	366.86	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	11,155,411.00	7.39
2	300750	宁德时代	8,616,479.44	5.71
3	600887	伊利股份	6,556,157.00	4.35
4	600309	万华化学	6,538,993.12	4.33
5	000333	美的集团	6,448,761.70	4.27
6	601633	长城汽车	6,229,364.00	4.13
7	000651	格力电器	6,122,879.00	4.06
8	601318	中国平安	6,120,860.90	4.06
9	601899	紫金矿业	6,087,286.00	4.03
10	002415	海康威视	6,045,051.00	4.01
11	002594	比亚迪	6,042,413.94	4.00
12	600036	招商银行	6,005,488.00	3.98
13	601328	交通银行	5,765,516.00	3.82
14	300015	爱尔眼科	5,728,934.00	3.80
15	002027	分众传媒	5,714,447.00	3.79
16	601888	中国中免	5,327,271.10	3.53
17	000338	潍柴动力	5,232,722.00	3.47
18	000858	五粮液	5,150,510.00	3.41
19	601668	中国建筑	5,070,638.72	3.36
20	600132	重庆啤酒	5,029,739.00	3.33
21	000725	京东方A	4,982,712.00	3.30
22	601728	中国电信	4,956,606.00	3.28
23	601878	浙商证券	4,865,098.96	3.22
24	600104	上汽集团	4,792,888.00	3.18
25	002475	立讯精密	4,792,765.00	3.18
26	601398	工商银行	4,779,830.00	3.17
27	600690	海尔智家	4,726,578.00	3.13
28	601012	隆基绿能	4,690,263.00	3.11
29	000100	TCL 科技	4,630,030.67	3.07
30	688036	传音控股	4,593,349.57	3.04

31	600050	中国联通	4,535,585.00	3.01
32	003816	中国广核	4,446,629.00	2.95
33	000568	泸州老窖	4,422,794.00	2.93
34	600362	江西铜业	4,394,902.27	2.91
35	600019	宝钢股份	4,347,058.00	2.88
36	601288	农业银行	4,301,745.00	2.85
37	002916	深南电路	4,270,165.50	2.83
38	601857	中国石油	4,243,801.00	2.81
39	601816	京沪高铁	4,241,916.00	2.81
40	600028	中国石化	4,218,799.00	2.80
41	603806	福斯特	4,151,705.00	2.75
42	000001	平安银行	4,130,868.00	2.74
43	600031	三一重工	4,109,262.00	2.72
44	601138	工业富联	4,098,049.00	2.72
45	002129	TCL 中环	3,987,184.00	2.64
46	603993	洛阳钼业	3,941,719.00	2.61
47	688223	晶科能源	3,941,517.00	2.61
48	600436	片仔癀	3,891,735.00	2.58
49	601600	中国铝业	3,884,294.00	2.57
50	002600	领益智造	3,867,686.00	2.56
51	601766	中国中车	3,811,599.00	2.53
52	601998	中信银行	3,809,922.00	2.53
53	300408	三环集团	3,729,366.00	2.47
54	603288	海天味业	3,728,072.41	2.47
55	000166	申万宏源	3,670,913.00	2.43
56	601818	光大银行	3,637,481.00	2.41
57	600893	航发动力	3,631,143.00	2.41
58	300433	蓝思科技	3,587,562.00	2.38
59	688111	金山办公	3,545,560.19	2.35
60	601658	邮储银行	3,545,160.00	2.35
61	000063	中兴通讯	3,544,754.00	2.35
62	603259	药明康德	3,445,880.00	2.28
63	601319	中国人保	3,428,318.00	2.27
64	300999	金龙鱼	3,414,364.00	2.26
65	002938	鹏鼎控股	3,408,819.00	2.26
66	002736	国信证券	3,390,342.00	2.25
67	601390	中国中铁	3,353,454.00	2.22
68	601985	中国核电	3,349,421.00	2.22
69	600276	恒瑞医药	3,280,552.00	2.17
70	002001	新 和 成	3,238,221.00	2.15
71	000729	燕京啤酒	3,230,927.00	2.14
72	601169	北京银行	3,230,895.00	2.14
73	601601	中国太保	3,225,927.00	2.14

74	600183	生益科技	3,196,165.00	2.12
75	601989	中国重工	3,109,176.00	2.06
76	000661	长春高新	3,098,851.00	2.05
77	002007	华兰生物	3,093,409.00	2.05
78	600150	中国船舶	3,081,735.00	2.04
79	600030	中信证券	3,077,109.00	2.04
80	000157	中联重科	3,064,487.80	2.03

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	5,914,265.00	3.92
2	002594	比亚迪	5,421,720.80	3.59
3	601328	交通银行	5,280,761.00	3.50
4	600309	万华化学	5,223,401.48	3.46
5	002027	分众传媒	5,205,504.00	3.45
6	600887	伊利股份	5,192,329.00	3.44
7	601899	紫金矿业	4,983,375.00	3.30
8	002475	立讯精密	4,948,567.00	3.28
9	300015	爱尔眼科	4,865,954.00	3.22
10	601012	隆基绿能	4,554,397.00	3.02
11	601633	长城汽车	4,534,585.00	3.01
12	300750	宁德时代	4,457,660.33	2.95
13	688036	传音控股	4,423,062.39	2.93
14	000651	格力电器	4,408,713.00	2.92
15	601816	京沪高铁	4,264,757.00	2.83
16	600104	上汽集团	4,179,081.00	2.77
17	002415	海康威视	4,104,546.00	2.72
18	003816	中国广核	4,051,500.00	2.69
19	601888	中国中免	4,051,134.00	2.68
20	603806	福斯特	3,913,900.20	2.59
21	600519	贵州茅台	3,901,052.00	2.59
22	600031	三一重工	3,866,724.00	2.56
23	601878	浙商证券	3,860,739.00	2.56
24	000858	五粮液	3,857,766.00	2.56
25	601728	中国电信	3,765,929.00	2.50
26	300408	三环集团	3,761,744.00	2.49
27	601398	工商银行	3,748,032.00	2.48
28	603288	海天味业	3,700,517.75	2.45
29	688223	晶科能源	3,682,030.00	2.44



30	600690	海尔智家	3,677,324.00	2.44
31	000338	潍柴动力	3,652,816.00	2.42
32	601668	中国建筑	3,629,197.80	2.41
33	000166	申万宏源	3,616,587.00	2.40
34	600019	宝钢股份	3,565,067.00	2.36
35	601138	工业富联	3,547,674.00	2.35
36	600036	招商银行	3,535,137.00	2.34
37	600436	片仔癀	3,396,655.00	2.25
38	600132	重庆啤酒	3,377,113.00	2.24
39	601658	邮储银行	3,375,114.00	2.24
40	002600	领益智造	3,354,340.48	2.22
41	600362	江西铜业	3,332,679.00	2.21
42	600893	航发动力	3,311,048.00	2.19
43	002129	TCL 中环	3,234,004.25	2.14
44	601288	农业银行	3,139,970.00	2.08
45	601318	中国平安	3,127,227.00	2.07
46	000001	平安银行	3,063,165.00	2.03

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	895,420,272.07
卖出股票收入（成交）总额	743,137,591.27

注：买入股票成本（成交）总额和卖出股票收入（成交）总额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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

## 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招商银行股份有限公司，2023 年 2 月因贷款违规，被中国银行保险监督管理委员会处以罚款的处罚，2023 年 12 月因贷款业务违规，被国家金融监督管理总局地方监管局处以罚款的处罚。

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	249,729.48
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	170,134.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	419,863.81

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	2,139	30,016.73	57,108,234.66	88.95%	7,097,554.16	11.05%
国泰君安沪深 300 指数增强发起 C	833	128,186.83	100,384,313.10	94.01%	6,395,313.90	5.99%
合计	2,972	57,532.10	157,492,547.76	92.11%	13,492,868.06	7.89%

## 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	国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	21,469.18	0.0334%
	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C	1,107.42	0.0010%
	合计	22,576.60	0.0132%

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

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人以及本基金基金经理均未持有本基金份额。

## 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	35,982,312.37	21.04%	15,019,000.00	8.78%	自基金合同生效日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	22,576.60	0.01%	-	-	-
合计	36,004,888.97	21.05%	15,019,000.00	8.78%	-

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C
基金合同生效日（2023 年 04 月 19 日）基金份额总额	10,009,999.00	5,010,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	54,976,931.99	122,129,247.48

减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	781,142.17	20,359,620.48
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	64,205,788.82	106,779,627.00

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、报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度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 3 万元人民币。其为本基金提供审计服务的连续年限为自 2023 年 04 月 19 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	1,638,545,167.34	100.00%	116,821.12	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	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议	证监会指定网站、公司官网	2023-04-13
2	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同	证监会指定网站、公司官网	2023-04-13
3	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2023-04-13
4	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2023-04-13
5	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书	证监会指定网站、公司官网	2023-04-13
6	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	证券时报	2023-04-13
7	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金份额发售公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2023-04-13
8	上海国泰君安证券资产管理有	上海证券报、中国证券报、证券	2023-04-17

	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	时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	
9	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2023-04-20
10	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回和定期定额投资业务的公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2023-05-10
11	关于旗下部分开放式证券投资基金在珠海盈米基金销售有限公司开通基金转换业务的公告	中国证券报、证券时报、证监会指定网站、公司官网	2023-07-03
12	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
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	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 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	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 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	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第三季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-10-25

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230419-20231231	15,019,000.00	20,963,312.37	-	35,982,312.37	21.04%
	2	20230919-20231008	-	26,135,912.18	-	26,135,912.18	15.29%
	3	20231117-20231122, 20231128-20231231	-	46,412,941.29	-	46,412,941.29	27.14%
	4	20230809-20230821, 20230823-20231023, 20231205-20231231	-	34,714,824.66	-	34,714,824.66	20.30%
产品特有风险							
<p>本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延赎回，如果连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；</p> <p>(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；</p> <p>(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复；
- 2、《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》；



- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、法律意见书；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

### 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