

# 国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金

## 2024 年第 1 季度报告

2024 年 03 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 04 月 22 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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04月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年01月01日起至2024年03月31日止。

## § 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	2,270,249,680.58 份
投资目标	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。
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</p>

	<p>合，而在投资组合管理层面需要充分考虑其相对于中证 500 指数的风险偏离度。</p> <p>A、股票池的建立</p> <p>考虑到 Alpha 选股模型的强度理论上正比于投资广度的平方根（选股的范围），本基金在策略选股的覆盖面上尽量保留符合风控和流动性等要求的所有股票。基于这样的理念，模型训练和投资组合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>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。</p>
<p>基金管理人</p>	<p>上海国泰君安证券资产管理有限公司</p>
<p>基金托管人</p>	<p>上海银行股份有限公司</p>

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	1,327,742,674.05 份	942,507,006.53 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 01 月 01 日-2024 年 03 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
1. 本期已实现收益	-40,013,567.30	-29,887,508.17
2. 本期利润	-30,126,401.07	-18,226,662.43
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0216	-0.0172
4. 期末基金资产净值	1,143,440,998.62	804,254,547.81
5. 期末基金份额净值	0.8612	0.8533

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。

#### 3.2 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	净值增长率 ①	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	-1.73%	1.88%	-2.45%	1.88%	0.72%	0.00%
过去六个月	-6.46%	1.44%	-6.70%	1.43%	0.24%	0.01%
过去一年	-12.40%	1.15%	-15.77%	1.15%	3.37%	0.00%
自基金合同 生效起至今	-13.88%	1.18%	-26.46%	1.18%	12.58%	0.00%

###### 国泰君安中证 500 指数增强 C 净值表现

阶段	净值增长率 ①	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	-1.84%	1.88%	-2.45%	1.88%	0.61%	0.00%

过去六个月	-6.65%	1.44%	-6.70%	1.43%	0.05%	0.01%
过去一年	-12.76%	1.15%	-15.77%	1.15%	3.01%	0.00%
自基金合同生效起至今	-14.67%	1.18%	-26.46%	1.18%	11.79%	0.00%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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-2024年03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-2024年03月31日)



## § 4 管理人报告

#### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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，国泰君安稳债增利债券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。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。

##### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 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，无侵害计划份额持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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 2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年一季度，A 股市场经历了深 V 型走势。开年后，中小盘股票股价先是连续下跌，触发了雪球和两融的风险，中小盘股票遭到抛售，并遭受流动性危机。同时，股指期货出现了罕见的大幅度贴水，量化中性产品的平仓进一步加剧了中小盘股票的卖出，“去杠杆”现象不断发生影响着市场走势。2 月 6 日至一季度末，由于政策改善预期的驱动，市场开启全面反弹，下跌形态迅速扭转并连续反弹，上证指数重回 3000 点。3 月市场交易活跃度进一步提升，但部分领域（黄金、国债等）仍存在避险情绪。展望第二季度，在市场情绪回稳和盈利预期修复下，以及中央经济工作会议积极定调，近期市场已接近底部，整体回调的空间不大，仍然看好市场的走势。

在行业方面，在一季度，银行、石化、煤炭等行业表现亮眼，这些行业都展现了共同的高股息特征。电子、房地产、医药生物等行业表现较差，主要是年初市场调整阶段出现大规模的回撤。虽然高股息板块整体表现亮眼，但板块轮动仍然较为频繁，特别是前期表现较好的红利、TMT 等板块一季度末普遍出现降温，市场主线尚待发掘。展望第二季度，财报披露可能带来个股和行业间的较大分化，但是市场整体估值仍处于合理水平，不同行业和风格间的轮动将继续。

2024 年一季度主要股指多数下跌，从主要宽基指数涨跌幅来看，本季度上证 50 指数逆势上涨 3.82%，上证指数累计涨幅为 2.23%，科创 50 跌幅最大，累计下跌 10.48%。此外，沪深 300 指数表现较好(涨幅 3.10%)，并与国证 2000 和中证 1000 等小盘指数形成了鲜明对比，两者分别下跌 8.83% 和 7.58%。

从主要风险因子的走势来看，一季度许多风险因子走势十分极端，特别是规模因子和非线性规模因子，一度达到历史 20 倍标准差的极端水平，此外，残差波动率和短期反转等风险因子也多次达

到历史极值位置。一季度大盘风格以及价值风格表现胜过成长风格以及中小盘风格，其中大盘价值指数一季度持续稳健运行。高股息为代表的稳定风格总体表现胜过其他风格指数，但该风格指数在市场全面反弹阶段涨势偏弱。动量因子和分析师情绪因子在本季度表现强势，分析师情绪因子相较 2023 年四季度出现明显提升，动量因子一直延续了 2023 年的稳定走势。Alpha 表现方面，一季度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春节前后小票的极端行情，波动较大，但是在春节后市场反弹阶段也逐步回到历史稳态表现。展望未来，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 3 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 11% 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 6% 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。我们认为作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。

随着我国积极的财政政策适度加力，高水平对外开放政策不断延续，以及消费需求仍处于充分释放阶段，未来市场具备回升条件。我们预计，未来市场板块轮动速度仍然较快，市场主线尚待发掘，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。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。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，投资管理始终高仓位运作，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。

#### 4.5 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 0.8612 元，本报告期内，该类基金



份额净值增长率为-1.73%，同期业绩比较基准收益率为-2.45%；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 0.8533 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.84%，同期业绩比较基准收益率为-2.45%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,817,213,957.91	92.35
	其中：股票	1,817,213,957.91	92.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	146,183,420.27	7.43
8	其他资产	4,446,159.11	0.23
9	合计	1,967,843,537.29	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 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	14,878,629.82	0.76
B	采矿业	75,737,464.80	3.89
C	制造业	983,791,943.92	50.51

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,045,809.67	2.31
E	建筑业	22,662,647.00	1.16
F	批发和零售业	12,242,735.94	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	41,081,253.92	2.11
H	住宿和餐饮业	577,530.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	87,034,230.78	4.47
J	金融业	108,526,977.82	5.57
K	房地产业	2,769,516.00	0.14
L	租赁和商务服务业	23,638,847.00	1.21
M	科学研究和技术服务业	8,941,251.76	0.46
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	6,803,440.60	0.35
R	文化、体育和娱乐业	23,639,717.80	1.21
S	综合	-	-
	合计	1,457,371,996.83	74.83

### 5.2.2 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	121,752.00	0.01
B	采矿业	18,267,114.00	0.94
C	制造业	210,328,470.85	10.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,159,274.44	1.19
E	建筑业	20,841,709.66	1.07
F	批发和零售业	1,593,997.00	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	215,495.00	0.01
H	住宿和餐饮业	1,475,740.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,686,549.32	0.55
J	金融业	32,894,748.00	1.69
K	房地产业	3,973,462.00	0.20
L	租赁和商务服务业	1,199,912.60	0.06
M	科学研究和技术服务业	627,781.21	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	1,519,587.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,301,548.00	0.07
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	31,634,820.00	1.62
S	综合	-	-

	合计	359,841,961.08	18.48
--	----	----------------	-------

### 5.2.3 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。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	600482	中国动力	1,218,700	24,727,423.00	1.27
2	000630	铜陵有色	5,816,600	23,091,902.00	1.19
3	600497	驰宏锌锗	3,905,800	22,145,886.00	1.14
4	002558	巨人网络	1,846,500	22,065,675.00	1.13
5	600096	云天化	1,162,000	22,054,760.00	1.13
6	600535	天士力	1,307,500	21,063,825.00	1.08
7	000021	深科技	1,519,000	20,931,820.00	1.07
8	600498	烽火通信	1,163,700	20,865,141.00	1.07
9	600141	兴发集团	1,137,100	20,808,930.00	1.07
10	000519	中兵红箭	1,627,700	20,720,621.00	1.06

### 5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600578	京能电力	5,485,300	18,430,608.00	0.95
2	601857	中国石油	1,568,900	15,500,732.00	0.80
3	601949	中国出版	1,567,900	12,449,126.00	0.64
4	002938	鹏鼎控股	475,900	11,040,880.00	0.57
5	000617	中油资本	1,747,100	10,010,883.00	0.51

## 5.4 报告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。

## 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC2404	IC2404	17	17,925,480.00	-450,289.49	-
IC2409	IC2409	6	6,170,160.00	-8,494.61	-
公允价值变动总额合计 (元)					-458,784.10
股指期货投资本期收益 (元)					2,917,311.80
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-544,829.98

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

报告期内，未参与国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金持有的前十名证券发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,891,476.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,554,682.31
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,446,159.11

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.5.1 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。

#### 5.11.5.2 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。

## § 6 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
报告期期初基金份额总额	1,513,115,108.29	1,082,577,289.11
报告期期间基金总申购份额	69,044,492.23	287,130,784.84
减：报告期期间基金总赎回份额	254,416,926.47	427,201,067.42
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	1,327,742,674.05	942,507,006.53

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。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人持有本基金份额未发生变化。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2024 年 2 月 28 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高级管理人员变更公告》，2024 年 2 月 26 日起，叶明同志代为履行公司首席信息官职责，免去朱晓力同志首席信息官职务。

2024 年 3 月 20 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基金行业高级

管理人员变更公告》，2024 年 3 月 18 日起，陶耿同志兼任公司财务负责人，叶明同志不再兼任公司财务负责人职务。

2024 年 3 月 20 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基金行业高级管理人员变更公告》，2024 年 3 月 18 日起，吕巍同志兼任公司首席风险官，叶明同志不再兼任公司首席风险官职务。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 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。

### 9.2 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>。

### 9.3 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  
二〇二四年四月二十二日