

国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

2024 年年度报告

2024 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:2025 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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2025年03月14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2024年01月01日起至2024年12月31日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....1

1.1 重要提示.....1

1.2 目录.....2

§ 2 基金简介6

2.1 基金基本情况6

2.2 基金产品说明6

2.3 基金管理人和基金托管人.....7

2.4 信息披露方式7

2.5 其他相关资料7

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况7

3.1 主要会计数据和财务指标.....7

3.2 基金净值表现8

3.3 过去三年基金的利润分配情况.....11

§ 4 管理人报告.....11

4.1 基金管理人及基金经理情况11

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明12

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....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
§ 5 托管人报告	17
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真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
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
§ 8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	90
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	90
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	90

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.....	90
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	90
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	90
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	91
8.12 投资组合报告附注	91
§ 9 基金份额持有人信息.....	92
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	92
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	92
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	93
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	93
§ 10 开放式基金份额变动.....	94
§ 11 重大事件揭示	94
11.1 基金份额持有人大会决议	94
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.....	94
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	95
11.4 基金投资策略的改变	95
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	95
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	95
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	95
11.8 其他重大事件.....	96
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	98
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.....	98

12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	98
§ 13 备查文件目录	98
13.1 备查文件目录.....	99
13.2 存放地点	99
13.3 查阅方式	99

§ 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	1, 729, 604, 528. 22 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	661, 649, 866. 07 份	1, 067, 954, 662. 15 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	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。 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。
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	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢外经贸大厦 901-22 至 901-26
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	2024 年		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	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	45,250,515.30	115,871,446.01	-4,055,049.28	-6,383,571.28
本期利润	47,763,630.45	133,273,028.37	-4,978,624.97	-8,072,921.83
加权平均基金份额本期利润	0.2072	0.2298	-0.1452	-0.1650
本期加权平均净值利润率	21.26%	23.66%	-15.67%	-17.92%
本期基金份额净值增长率	19.24%	18.77%	-11.60%	-11.85%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	35,808,737.79	50,166,978.52	-7,448,070.37	-12,650,444.47
期末可供分配基金份额利润	0.0541	0.0470	-0.1160	-0.1185
期末基金资产净值	697,458,603.86	1,118,121,640.67	56,757,718.45	94,129,182.53
期末基金份额净值	1.0541	1.0470	0.8840	0.8815
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	5.41%	4.70%	-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）。

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	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	--------------	-----	-----

				④		
过去三个月	-1.77%	1.66%	-1.92%	1.65%	0.15%	0.01%
过去六个月	14.20%	1.57%	13.05%	1.58%	1.15%	-0.01%
过去一年	19.24%	1.28%	14.04%	1.27%	5.20%	0.01%
自基金合同生效起至今	5.41%	1.10%	-5.04%	1.11%	10.45%	-0.01%

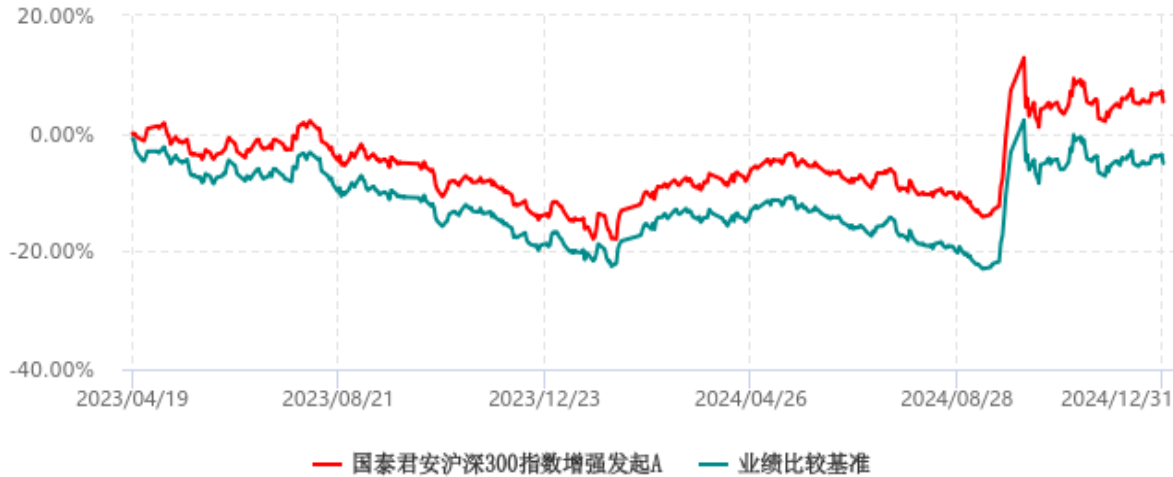
国泰君安沪深 300 指数增强发起 C 净值表现

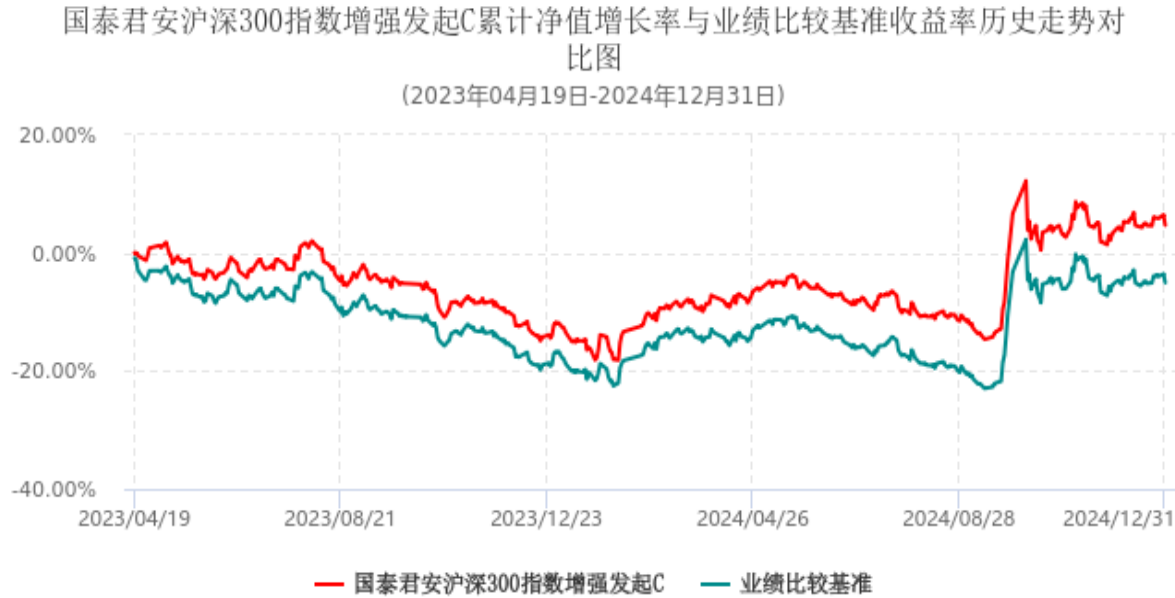
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	-1.87%	1.66%	-1.92%	1.65%	0.05%	0.01%
过去六个月	13.98%	1.57%	13.05%	1.58%	0.93%	-0.01%
过去一年	18.77%	1.28%	14.04%	1.27%	4.73%	0.01%
自基金合同生效起至今	4.70%	1.10%	-5.04%	1.11%	9.74%	-0.01%

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

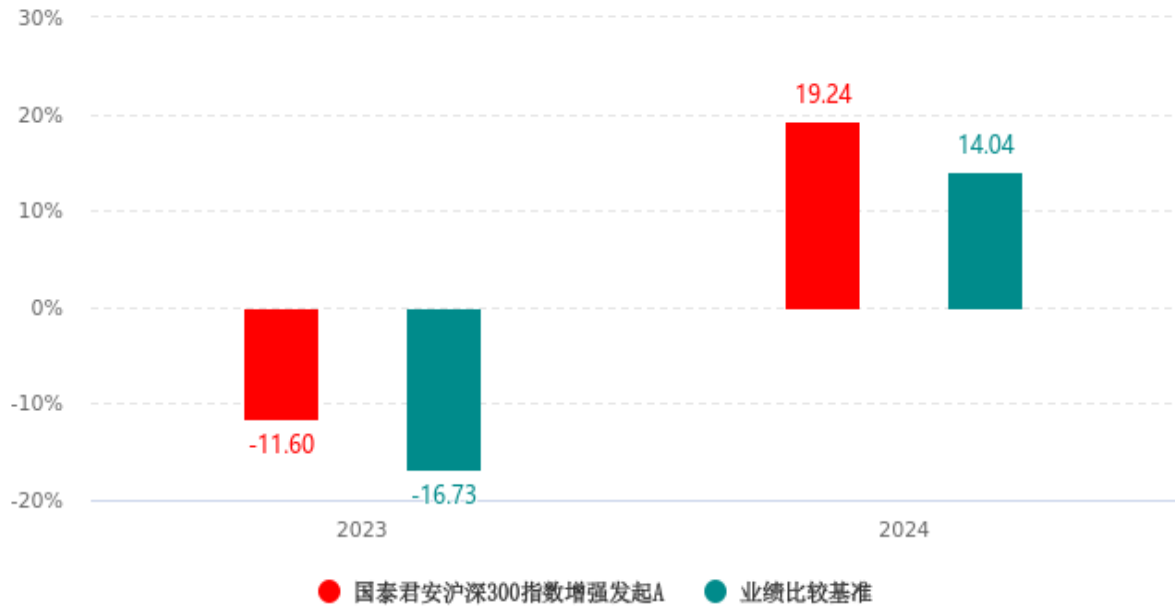
国泰君安沪深300指数增强发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2023年04月19日-2024年12月31日)

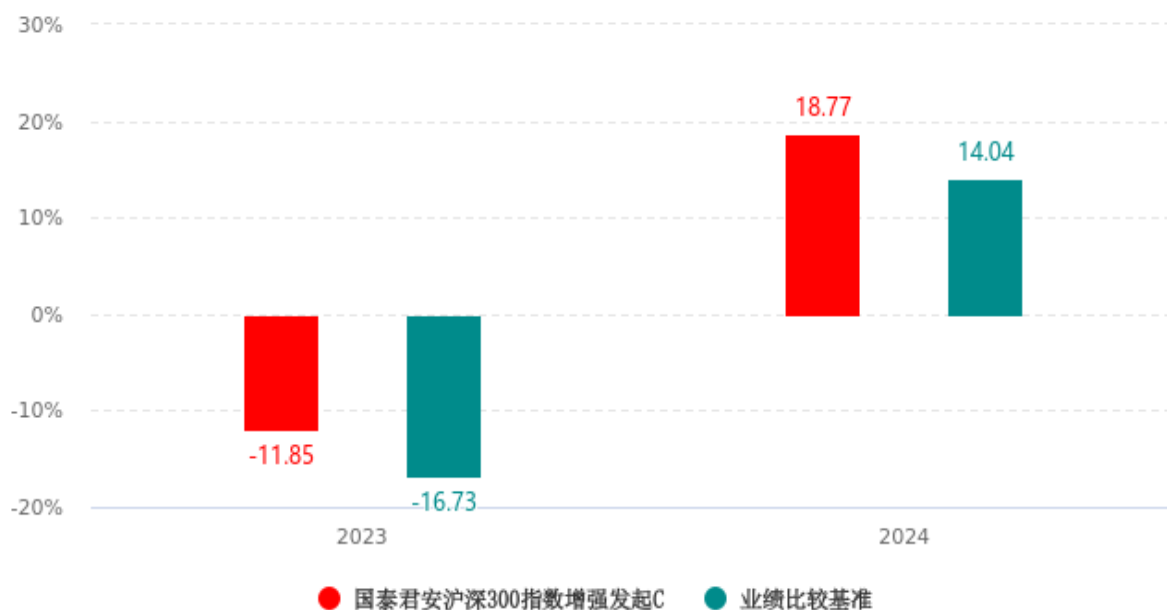




3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为 2023 年 04 月 19 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



注：本基金合同生效日为 2023 年 04 月 19 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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 2024 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 57 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 指数增强基金经理，国泰君安中证 1000 指数增强基金经理，国泰君安量化选股混合发起基金经理，国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金经理，国泰君安沪深 300 指数增强发起基金经理，国泰君安中证 1000 优选股票发起基金经理，国泰君安稳债增利债券发起基金经理，国泰君安科创板量化选股股票发起基金经理，国泰君安红利量化选股混合基金经理，国泰君安中证 A500 指数增强基金经理。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	-	13 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。

4.2 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% 的次數为 8 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

2024 年 A 股市场经历“政策驱动、结构剧变”的深度调整与修复过程，全年呈现“双底反转、风格轮动”的 W 型走势。本年度前两个季度 A 股市场呈现“V 型探底→政策托底→分化加剧”的波动特征，核心矛盾体现为政策对冲与基本面压力的博弈：一季度流动性冲击后政策快速响应稳定市场，二季度政策红利边际递减，市场回归基本面定价逻辑。从九月底开始，政策组合拳（证券基金互换便利等）超预期出台，高 Beta 板块（非银、计算机）引领反弹，风格迅速从价值切换至成长，全年 A 股整体上经历“流动性冲击→政策托底→风格再平衡”过程，监管层通过打击财务造假、优化退市等改革重塑生态，为股市中长期健康发展奠定扎实的基础。从主要宽基指数来看，2024 年沪深 300 指数表现优异（涨幅 14.68%），好于中证 500（涨幅 5.46%）和中证 1000（涨幅 1.20%）。展望 2025 年，A 股有望在“政策护航与业绩修复”双轮驱动下开启慢牛征程。政策层面，互换便利与专项再贷款等央行创新货币工具进入落地阶段，叠加二十届三中全会提出的科技体制改革以及聚焦科创板高质量发展的“科创板八条”等产业政策深化，将强化流动性支持与成长股

投资逻辑，市场驱动逻辑料从估值修复转向盈利验证，全 A 净利润增速有望企稳回升。结构上，上半年流动性宽松或催化小盘科技股行情，下半年随经济数据验证，顺周期板块或接力。全年看，科技与高端制造的高弹性、消费板块的修复潜力及政策受益方向或成为超额收益来源，市场或沿“震荡螺旋上升”路径演绎。

从主要风险因子的走势来看，市值因子在年初表现强势，之后趋于稳定，这与年初大跌时大盘股占优，后走向小盘的市场风格相符。动量因子在前半年走强，后半年趋于平稳。全年的风格轮动依然明显，红利和微盘轮番“搭台唱戏”，哑铃型策略占优。Alpha 表现方面，上半年基本面因子表现突出，分红、盈利因子稳步获利，红利低波风格一度成为市场追逐的热点。但进入下半年后基本面因子有所回落，高频量价类因子在这一阶段迎来业绩赶超。鉴于今年市场环境的复杂性，我们更加重视提升业绩稳定性，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。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，同时我们也将合理进行模型配置。

行业方面表现分化，政策与产业趋势主导结构性机会。大金融板块全年领涨，银行与非银金融受益于低估值修复及政策利好，涨幅超 30%；通信行业延续 TMT 板块强势，商业化落地加速推动估值提升。家电、汽车等可选消费板块凭借政策扶持与消费升级需求释放，表现居前。相比之下，医药生物、农林牧渔及美容护理等板块受需求疲软拖累，收益率排名靠后。2025 年，科技板块中 AI 基础设施建设、半导体周期上行及软硬科技产业化进程或成为主线，家电、汽车及电子行业亦存在业绩与估值双击潜力；消费板块经历连续调整后，困境反转机会值得关注。

从沪深 300 指数当前的估值水平来看，截至 2024 年末，其加权 PE 和整体 PE 在 13 倍和 13 倍左右，处于历史中位数水平，整体 PE 在历史上的分位数在 50%左右，而用整体 PB 估值的话，则历史分位数更低，处于历史分位数 18%之内。从业绩的可持续角度来看，估值进一步向下的空间要小于向上的空间。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。我们认为作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。

以分散化投资为主的量化投资在今年超大盘股引领的防御性行情下，阶段性面临一定的挑战，但也充分证明量化模型在大盘股上也可以做出较为稳定的 Alpha。量化投资的逻辑自成体系，尽量不要受市场“宏大叙事”的印象，从投资理念和投资逻辑来讲保持自洽和一致。过去一段时间当中，市场的小盘股呈现出了较大的波动性，而以博取 Alpha 为主的大盘宽基增强型产品相比之下呈现出更高的性价比和更优的投资体验感。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，通过机器学习模型有针对性地有效选择因子，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，争取以较为稳定的方式增强沪深 300 指数。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，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。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 指数当前依然处于历史低估阶段，在复杂的经济环境下体现出了较为稳定的盈利能力，也是最注重股东回报的一类上市公司，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 1.0541 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 19.24%，同期业绩比较基准收益率为 14.04%；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 1.0470 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 18.77%，同期业绩比较基准收益率为 14.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年 A 股市场呈现显著的波动性特征，全年经历了流动性冲击、政策驱动反弹及风格切换等多重考验。年初市场因雪球敲入、两融与 DMA 爆仓等风险事件引发流动性危机，中小盘指数承压；春节后政策托底力度加大，ETF 资金加速流入带动市场超跌反弹。9 月政策全面发力（如“并购六条”、市值管理政策），推动市场风险偏好大幅提升，科创板领头带领市场强势反弹。展望 2025 年，市场预计在政策深化与资金面改善的双重驱动下延续结构性行情。政策层面，“1+N”政策体系将推动资本市场高质量发展，并购重组政策引导资源向新质生产力领域集中，科技、高端制造等领域有望迎来整合潮；财政与货币政策协同发力，特别国债及专项债规模扩大，进一步释放流动性。资金面方面，险资、ETF 及外资构成三大增量来源，市场风险偏好回暖，资金供给端的规模有望较 2024 年明显改善。沪深 300 指数作为市场中大盘股的代表，从长期来看依然有其特殊的配置价值。从量化模型的 Alpha 角度来看，市场交易量的提升，风险偏好的提高有利于 Alpha 的发挥。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、提升实盘模型的逻辑性、加强全方位的综合 Alpha 解决能力以及策略配置能力等，从而巩固通过量化的投资方法在沪深 300 指数上博取超额收益的能力。

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规定，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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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	容诚审字[2025]200Z1998 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	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”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

	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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	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。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。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。
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	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。 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。 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。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： （1）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。 (2) 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。 (3) 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。 (4) 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。 (5) 评价财务报表的总体列报、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。 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。	
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	张振波	徐翹楚
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢外经贸大厦 901-22 至 901-26	
审计报告日期	2025-03-25	

§ 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：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	163,945,754.77	9,173,073.58
结算备付金		6,297,664.76	890,661.07
存出保证金		4,142,490.66	249,729.48
交易性金融资产	7.4.7.2	1,682,127,380.11	140,626,531.14

其中：股票投资		1,682,127,380.11	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		71,074,810.76	170,134.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		1,927,588,101.06	151,110,129.60
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
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		0.00	-
应付赎回款		109,866,988.21	21,276.29
应付管理人报酬		1,468,804.78	123,205.59

应付托管费		220,320.71	18,480.84
应付销售服务费		411,247.30	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	40,495.53	30,004.76
负债合计		112,007,856.53	223,228.62
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	1,729,604,528.22	170,985,415.82
未分配利润	7.4.7.8	85,975,716.31	-20,098,514.84
净资产合计		1,815,580,244.53	150,886,900.98
负债和净资产总计		1,927,588,101.06	151,110,129.60

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,729,604,528.22 份。其中国泰君安沪深 300 指数增强发起 A 基金份额净值 1.0541 元，基金份额总额 661,649,866.07 份；国泰君安沪深 300 指数增强发起 C 基金份额净值 1.0470 元，基金份额总额 1,067,954,662.15 份。

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：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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		192,417,780.65	-12,278,875.96
1. 利息收入		174,113.67	14,497.38
其中：存款利息收入	7.4.7.9	169,558.32	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		4,555.35	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		170,847,075.00	-9,688,371.23
其中：股票投资收益	7.4.7.10	145,588,162.23	-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	4,562,275.22	-709,886.37
股利收益	7.4.7.12	20,696,637.55	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	19,914,697.51	-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	1,481,894.47	7,924.13
减：二、营业总支出		11,381,121.83	772,670.84
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,798,593.12	536,639.10
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,169,788.90	80,495.90
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,229,398.12	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		18,646.92	-

8. 其他费用	7.4.7.15	164,694.77	30,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		181,036,658.82	-13,051,546.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		181,036,658.82	-13,051,546.80
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		181,036,658.82	-13,051,546.80

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：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	170,985,415.82	-20,098,514.84	150,886,900.98
二、本期期初净资产	170,985,415.82	-20,098,514.84	150,886,900.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,558,619,112.40	106,074,231.15	1,664,693,343.55
（一）、综合收益总额	-	181,036,658.82	181,036,658.82
（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）	1,558,619,112.40	-74,962,427.67	1,483,656,684.73
其中：1. 基金申购款	2,684,760,408.83	-62,882,228.40	2,621,878,180.43
2. 基金赎回款	- 1,126,141,296.43	-12,080,199.27	- 1,138,221,495.70
（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）	-	0.00	-
四、本期期末净资产	1,729,604,528.22	85,975,716.31	1,815,580,244.53
项 目	上年度可比期间 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

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	陶耿	王红莲
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) $\times 5\%$ 。

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》、本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 2024 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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 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业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，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

本基金持有的金融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。对于已开放转换业务的基金，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

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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 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，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	137,481,348.23	3,532,213.11
等于：本金	137,469,577.01	3,531,581.23
加：应计利息	11,771.22	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	26,464,406.54	5,640,860.47
等于：本金	26,462,340.62	5,640,569.60
加：应计利息	2,065.92	290.87
减：坏账准备	-	-
合计	163,945,754.77	9,173,073.58

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,664,238,913.75	-	1,682,127,380.11	17,888,466.36
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-

合计	1,664,238,913.75	-	1,682,127,380.11	17,888,466.36
项目	上年度末 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 2024 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	34,822,155.09	-	-	-
一股指期货	34,822,155.09	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	34,822,155.09	-	-	-
项目	上年度末 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	-	-	-
一股指期货	2,015,013.75	-	-	-
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
IF2501	IF2501	2	2,363,280.00	-32,977.59
IF2502	IF2502	21	24,815,700.00	-333,532.50
IF2503	IF2503	2	2,362,800.00	-54,465.00
IF2506	IF2506	4	4,693,680.00	-165,720.00
合计				-586,695.09
减：可抵销期货暂收款				-586,695.09
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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	495.53	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	40,000.00	30,000.00
合计	40,495.53	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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	64,205,788.82	64,205,788.82
本期申购	714,736,807.54	714,736,807.54
本期赎回（以“-”号填列）	-117,292,730.29	-117,292,730.29
本期末	661,649,866.07	661,649,866.07

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	106,779,627.00	106,779,627.00
本期申购	1,970,023,601.29	1,970,023,601.29
本期赎回（以“-”号填列）	-1,008,848,566.14	-1,008,848,566.14
本期末	1,067,954,662.15	1,067,954,662.15

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	-4,494,688.53	-2,953,381.84	-7,448,070.37
本期期初	-4,494,688.53	-2,953,381.84	-7,448,070.37
本期利润	45,250,515.30	2,513,115.15	47,763,630.45
本期基金份额交易产生的变动数	1,783,658.15	-6,290,480.44	-4,506,822.29
其中：基金申购款	-730,054.33	-5,060,928.01	-5,790,982.34

基金赎回款	2,513,712.48	-1,229,552.43	1,284,160.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,539,484.92	-6,730,747.13	35,808,737.79

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	-7,743,293.30	-4,907,151.17	-12,650,444.47
本期期初	-7,743,293.30	-4,907,151.17	-12,650,444.47
本期利润	115,871,446.01	17,401,582.36	133,273,028.37
本期基金份额交易产生的变动数	-47,013,201.54	-23,442,403.84	-70,455,605.38
其中：基金申购款	-40,907,392.19	-16,183,853.87	-57,091,246.06
基金赎回款	-6,105,809.35	-7,258,549.97	-13,364,359.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	61,114,951.17	-10,947,972.65	50,166,978.52

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	99,010.89	5,417.75
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	52,887.39	7,668.96
结算备付金利息收入	17,660.04	1,410.67
其他	-	-
合计	169,558.32	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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	6,993,554,443.15	743,137,591.27
减：卖出股票成本总额	6,842,360,330.32	752,131,948.44
减：交易费用	5,605,950.60	664,899.29
买卖股票差价收入	145,588,162.23	-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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	4,875,004.34	-701,046.25
减：其他衍生工具收益应缴纳 增值税	155,390.95	-
减：交易费用	157,338.17	8,840.12
合计	4,562,275.22	-709,886.37

7.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	20,696,637.55	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	20,696,637.55	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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	20,550,258.85	-2,661,792.49
——股票投资	20,550,258.85	-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	-635,561.34	48,866.25
——权证投资	-	-
期货投资	-635,561.34	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	19,914,697.51	-2,612,926.24

7.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	1,481,782.22	7,924.13
其他	112.25	-
合计	1,481,894.47	7,924.13

7.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	30,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	4,294.77	-
证券账户开户费	400.00	400.00
合计	164,694.77	30,400.00

7.4.7.16 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。

7.4.8 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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
国泰君安证券	14,152,334,440.90	92.17%	1,638,545,167.34	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

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债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金报告期及上年度可比期间未有通过关联方单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	1,031,965.62	91.78%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 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：1. 上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席位租用协议进行约定，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结算风险基金后的净额列示。

2. 该类席位租用协议服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，针对被动股票型基金佣金协议的服务范围不包括研究服务、流动性服务等。

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	7,798,593.12	536,639.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,309,024.52	47,799.37
应支付基金管理人的净管理费	6,489,568.60	488,839.73

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 1.00\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	1,169,788.90	80,495.90

注：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。

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	-	1,490,139.55	1,490,139.55
国泰君安证券	-	419,700.38	419,700.38
浦东发展银行	-	266.67	266.67
合计	-	1,910,106.60	1,910,106.6

			0
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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：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。

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	30,972,312.37	-
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	20,963,312.37	-

额		
报告期末持有的基金份额	10,009,000.00	30,972,312.37
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.51%	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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	5,010,000.00	-
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	5,010,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.47%	4.69%

注：1. 基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。2. 报告期期末持有的本基金份额占基金分类份额比例，比例的分母采用各自类别的份额计算。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
国泰君安证券	5,932,774.32	44,447.06	5,640,860.47	7,668.96
浦东发展银行	137,481,348.23	99,010.89	3,532,213.11	5,417.75

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2. 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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及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。

7.4.10.8 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

本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2024 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
301626	苏州天脉	2024 年 10 月 17 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
688615	合合信息	2024 年 09 月 19 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	55.18	165.78	289	15,947.02	47,910.42	-
301611	珂玛科技	2024 年 08 月 07 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
688449	联芸科技	2024 年 11 月 20 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-
688605	先锋精	2024 年 12 月 04 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-

	科			售						
688708	佳驰科技	2024 年 11 月 27 日	1-6 个月 (含)	科创板打新限售	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-
688726	拉普拉斯	2024 年 10 月 22 日	1-6 个月 (含)	科创板打新限售	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-
301551	无线传媒	2024 年 09 月 19 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	7 个交易日	新股未上市	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	1-6 个月 (含)	主板打新限售	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
688750	金天钛业	2024 年 11 月 12 日	1-6 个月 (含)	科创板打新限售	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-
301522	上大股份	2024 年 10 月 09 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
301631	壹连科技	2024 年 11 月 12 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	72.99	101.96	153	11,167.47	15,599.88	-
603207	小方制药	2024 年 08 月 19 日	1-6 个月 (含)	股票流通受限	12.47	26.65	533	6,646.51	14,204.45	-
301622	英思特	2024 年 11 月 26 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301608	博实结	2024 年 07 月 25 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-

				售						
301613	新铝时代	2024 年 10 月 18 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-
301586	佳力奇	2024 年 08 月 21 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
688710	益诺思	2024 年 08 月 27 日	1-6 个月 (含)	科创板打新限售	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
301617	博苑股份	2024 年 12 月 03 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301603	乔锋智能	2024 年 07 月 03 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301585	蓝宇股份	2024 年 12 月 10 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
001279	强邦新材	2024 年 09 月 27 日	1-6 个月 (含)	股票流通受限	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
603310	巍华新材	2024 年 08 月 07 日	1-6 个月 (含)	股票流通受限	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603091	众鑫股份	2024 年 09 月 10 日	1-6 个月 (含)	股票流通受限	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603350	安乃达	2024 年 06 月 26 日	1-6 个月 (含)	股票流通受限	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603205	健尔康	2024 年 10 月 29 日	1-6 个月 (含)	股票流通受限	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行

业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

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，其他银行存款为光大证券股份有限公司、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 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（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 2024 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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、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 2024 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	163,945,754.77	-	-	-	163,945,754.77
结算备付金	6,297,664.76	-	-	-	6,297,664.76
存出保证金	4,142,490.66	-	-	-	4,142,490.66
交易性金融资产	-	-	-	1,682,127,380.11	1,682,127,380.11
应收申购款	-	-	-	71,074,810.76	71,074,810.76
资产总计	174,385,910.19	-	-	1,753,202,190.87	1,927,588,101.06

负债					
应付赎回款	-	-	-	109,866,988.21	109,866,988.21
应付管理人报酬	-	-	-	1,468,804.78	1,468,804.78
应付托管费	-	-	-	220,320.71	220,320.71
应付销售服务费	-	-	-	411,247.30	411,247.30
其他负债	-	-	-	40,495.53	40,495.53
负债总计	-	-	-	112,007,856.53	112,007,856.53
利率敏感度缺口	174,385,910.19	-	-	1,641,194,334.34	1,815,580,244.53
上年度末 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 2024 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%(2023 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(2023 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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	1,682,127,380.11	92.65	140,626,531.14	93.20
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,682,127,380.11	92.65	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

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注 7.4.1) 上升 5%	90,075,800.45	-
	业绩比较基准(附注 7.4.1) 下降 5%	-90,075,800.45	-

注：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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	1,681,576,802.88	140,626,531.14
第二层次	27,736.50	-
第三层次	522,840.73	-
合计	1,682,127,380.11	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

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	254,758.24	254,758.24
转出第三层次	-	77,784.86	77,784.86
当期利得或损失总额	-	345,867.35	345,867.35
其中：计入损益的利得或损失	-	345,867.35	345,867.35
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	522,840.73	522,840.73
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	-	311,324.93	311,324.93
项目	上年度可比期间 2023 年 04 月 19 日（基金合同生效日）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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
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			
--	--	--	--

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

单位：人民币元

项目	本期末公 允价值	采用的估 值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均 值	与公允价值之间的 关系
流动 性折 扣估 值处 于限 售期 的股 票投 资	522,840.7 3	亚式期权 模型	预期年化波动率	34.23%- 574.44%	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

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	1,682,127,380.11	87.27
	其中：股票	1,682,127,380.11	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	170,243,419.53	8.83
8	其他各项资产	75,217,301.42	3.90
9	合计	1,927,588,101.06	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	9,234,699.00	0.51
B	采矿业	75,686,698.45	4.17
C	制造业	723,386,919.09	39.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	56,476,966.39	3.11
E	建筑业	46,962,548.00	2.59
F	批发和零售业	4,529,140.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	36,073,226.00	1.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	59,708,997.00	3.29
J	金融业	381,801,248.13	21.03
K	房地产业	3,267,584.00	0.18
L	租赁和商务服务业	9,690,855.00	0.53
M	科学研究和技术服务业	29,025,491.00	1.60
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	16,432,650.00	0.91

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,452,277,022.06	79.99

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	6,671,943.58	0.37
C	制造业	139,525,681.15	7.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,163,173.28	0.89
E	建筑业	4,637,443.00	0.26
F	批发和零售业	7,358,676.00	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	15,769,251.00	0.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,966,277.48	0.93
J	金融业	22,491,201.00	1.24
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	70,299.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	165,921.56	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	19,003.00	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	11,488.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	229,850,358.05	12.66

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	44,900	68,427,600.00	3.77

2	300750	宁德时代	215,552	57,336,832.0 0	3.16
3	601318	中国平安	989,000	52,070,850.0 0	2.87
4	600036	招商银行	1,008,400	39,630,120.0 0	2.18
5	000333	美的集团	454,800	34,210,056.0 0	1.88
6	600887	伊利股份	1,079,000	32,564,220.0 0	1.79
7	000725	京东方 A	6,684,300	29,344,077.0 0	1.62
8	601857	中国石油	2,801,900	25,048,986.0 0	1.38
9	601766	中国中车	2,953,570	24,750,916.6 0	1.36
10	603259	药明康德	440,900	24,267,136.0 0	1.34
11	601899	紫金矿业	1,570,800	23,750,496.0 0	1.31
12	000858	五粮液	165,700	23,204,628.0 0	1.28
13	000001	平安银行	1,875,400	21,942,180.0 0	1.21
14	600900	长江电力	708,700	20,942,085.0 0	1.15
15	300014	亿纬锂能	442,400	20,677,776.0 0	1.14
16	300433	蓝思科技	915,400	20,047,260.0 0	1.10
17	002594	比亚迪	69,900	19,757,934.0 0	1.09
18	600941	中国移动	163,500	19,319,160.0 0	1.06
19	601633	长城汽车	732,144	19,277,351.5 2	1.06
20	000166	申万宏源	3,580,600	19,156,210.0 0	1.06
21	601919	中远海控	1,235,100	19,144,050.0 0	1.05
22	601138	工业富联	875,100	18,814,650.0 0	1.04
23	002475	立讯精密	461,200	18,798,512.0 0	1.04

24	600050	中国联通	3,468,900	18,419,859.0 0	1.01
25	601818	光大银行	4,731,300	18,310,131.0 0	1.01
26	601988	中国银行	3,270,100	18,018,251.0 0	0.99
27	000617	中油资本	2,558,700	17,629,443.0 0	0.97
28	601600	中国铝业	2,377,800	17,476,830.0 0	0.96
29	601728	中国电信	2,298,000	16,591,560.0 0	0.91
30	300015	爱尔眼科	1,240,200	16,432,650.0 0	0.91
31	601169	北京银行	2,560,900	15,749,535.0 0	0.87
32	600875	东方电气	968,323	15,386,652.4 7	0.85
33	688981	中芯国际	159,614	15,102,676.6 8	0.83
34	000651	格力电器	331,100	15,048,495.0 0	0.83
35	600015	华夏银行	1,817,396	14,557,341.9 6	0.80
36	000895	双汇发展	556,100	14,436,356.0 0	0.80
37	003816	中国广核	3,409,900	14,082,887.0 0	0.78
38	601688	华泰证券	795,600	13,994,604.0 0	0.77
39	603501	韦尔股份	128,600	13,427,126.0 0	0.74
40	600016	民生银行	3,144,900	12,988,437.0 0	0.72
41	601398	工商银行	1,854,233	12,831,292.3 6	0.71
42	601288	农业银行	2,399,400	12,812,796.0 0	0.71
43	002415	海康威视	411,200	12,623,840.0 0	0.70
44	603288	海天味业	265,100	12,168,090.0 0	0.67
45	002352	顺丰控股	301,200	12,138,360.0 0	0.67

46	600999	招商证券	623,900	11,953,924.00	0.66
47	600196	复星医药	479,372	11,912,394.20	0.66
48	601939	建设银行	1,347,797	11,847,135.63	0.65
49	000776	广发证券	720,800	11,684,168.00	0.64
50	000063	中兴通讯	285,500	11,534,200.00	0.64
51	601166	兴业银行	571,130	10,942,850.80	0.60
52	600809	山西汾酒	56,900	10,481,549.00	0.58
53	601618	中国中冶	3,170,000	10,461,000.00	0.58
54	600958	东方证券	989,700	10,451,232.00	0.58
55	601390	中国中铁	1,594,100	10,186,299.00	0.56
56	601088	中国神华	231,000	10,043,880.00	0.55
57	002027	分众传媒	1,378,500	9,690,855.00	0.53
58	002459	晶澳科技	700,500	9,631,875.00	0.53
59	300124	汇川技术	163,500	9,577,830.00	0.53
60	601668	中国建筑	1,579,600	9,477,600.00	0.52
61	300274	阳光电源	125,100	9,236,133.00	0.51
62	300059	东方财富	354,100	9,142,862.00	0.50
63	600309	万华化学	122,200	8,718,970.00	0.48
64	603986	兆易创新	77,900	8,319,720.00	0.46
65	600795	国电电力	1,730,000	7,923,400.00	0.44
66	600030	中信证券	270,700	7,896,319.00	0.43
67	600690	海尔智家	275,700	7,849,179.00	0.43
68	002736	国信证券	671,200	7,517,440.00	0.41
69	603993	洛阳钼业	1,129,400	7,510,510.00	0.41
70	688009	中国通号	1,164,420	7,289,269.20	0.40
71	688223	晶科能源	999,141	7,103,892.51	0.39
72	603799	华友钴业	237,800	6,958,028.00	0.38
73	601328	交通银行	836,300	6,498,051.00	0.36
74	000977	浪潮信息	124,800	6,474,624.00	0.36
75	000425	徐工机械	809,200	6,416,956.00	0.35
76	601186	中国铁建	656,800	6,022,856.00	0.33
77	600023	浙能电力	1,055,100	5,971,866.00	0.33

78	000568	泸州老窖	47,400	5,934,480.00	0.33
79	601877	正泰电器	245,580	5,749,027.80	0.32
80	000338	潍柴动力	409,200	5,606,040.00	0.31
81	601669	中国电建	1,010,300	5,516,238.00	0.30
82	601377	兴业证券	837,700	5,244,002.00	0.29
83	002241	歌尔股份	203,000	5,239,430.00	0.29
84	601319	中国人保	664,899	5,066,530.38	0.28
85	300498	温氏股份	300,900	4,967,859.00	0.27
86	300999	金龙鱼	150,600	4,911,066.00	0.27
87	600018	上港集团	780,800	4,778,496.00	0.26
88	300759	康龙化成	185,150	4,758,355.00	0.26
89	002371	北方华创	12,100	4,731,100.00	0.26
90	000963	华东医药	130,900	4,529,140.00	0.25
91	002714	牧原股份	111,000	4,266,840.00	0.24
92	600031	三一重工	256,700	4,230,416.00	0.23
93	688041	海光信息	27,906	4,180,039.74	0.23
94	600019	宝钢股份	581,818	4,072,726.00	0.22
95	600011	华能国际	597,200	4,043,044.00	0.22
96	002179	中航光电	102,300	4,020,390.00	0.22
97	002230	科大讯飞	80,100	3,870,432.00	0.21
98	600028	中国石化	573,800	3,832,984.00	0.21
99	601117	中国化学	457,000	3,788,530.00	0.21
100	688008	澜起科技	54,138	3,675,970.20	0.20
101	002916	深南电路	28,500	3,562,500.00	0.20
102	600027	华电国际	626,300	3,513,543.00	0.19
103	600219	南山铝业	893,900	3,495,149.00	0.19
104	600585	海螺水泥	142,800	3,395,784.00	0.19
105	600741	华域汽车	188,800	3,324,768.00	0.18
106	001979	招商蛇口	319,100	3,267,584.00	0.18
107	601881	中国银河	198,200	3,018,586.00	0.17
108	601225	陕西煤业	126,800	2,949,368.00	0.16
109	300628	亿联网络	75,100	2,898,860.00	0.16
110	002938	鹏鼎控股	79,100	2,885,568.00	0.16
111	688396	华润微	53,562	2,527,590.78	0.14
112	600276	恒瑞医药	54,361	2,495,169.90	0.14
113	002648	卫星化学	131,511	2,471,091.69	0.14
114	300760	迈瑞医疗	9,200	2,346,000.00	0.13
115	601012	隆基绿能	131,900	2,072,149.00	0.11
116	601628	中国人寿	47,900	2,007,968.00	0.11
117	688472	阿特斯	145,872	1,832,152.32	0.10
118	601601	中国太保	50,200	1,710,816.00	0.09
119	601800	中国交建	144,500	1,510,025.00	0.08
120	600188	兖矿能源	105,485	1,494,722.45	0.08

121	601916	浙商银行	500,000	1,455,000.00	0.08
122	600176	中国巨石	125,900	1,434,001.00	0.08
123	002142	宁波银行	57,100	1,388,101.00	0.08
124	300033	同花顺	4,700	1,351,250.00	0.07
125	002920	德赛西威	11,900	1,310,309.00	0.07
126	600919	江苏银行	132,400	1,300,168.00	0.07
127	000100	TCL 科技	254,600	1,280,638.00	0.07
128	000876	新希望	124,500	1,118,010.00	0.06
129	688111	金山办公	3,800	1,088,282.00	0.06
130	600362	江西铜业	51,500	1,062,960.00	0.06
131	000768	中航西飞	37,400	1,056,176.00	0.06
132	600460	士兰微	38,800	1,009,576.00	0.06
133	601336	新华保险	20,000	994,000.00	0.05
134	002236	大华股份	56,000	896,000.00	0.05
135	600372	中航机载	59,000	727,470.00	0.04
136	601658	邮储银行	100,800	572,544.00	0.03
137	002001	新和成	25,284	555,489.48	0.03
138	600482	中国动力	21,300	521,211.00	0.03
139	600489	中金黄金	42,300	508,869.00	0.03
140	000938	紫光股份	16,800	467,544.00	0.03
141	600938	中国海油	14,900	439,699.00	0.02
142	300661	圣邦股份	4,800	392,544.00	0.02
143	000792	盐湖股份	23,200	381,872.00	0.02
144	600600	青岛啤酒	4,500	364,140.00	0.02
145	688012	中微公司	1,500	283,740.00	0.02
146	002555	三七互娱	17,600	275,264.00	0.02
147	688187	时代电气	5,700	273,144.00	0.02
148	688599	天合光能	9,170	176,981.00	0.01
149	600570	恒生电子	4,800	134,352.00	0.01
150	601898	中煤能源	8,800	107,184.00	0.01
151	601901	方正证券	6,400	53,312.00	0.00
152	300502	新易盛	200	23,116.00	0.00
153	600918	中泰证券	2,100	13,797.00	0.00
154	601816	京沪高铁	2,000	12,320.00	0.00
155	600406	国电南瑞	400	10,088.00	0.00
156	300896	爱美客	44	8,030.00	0.00
157	001289	龙源电力	9	141.39	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	002414	高德红外	1,189,470	8,837,762.10	0.49
2	601866	中远海发	3,065,900	8,001,999.00	0.44
3	688469	芯联集成	1,545,939	7,930,667.07	0.44
4	600096	云天化	351,300	7,833,990.00	0.43
5	600582	天地科技	1,238,800	7,655,784.00	0.42
6	000021	深科技	361,300	6,886,378.00	0.38
7	002273	水晶光电	277,900	6,174,938.00	0.34
8	601555	东吴证券	774,300	6,039,540.00	0.33
9	600267	海正药业	688,300	5,712,890.00	0.31
10	600968	海油发展	1,331,900	5,687,213.00	0.31
11	688347	华虹公司	121,077	5,626,448.19	0.31
12	000559	万向钱潮	879,300	5,407,695.00	0.30
13	300373	扬杰科技	123,500	5,374,720.00	0.30
14	000539	粤电力 A	984,200	4,458,426.00	0.25
15	601399	国机重装	1,356,200	4,177,096.00	0.23
16	000783	长江证券	585,700	3,994,474.00	0.22
17	600517	国网英大	720,600	3,970,506.00	0.22
18	601298	青岛港	432,200	3,937,342.00	0.22
19	002396	星网锐捷	200,900	3,815,091.00	0.21
20	601018	宁波港	977,900	3,764,915.00	0.21
21	600380	健康元	316,500	3,566,955.00	0.20
22	002204	大连重工	691,000	3,441,180.00	0.19
23	601991	大唐发电	1,182,000	3,368,700.00	0.19
24	600170	上海建工	1,226,300	3,249,695.00	0.18
25	300079	数码视讯	576,200	3,117,242.00	0.17
26	002489	浙江永强	949,500	3,076,380.00	0.17
27	300039	上海凯宝	443,300	2,739,594.00	0.15
28	002249	大洋电机	459,200	2,695,504.00	0.15
29	301370	国科恒泰	246,700	2,664,360.00	0.15
30	603888	新华网	116,900	2,611,546.00	0.14
31	600812	华北制药	498,800	2,578,796.00	0.14
32	000987	越秀资本	362,600	2,545,452.00	0.14
33	000039	中集集团	291,500	2,264,955.00	0.12
34	002550	千红制药	353,700	2,192,940.00	0.12
35	000883	湖北能源	426,100	2,121,978.00	0.12
36	600703	三安光电	170,800	2,078,636.00	0.11
37	300768	迪普科技	112,800	1,974,000.00	0.11
38	000932	华菱钢铁	471,300	1,970,034.00	0.11
39	688158	优刻得	138,961	1,942,674.78	0.11
40	688099	晶晨股份	28,200	1,936,776.00	0.11
41	600704	物产中大	373,900	1,891,934.00	0.10
42	600210	紫江企业	285,900	1,889,799.00	0.10
43	601608	中信重工	445,600	1,871,520.00	0.10

44	300341	麦克奥迪	103,800	1,817,538.00	0.10
45	688798	艾为电子	25,395	1,773,078.90	0.10
46	000683	远兴能源	298,500	1,668,615.00	0.09
47	600282	南钢股份	348,800	1,635,872.00	0.09
48	600021	上海电力	177,400	1,626,758.00	0.09
49	600710	苏美达	171,200	1,592,160.00	0.09
50	002608	江苏国信	203,400	1,560,078.00	0.09
51	000997	新大陆	77,300	1,542,135.00	0.08
52	603927	中科软	70,700	1,534,190.00	0.08
53	002926	华西证券	177,600	1,475,856.00	0.08
54	000728	国元证券	176,500	1,475,540.00	0.08
55	300454	深信服	25,000	1,435,000.00	0.08
56	002906	华阳集团	46,000	1,414,500.00	0.08
57	601997	贵阳银行	228,200	1,369,200.00	0.08
58	002385	大北农	311,000	1,346,630.00	0.07
59	600098	广州发展	198,500	1,274,370.00	0.07
60	300080	易成新能	273,600	1,195,632.00	0.07
61	300315	掌趣科技	209,700	1,153,350.00	0.06
62	600742	一汽富维	127,900	1,131,915.00	0.06
63	301376	致欧科技	58,400	1,116,608.00	0.06
64	000009	中国宝安	113,300	1,036,695.00	0.06
65	600667	太极实业	146,500	1,013,780.00	0.06
66	000050	深天马 A	111,300	1,005,039.00	0.06
67	600578	京能电力	274,300	965,536.00	0.05
68	300207	欣旺达	42,900	957,099.00	0.05
69	601168	西部矿业	59,200	951,344.00	0.05
70	601369	陕鼓动力	103,400	899,580.00	0.05
71	600779	水井坊	16,200	867,024.00	0.05
72	300722	新余国科	30,889	834,620.78	0.05
73	300618	寒锐钴业	24,600	830,742.00	0.05
74	601106	中国一重	274,400	798,504.00	0.04
75	002185	华天科技	67,700	785,997.00	0.04
76	688088	虹软科技	19,678	758,783.68	0.04
77	603766	隆鑫通用	83,000	755,300.00	0.04
78	002703	浙江世宝	65,800	748,146.00	0.04
79	000921	海信家电	23,900	690,710.00	0.04
80	000966	长源电力	128,100	608,475.00	0.03
81	002293	罗莱生活	77,670	605,826.00	0.03
82	600420	国药现代	50,100	598,194.00	0.03
83	601096	宏盛华源	137,000	595,950.00	0.03
84	301029	怡合达	23,500	580,920.00	0.03
85	002020	京新药业	44,700	572,160.00	0.03
86	300398	飞凯材料	35,200	554,752.00	0.03

87	301221	光庭信息	11,300	548,954.00	0.03
88	300507	苏奥传感	81,500	546,050.00	0.03
89	603000	人民网	23,400	515,736.00	0.03
90	000550	江铃汽车	20,800	487,760.00	0.03
91	300726	宏达电子	15,300	475,830.00	0.03
92	002626	金达威	28,700	433,370.00	0.02
93	002004	华邦健康	90,400	408,608.00	0.02
94	300666	江丰电子	5,600	388,920.00	0.02
95	300919	中伟股份	10,400	375,648.00	0.02
96	601068	中铝国际	84,800	373,968.00	0.02
97	688508	芯朋微	7,700	330,869.00	0.02
98	600909	华安证券	52,600	318,756.00	0.02
99	600866	星湖科技	41,500	268,505.00	0.01
100	000686	东北证券	31,500	250,110.00	0.01
101	688772	珠海冠宇	14,500	233,160.00	0.01
102	000401	冀东水泥	41,500	217,045.00	0.01
103	002151	北斗星通	7,100	188,434.00	0.01
104	300601	康泰生物	10,100	173,215.00	0.01
105	600879	航天电子	18,900	169,344.00	0.01
106	600744	华银电力	50,548	157,204.28	0.01
107	600637	东方明珠	20,200	156,752.00	0.01
108	300215	电科院	26,100	154,773.00	0.01
109	300729	乐歌股份	9,300	147,684.00	0.01
110	300346	南大光电	3,500	135,065.00	0.01
111	002368	太极股份	5,600	132,608.00	0.01
112	300699	光威复材	3,200	110,880.00	0.01
113	002558	巨人网络	7,500	95,175.00	0.01
114	300438	鹏辉能源	3,300	92,763.00	0.01
115	300054	鼎龙股份	3,400	88,468.00	0.00
116	300529	健帆生物	2,800	82,152.00	0.00
117	601828	美凯龙	21,900	70,299.00	0.00
118	300339	润和软件	1,300	65,039.00	0.00
119	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.00
120	000034	神州数码	1,400	49,070.00	0.00
121	300573	兴齐眼药	700	48,846.00	0.00
122	688615	合合信息	289	47,910.42	0.00
123	300459	汤姆猫	8,200	47,068.00	0.00
124	301526	国际复材	12,200	45,140.00	0.00
125	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.00
126	601326	秦港股份	13,300	44,555.00	0.00
127	600998	九州通	8,700	44,544.00	0.00
128	300724	捷佳伟创	700	44,247.00	0.00
129	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00

130	002773	康弘药业	2,100	41,160.00	0.00
131	688029	南微医学	600	40,554.00	0.00
132	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.00
133	300002	神州泰岳	3,400	39,406.00	0.00
134	002145	中核钛白	9,200	39,008.00	0.00
135	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
136	600141	兴发集团	1,700	36,890.00	0.00
137	600583	海油工程	6,100	33,367.00	0.00
138	002008	大族激光	1,300	32,500.00	0.00
139	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
140	300088	长信科技	4,900	32,046.00	0.00
141	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
142	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
143	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.00
144	300531	优博讯	1,700	23,715.00	0.00
145	002376	新北洋	3,400	22,168.00	0.00
146	600497	驰宏锌锗	3,900	21,723.00	0.00
147	600008	首创环保	6,600	21,648.00	0.00
148	002064	华峰化学	2,600	21,268.00	0.00
149	600428	中远海特	2,800	20,440.00	0.00
150	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
151	002549	凯美特气	3,100	19,003.00	0.00
152	300261	雅本化学	2,600	17,810.00	0.00
153	603087	甘李药业	400	17,640.00	0.00
154	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
155	002500	山西证券	2,400	15,072.00	0.00
156	603207	小方制药	533	14,204.45	0.00
157	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
158	688588	凌志软件	900	12,420.00	0.00
159	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
160	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
161	601949	中国出版	1,600	11,488.00	0.00
162	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
163	600352	浙江龙盛	1,100	11,319.00	0.00
164	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
165	688568	中科星图	200	10,206.00	0.00
166	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
167	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
168	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
169	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
170	300682	朗新集团	500	6,100.00	0.00
171	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
172	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00

173	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
174	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
175	688591	泰凌微	57	1,789.80	0.00
176	688209	英集芯	30	530.10	0.00
177	688432	有研硅	42	474.60	0.00
178	600610	中毅达	50	211.50	0.00
179	688425	铁建重工	44	193.60	0.00
180	688128	中国电研	8	168.08	0.00
181	600268	国电南自	12	80.64	0.00
182	002128	电投能源	1	19.58	0.00
183	688586	江航装备	2	19.14	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	600519	贵州茅台	98,866,296.50	65.52
2	300750	宁德时代	90,583,632.42	60.03
3	601318	中国平安	76,016,356.39	50.38
4	000001	平安银行	67,750,874.56	44.90
5	002475	立讯精密	66,881,297.00	44.33
6	000333	美的集团	66,234,375.30	43.90
7	600036	招商银行	66,228,884.60	43.89
8	600276	恒瑞医药	60,839,739.01	40.32
9	601899	紫金矿业	56,195,382.00	37.24
10	000651	格力电器	55,368,490.00	36.70
11	002594	比亚迪	54,106,660.72	35.86
12	601398	工商银行	50,109,881.43	33.21
13	000725	京东方 A	49,898,327.00	33.07
14	600887	伊利股份	49,336,831.00	32.70
15	603259	药明康德	48,113,340.60	31.89
16	601766	中国中车	47,903,257.10	31.75
17	000858	五粮液	47,738,841.53	31.64
18	601138	工业富联	47,271,526.00	31.33
19	601166	兴业银行	46,320,742.00	30.70
20	600690	海尔智家	45,734,405.58	30.31
21	002352	顺丰控股	45,027,692.00	29.84
22	000063	中兴通讯	44,999,562.00	29.82
23	601728	中国电信	44,431,937.75	29.45
24	601857	中国石油	44,007,057.00	29.17
25	003816	中国广核	43,311,614.27	28.70

26	601633	长城汽车	43,107,108.93	28.57
27	601988	中国银行	42,206,473.00	27.97
28	601088	中国神华	42,177,432.00	27.95
29	600309	万华化学	42,047,615.99	27.87
30	600050	中国联通	41,848,567.00	27.74
31	600941	中国移动	41,488,912.00	27.50
32	601288	农业银行	41,439,616.00	27.46
33	601939	建设银行	41,284,827.03	27.36
34	601628	中国人寿	41,252,733.00	27.34
35	601668	中国建筑	41,166,331.00	27.28
36	002415	海康威视	40,918,435.00	27.12
37	688041	海光信息	40,745,409.67	27.00
38	300433	蓝思科技	40,309,751.00	26.72
39	600900	长江电力	39,947,539.00	26.48
40	600809	山西汾酒	39,794,950.99	26.37
41	300015	爱尔眼科	39,748,746.20	26.34
42	603501	韦尔股份	39,246,201.31	26.01
43	600104	上汽集团	38,150,951.60	25.28
44	600028	中国石化	37,881,984.00	25.11
45	600030	中信证券	37,773,087.96	25.03
46	688981	中芯国际	37,581,190.72	24.91
47	002001	新和成	37,380,727.52	24.77
48	000568	泸州老窖	37,226,670.00	24.67
49	000963	华东医药	36,895,481.23	24.45
50	601818	光大银行	36,767,363.00	24.37
51	601919	中远海控	36,319,463.00	24.07
52	300059	东方财富	36,258,971.00	24.03
53	601328	交通银行	36,138,369.28	23.95
54	600015	华夏银行	36,062,481.16	23.90
55	603288	海天味业	35,101,096.95	23.26
56	600018	上港集团	34,252,350.00	22.70
57	601229	上海银行	34,241,516.88	22.69
58	300014	亿纬锂能	34,234,255.40	22.69
59	601600	中国铝业	33,722,817.00	22.35
60	601169	北京银行	33,536,189.20	22.23
61	600016	民生银行	32,771,503.00	21.72
62	600875	东方电气	32,360,956.33	21.45
63	600019	宝钢股份	32,339,606.00	21.43
64	000938	紫光股份	32,328,371.00	21.43
65	601319	中国人保	31,554,340.69	20.91
66	601186	中国铁建	31,259,231.48	20.72
67	600031	三一重工	31,171,339.00	20.66
68	000338	潍柴动力	31,146,988.40	20.64

69	601601	中国太保	30,580,787.52	20.27
70	300760	迈瑞医疗	30,457,299.00	20.19
71	000617	中油资本	30,138,860.00	19.97
72	601688	华泰证券	30,112,833.00	19.96
73	002714	牧原股份	29,773,576.20	19.73
74	600096	云天化	29,754,690.10	19.72
75	601336	新华保险	29,542,090.09	19.58
76	000977	浪潮信息	29,478,305.00	19.54
77	002027	分众传媒	29,388,320.52	19.48
78	600795	国电电力	29,343,165.00	19.45
79	603986	兆易创新	28,832,364.20	19.11
80	601658	邮储银行	28,558,905.00	18.93
81	603993	洛阳钼业	28,186,459.00	18.68
82	601225	陕西煤业	28,103,419.00	18.63
83	002241	歌尔股份	27,341,821.00	18.12
84	601390	中国中铁	27,197,934.76	18.03
85	601877	正泰电器	26,790,808.00	17.76
86	300498	温氏股份	26,741,633.21	17.72
87	600919	江苏银行	26,511,543.00	17.57
88	000166	申万宏源	26,213,767.60	17.37
89	600183	生益科技	26,069,432.05	17.28
90	300124	汇川技术	25,957,774.00	17.20
91	002371	北方华创	25,857,626.24	17.14
92	600023	浙能电力	25,621,052.00	16.98
93	600958	东方证券	25,373,219.44	16.82
94	600999	招商证券	25,255,940.00	16.74
95	300999	金龙鱼	25,022,541.46	16.58
96	600196	复星医药	24,890,971.68	16.50
97	002230	科大讯飞	24,406,452.00	16.18
98	002736	国信证券	24,342,317.00	16.13
99	601888	中国中免	24,304,737.00	16.11
100	600406	国电南瑞	24,263,181.60	16.08
101	601985	中国核电	24,114,824.00	15.98
102	000876	新希望	23,973,554.00	15.89
103	000559	万向钱潮	23,683,077.60	15.70
104	002916	深南电路	23,312,724.00	15.45
105	000776	广发证券	23,159,474.25	15.35
106	601669	中国电建	23,151,769.00	15.34
107	688009	中国通号	23,058,827.22	15.28
108	002249	大洋电机	23,058,229.01	15.28
109	688111	金山办公	22,812,070.01	15.12
110	600582	天地科技	22,773,758.00	15.09
111	002180	纳思达	22,611,644.00	14.99

112	603799	华友钴业	22,565,836.00	14.96
113	600362	江西铜业	22,517,669.00	14.92
114	600267	海正药业	22,238,848.00	14.74
115	600660	福耀玻璃	22,054,253.00	14.62
116	002414	高德红外	22,038,242.92	14.61
117	002142	宁波银行	21,950,437.70	14.55
118	600268	国电南自	21,867,790.75	14.49
119	002410	广联达	21,838,846.40	14.47
120	601998	中信银行	21,830,467.00	14.47
121	688347	华虹公司	21,445,445.40	14.21
122	000425	徐工机械	21,389,678.00	14.18
123	600741	华域汽车	21,362,625.00	14.16
124	601012	隆基绿能	21,194,691.00	14.05
125	688008	澜起科技	20,611,512.57	13.66
126	600011	华能国际	20,209,987.00	13.39
127	300408	三环集团	19,610,536.10	13.00
128	002422	科伦药业	19,573,579.00	12.97
129	002120	韵达股份	19,399,932.00	12.86
130	300274	阳光电源	19,364,184.85	12.83
131	600585	海螺水泥	19,148,580.00	12.69
132	000895	双汇发展	19,123,105.00	12.67
133	002236	大华股份	18,894,668.00	12.52
134	300759	康龙化成	18,820,909.50	12.47
135	600170	上海建工	18,522,459.00	12.28
136	601618	中国中冶	18,265,681.00	12.11
137	601881	中国银河	18,091,234.00	11.99
138	600160	巨化股份	18,005,021.00	11.93
139	000830	鲁西化工	17,762,442.00	11.77
140	002938	鹏鼎控股	17,548,902.00	11.63
141	601800	中国交建	17,506,523.00	11.60
142	601698	中国卫通	16,988,638.00	11.26
143	600760	中航沈飞	16,850,669.86	11.17
144	600048	保利发展	16,816,997.00	11.15
145	000021	深科技	16,594,566.00	11.00
146	600380	健康元	16,594,072.00	11.00
147	600602	云赛智联	16,461,313.00	10.91
148	601106	中国一重	16,353,632.00	10.84
149	600703	三安光电	16,350,938.00	10.84
150	600188	兖矿能源	15,979,927.50	10.59
151	600812	华北制药	15,816,626.00	10.48
152	600600	青岛啤酒	15,729,411.00	10.42
153	601238	广汽集团	15,586,073.00	10.33
154	600489	中金黄金	15,578,635.57	10.32

155	300442	润泽科技	15,555,086.00	10.31
156	600219	南山铝业	15,529,498.00	10.29
157	000596	古井贡酒	15,497,824.00	10.27
158	300033	同花顺	15,494,980.61	10.27
159	688223	晶科能源	15,243,873.90	10.10
160	601018	宁波港	15,162,334.00	10.05
161	002920	德赛西威	14,724,045.00	9.76
162	603533	掌阅科技	14,677,391.00	9.73
163	601006	大秦铁路	14,454,333.00	9.58
164	002020	京新药业	14,383,927.00	9.53
165	601059	信达证券	14,379,128.00	9.53
166	600926	杭州银行	14,232,988.80	9.43
167	000050	深天马 A	14,215,161.00	9.42
168	000157	中联重科	14,030,065.00	9.30
169	601212	白银有色	13,939,931.00	9.24
170	601555	东吴证券	13,906,715.00	9.22
171	002459	晶澳科技	13,869,195.00	9.19
172	601991	大唐发电	13,845,177.00	9.18
173	000807	云铝股份	13,831,487.00	9.17
174	002292	奥飞娱乐	13,706,520.00	9.08
175	600517	国网英大	13,701,545.00	9.08
176	000661	长春高新	13,654,129.00	9.05
177	600332	白云山	13,570,457.00	8.99
178	001289	龙源电力	13,508,386.66	8.95
179	688363	华熙生物	13,479,290.74	8.93
180	600745	闻泰科技	13,465,251.34	8.92
181	002311	海大集团	13,203,804.00	8.75
182	688396	华润微	13,137,324.55	8.71
183	000100	TCL 科技	13,102,817.40	8.68
184	600436	片仔癀	13,089,665.00	8.68
185	600372	中航机载	13,073,353.83	8.66
186	600918	中泰证券	13,049,027.00	8.65
187	601168	西部矿业	13,008,075.00	8.62
188	603198	迎驾贡酒	12,884,993.16	8.54
189	600027	华电国际	12,736,464.00	8.44
190	002468	申通快递	12,602,864.00	8.35
191	002340	格林美	12,584,473.45	8.34
192	300454	深信服	12,437,571.68	8.24
193	000538	云南白药	12,366,880.60	8.20
194	601061	中信金属	12,337,823.00	8.18
195	300641	正丹股份	11,925,834.00	7.90
196	600968	海油发展	11,862,943.00	7.86
197	688472	阿特斯	11,839,623.62	7.85

198	300768	迪普科技	11,766,947.00	7.80
199	002152	广电运通	11,763,405.00	7.80
200	603296	华勤技术	11,719,532.60	7.77
201	600025	华能水电	11,703,640.81	7.76
202	600588	用友网络	11,575,389.00	7.67
203	301025	读客文化	11,573,696.00	7.67
204	300373	扬杰科技	11,530,748.00	7.64
205	600482	中国动力	11,529,569.00	7.64
206	002284	亚太股份	11,528,232.00	7.64
207	000401	冀东水泥	11,520,220.00	7.64
208	000039	中集集团	11,423,685.00	7.57
209	601236	红塔证券	11,414,712.00	7.57
210	601117	中国化学	11,281,297.00	7.48
211	002550	千红制药	10,990,712.00	7.28
212	601866	中远海发	10,979,601.00	7.28
213	688208	道通科技	10,845,520.07	7.19
214	002555	三七互娱	10,789,900.00	7.15
215	688728	格科微	10,716,453.85	7.10
216	002841	视源股份	10,667,800.00	7.07
217	002673	西部证券	10,642,737.00	7.05
218	601816	京沪高铁	10,567,056.00	7.00
219	601399	国机重装	10,472,974.00	6.94
220	601689	拓普集团	10,455,160.60	6.93
221	600428	中远海特	10,430,149.00	6.91
222	300232	洲明科技	10,403,260.25	6.89
223	002378	章源钨业	10,394,777.00	6.89
224	688088	虹软科技	10,389,490.95	6.89
225	600893	航发动力	10,376,197.00	6.88
226	300229	拓尔思	10,308,317.00	6.83
227	688313	仕佳光子	10,204,442.01	6.76
228	000999	华润三九	10,198,310.70	6.76
229	000009	中国宝安	10,161,765.00	6.73
230	000783	长江证券	10,127,612.00	6.71
231	002886	沃特股份	10,038,434.00	6.65
232	002455	百川股份	9,947,545.00	6.59
233	600271	航天信息	9,908,436.00	6.57
234	000625	长安汽车	9,855,824.70	6.53
235	600497	驰宏锌锗	9,787,362.42	6.49
236	002385	大北农	9,786,751.00	6.49
237	002179	中航光电	9,765,936.00	6.47
238	300529	健帆生物	9,756,227.00	6.47
239	601898	中煤能源	9,709,782.00	6.44
240	002906	华阳集团	9,593,206.00	6.36

241	601068	中铝国际	9,549,678.00	6.33
242	000800	一汽解放	9,345,989.00	6.19
243	300308	中际旭创	9,302,089.00	6.16
244	600584	长电科技	9,245,374.00	6.13
245	688252	天德钰	9,184,531.21	6.09
246	600021	上海电力	9,171,659.00	6.08
247	600233	圆通速递	9,140,115.00	6.06
248	002926	华西证券	9,119,620.00	6.04
249	600150	中国船舶	9,119,567.00	6.04
250	688591	泰凌微	9,065,351.49	6.01
251	688469	芯联集成	9,010,121.45	5.97
252	002648	卫星化学	8,987,162.00	5.96
253	300628	亿联网络	8,936,078.38	5.92
254	300351	永贵电器	8,863,422.00	5.87
255	300661	圣邦股份	8,840,145.00	5.86
256	002636	金安国纪	8,833,070.00	5.85
257	002273	水晶光电	8,771,987.00	5.81
258	002537	海联金汇	8,763,548.00	5.81
259	600500	中化国际	8,651,580.00	5.73
260	002632	道明光学	8,643,901.00	5.73
261	600744	华银电力	8,640,135.00	5.73
262	000539	粤电力 A	8,631,421.00	5.72
263	600667	太极实业	8,571,995.00	5.68
264	000786	北新建材	8,536,353.00	5.66
265	600210	紫江企业	8,535,784.00	5.66
266	603025	大豪科技	8,350,983.60	5.53
267	002946	新乳业	8,342,778.00	5.53
268	600789	鲁抗医药	8,323,421.00	5.52
269	300766	每日互动	8,292,292.00	5.50
270	000729	燕京啤酒	8,264,117.00	5.48
271	002612	朗姿股份	8,220,569.00	5.45
272	600066	宇通客车	8,206,205.00	5.44
273	603888	新华网	8,187,515.00	5.43
274	603517	绝味食品	8,166,401.00	5.41
275	600098	广州发展	8,159,734.00	5.41
276	601377	兴业证券	8,113,224.00	5.38
277	000060	中金岭南	8,038,227.00	5.33
278	600623	华谊集团	8,028,500.00	5.32
279	600089	特变电工	7,936,517.00	5.26
280	601136	首创证券	7,935,149.00	5.26
281	600886	国投电力	7,929,685.00	5.26
282	300595	欧普康视	7,872,333.60	5.22
283	300684	中石科技	7,862,930.00	5.21

284	301165	锐捷网络	7,806,559.00	5.17
285	688183	生益电子	7,738,848.80	5.13
286	601878	浙商证券	7,726,756.00	5.12
287	000930	中粮科技	7,634,685.00	5.06
288	002558	巨人网络	7,506,113.00	4.97
289	300660	江苏雷利	7,504,658.00	4.97
290	600438	通威股份	7,495,367.00	4.97
291	300079	数码视讯	7,487,039.00	4.96
292	002601	龙佰集团	7,481,598.00	4.96
293	600143	金发科技	7,462,813.00	4.95
294	688362	甬矽电子	7,397,665.17	4.90
295	300233	金城医药	7,342,843.17	4.87
296	000969	安泰科技	7,331,490.00	4.86
297	300913	兆龙互连	7,320,754.00	4.85
298	601997	贵阳银行	7,311,474.00	4.85
299	002396	星网锐捷	7,274,763.00	4.82
300	300463	迈克生物	7,262,206.56	4.81
301	600989	宝丰能源	7,183,345.00	4.76
302	600663	陆家嘴	7,114,249.64	4.71
303	002493	荣盛石化	7,046,523.00	4.67
304	300017	网宿科技	7,040,445.00	4.67
305	600420	国药现代	7,005,171.07	4.64
306	600335	国机汽车	7,000,481.00	4.64
307	600062	华润双鹤	6,998,337.00	4.64
308	603228	景旺电子	6,980,112.64	4.63
309	002562	兄弟科技	6,945,480.00	4.60
310	600061	国投资本	6,944,331.00	4.60
311	300896	爱美客	6,918,932.04	4.59
312	301029	怡合达	6,904,002.20	4.58
313	300413	芒果超媒	6,847,119.00	4.54
314	002423	中粮资本	6,847,049.00	4.54
315	600351	亚宝药业	6,833,631.66	4.53
316	600835	上海机电	6,813,136.00	4.52
317	600637	东方明珠	6,797,827.00	4.51
318	601066	中信建投	6,753,832.00	4.48
319	000708	中信特钢	6,711,974.00	4.45
320	000630	铜陵有色	6,696,387.00	4.44
321	601607	上海医药	6,634,986.28	4.40
322	603056	德邦股份	6,602,250.00	4.38
323	002036	联创电子	6,591,604.00	4.37
324	300039	上海凯宝	6,585,618.00	4.36
325	600161	天坛生物	6,570,630.20	4.35
326	002970	锐明技术	6,554,311.00	4.34

327	002151	北斗星通	6,544,803.01	4.34
328	601187	厦门银行	6,469,042.00	4.29
329	600223	福瑞达	6,458,585.00	4.28
330	688036	传音控股	6,456,666.89	4.28
331	300558	贝达药业	6,432,321.00	4.26
332	001979	招商蛇口	6,370,810.00	4.22
333	603345	安井食品	6,359,067.00	4.21
334	301370	国科恒泰	6,336,954.00	4.20
335	300113	顺网科技	6,309,174.00	4.18
336	603118	共进股份	6,276,177.00	4.16
337	600578	京能电力	6,221,879.00	4.12
338	600468	百利电气	6,215,739.00	4.12
339	603328	依顿电子	6,127,751.00	4.06
340	301301	川宁生物	6,124,974.00	4.06
341	600938	中国海油	6,064,152.00	4.02
342	002271	东方雨虹	6,056,885.00	4.01
343	600498	烽火通信	6,053,125.00	4.01
344	300957	贝泰妮	6,050,574.00	4.01
345	300369	绿盟科技	6,023,288.00	3.99
346	300722	新余国科	6,022,861.00	3.99
347	601608	中信重工	6,015,230.00	3.99
348	600549	厦门钨业	5,967,896.00	3.96
349	688586	江航装备	5,897,885.10	3.91
350	000997	新大陆	5,893,568.99	3.91
351	603317	天味食品	5,867,981.60	3.89
352	600531	豫光金铅	5,814,782.00	3.85
353	601298	青岛港	5,788,363.00	3.84
354	000002	万科 A	5,785,681.00	3.83
355	002050	三花智控	5,718,078.00	3.79
356	002281	光迅科技	5,660,601.28	3.75
357	300496	中科创达	5,641,574.00	3.74
358	600718	东软集团	5,620,256.40	3.72
359	002489	浙江永强	5,601,561.00	3.71
360	002563	森马服饰	5,592,944.00	3.71
361	603392	万泰生物	5,579,197.90	3.70
362	300215	电科院	5,566,203.00	3.69
363	300738	奥飞数据	5,536,977.00	3.67
364	000728	国元证券	5,536,967.56	3.67
365	000636	风华高科	5,536,624.00	3.67
366	300533	冰川网络	5,532,981.50	3.67
367	605499	东鹏饮料	5,507,170.00	3.65
368	601615	明阳智能	5,494,429.00	3.64
369	000878	云南铜业	5,462,898.00	3.62

370	688798	艾为电子	5,455,616.99	3.62
371	002293	罗莱生活	5,424,391.00	3.60
372	603893	瑞芯微	5,418,016.00	3.59
373	601916	浙商银行	5,401,569.00	3.58
374	000756	新华制药	5,378,525.42	3.56
375	300975	商络电子	5,358,387.00	3.55
376	002202	金风科技	5,307,305.80	3.52
377	002125	湘潭电化	5,298,157.00	3.51
378	601456	国联证券	5,282,833.00	3.50
379	603659	璞泰来	5,275,945.00	3.50
380	600928	西安银行	5,268,388.00	3.49
381	300978	东箭科技	5,261,970.50	3.49
382	002128	电投能源	5,226,923.63	3.46
383	601231	环旭电子	5,222,379.00	3.46
384	300207	欣旺达	5,209,584.00	3.45
385	601101	昊华能源	5,155,674.00	3.42
386	300919	中伟股份	5,149,774.20	3.41
387	600346	恒力石化	5,113,440.00	3.39
388	603195	公牛集团	5,111,133.00	3.39
389	601311	骆驼股份	5,105,233.00	3.38
390	002204	大连重工	5,102,916.00	3.38
391	601179	中国西电	5,087,680.00	3.37
392	000932	华菱钢铁	5,072,907.00	3.36
393	603171	税友股份	5,072,665.00	3.36
394	000987	越秀资本	5,071,428.00	3.36
395	300341	麦克奥迪	5,027,972.00	3.33
396	603013	亚普股份	4,991,755.00	3.31
397	603806	福斯特	4,967,869.60	3.29
398	001965	招商公路	4,967,248.00	3.29
399	300579	数字认证	4,929,582.00	3.27
400	300398	飞凯材料	4,924,263.00	3.26
401	688484	南芯科技	4,868,787.60	3.23
402	601699	潞安环能	4,864,563.00	3.22
403	002384	东山精密	4,860,993.00	3.22
404	688128	中国电研	4,823,249.47	3.20
405	603299	苏盐井神	4,801,660.00	3.18
406	002074	国轩高科	4,799,750.00	3.18
407	300424	航新科技	4,799,398.60	3.18
408	300136	信维通信	4,756,000.00	3.15
409	600629	华建集团	4,750,913.00	3.15
410	688400	凌云光	4,727,056.31	3.13
411	000921	海信家电	4,705,612.00	3.12
412	600236	桂冠电力	4,696,606.00	3.11

413	300024	机器人	4,677,789.00	3.10
414	601872	招商轮船	4,675,735.00	3.10
415	603766	隆鑫通用	4,632,871.00	3.07
416	601228	广州港	4,615,013.00	3.06
417	000825	太钢不锈	4,606,298.36	3.05
418	300206	理邦仪器	4,567,628.50	3.03
419	300142	沃森生物	4,534,098.00	3.00
420	002185	华天科技	4,489,797.00	2.98
421	600409	三友化工	4,489,712.00	2.98
422	002011	盾安环境	4,487,512.00	2.97
423	300101	振芯科技	4,477,753.00	2.97
424	300634	彩讯股份	4,449,514.00	2.95
425	603915	国茂股份	4,447,771.00	2.95
426	600776	东方通信	4,446,977.00	2.95
427	002925	盈趣科技	4,442,851.00	2.94
428	600017	日照港	4,433,593.00	2.94
429	002511	中顺洁柔	4,429,895.00	2.94
430	300316	晶盛机电	4,401,850.00	2.92
431	300601	康泰生物	4,400,057.00	2.92
432	601577	长沙银行	4,390,334.00	2.91
433	000792	盐湖股份	4,372,774.00	2.90
434	300315	掌趣科技	4,364,528.00	2.89
435	002245	蔚蓝锂芯	4,355,092.60	2.89
436	600101	明星电力	4,336,553.00	2.87
437	000768	中航西飞	4,310,142.00	2.86
438	300160	秀强股份	4,307,853.00	2.86
439	600699	均胜电子	4,282,147.00	2.84
440	603256	宏和科技	4,239,608.00	2.81
441	600909	华安证券	4,237,588.00	2.81
442	600803	新奥股份	4,186,413.00	2.77
443	600141	兴发集团	4,166,559.00	2.76
444	002139	拓邦股份	4,131,242.00	2.74
445	600315	上海家化	4,126,290.00	2.73
446	601108	财通证券	4,100,353.00	2.72
447	601609	金田股份	4,090,516.00	2.71
448	002056	横店东磁	4,053,667.00	2.69
449	600704	物产中大	4,050,396.00	2.68
450	600979	广安爱众	4,034,248.00	2.67
451	688588	凌志软件	4,030,270.14	2.67
452	002945	华林证券	3,875,301.13	2.57
453	002237	恒邦股份	3,838,015.00	2.54
454	300832	新产业	3,817,979.00	2.53
455	600176	中国巨石	3,805,827.00	2.52

456	600619	海立股份	3,749,188.00	2.48
457	002565	顺灏股份	3,742,352.00	2.48
458	600863	内蒙华电	3,694,113.00	2.45
459	002797	第一创业	3,687,019.00	2.44
460	601696	中银证券	3,680,822.00	2.44
461	002907	华森制药	3,641,940.00	2.41
462	000683	远兴能源	3,627,582.00	2.40
463	600460	士兰微	3,596,887.00	2.38
464	002649	博彦科技	3,592,950.00	2.38
465	300082	奥克股份	3,577,205.00	2.37
466	603019	中科曙光	3,556,396.00	2.36
467	300409	道氏技术	3,544,837.00	2.35
468	002603	以岭药业	3,522,103.00	2.33
469	301297	富乐德	3,521,618.69	2.33
470	600026	中远海能	3,508,857.00	2.33
471	600742	一汽富维	3,493,366.00	2.32
472	300755	华致酒行	3,470,155.00	2.30
473	002032	苏泊尔	3,468,761.00	2.30
474	002539	云图控股	3,466,147.00	2.30
475	688209	英集芯	3,424,052.61	2.27
476	002004	华邦健康	3,405,012.00	2.26
477	002519	银河电子	3,386,277.00	2.24
478	300648	星云股份	3,356,561.00	2.22
479	000960	锡业股份	3,336,214.00	2.21
480	002626	金达威	3,334,817.00	2.21
481	603927	中科软	3,329,442.60	2.21
482	603127	昭衍新药	3,319,369.00	2.20
483	301260	格力博	3,307,685.00	2.19
484	300159	新研股份	3,300,135.00	2.19
485	603883	老百姓	3,293,919.60	2.18
486	600754	锦江酒店	3,270,863.00	2.17
487	002010	传化智联	3,254,568.63	2.16
488	301175	中科环保	3,253,409.00	2.16
489	600985	淮北矿业	3,245,174.00	2.15
490	300458	全志科技	3,223,413.00	2.14
491	000850	华茂股份	3,216,628.00	2.13
492	600299	安迪苏	3,209,380.00	2.13
493	300735	光弘科技	3,208,777.00	2.13
494	300880	迦南智能	3,205,139.00	2.12
495	301500	飞南资源	3,203,162.00	2.12
496	002106	莱宝高科	3,188,371.00	2.11
497	600073	光明肉业	3,156,902.00	2.09
498	600038	中直股份	3,156,698.00	2.09

499	002320	海峡股份	3,147,658.00	2.09
500	001227	兰州银行	3,146,032.00	2.09
501	002897	意华股份	3,127,161.00	2.07
502	001213	中铁特货	3,118,361.84	2.07
503	600426	华鲁恒升	3,108,448.00	2.06
504	600609	金杯汽车	3,107,368.00	2.06
505	300255	常山药业	3,096,642.00	2.05
506	301078	孩子王	3,073,087.00	2.04
507	601788	光大证券	3,072,766.00	2.04
508	000550	江铃汽车	3,071,145.00	2.04
509	688249	晶合集成	3,067,482.23	2.03
510	601116	三江购物	3,038,956.00	2.01
511	300699	光威复材	3,027,216.60	2.01

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	600276	恒瑞医药	60,324,838.45	39.98
2	002475	立讯精密	50,468,221.78	33.45
3	300750	宁德时代	49,490,996.50	32.80
4	000001	平安银行	46,348,482.93	30.72
5	000651	格力电器	45,010,967.00	29.83
6	601398	工商银行	42,719,882.38	28.31
7	002001	新和成	41,528,899.80	27.52
8	688041	海光信息	41,273,910.67	27.35
9	600104	上汽集团	40,283,868.08	26.70
10	601628	中国人寿	40,143,004.00	26.60
11	000063	中兴通讯	38,481,259.00	25.50
12	600690	海尔智家	37,040,403.00	24.55
13	601166	兴业银行	36,676,294.00	24.31
14	002594	比亚迪	36,541,086.40	24.22
15	600028	中国石化	36,003,791.18	23.86
16	000333	美的集团	35,937,434.20	23.82
17	600519	贵州茅台	35,685,716.00	23.65
18	601668	中国建筑	35,579,165.80	23.58
19	002352	顺丰控股	35,528,478.00	23.55
20	000938	紫光股份	35,431,344.40	23.48
21	600030	中信证券	35,249,895.25	23.36
22	601229	上海银行	34,758,720.34	23.04
23	601088	中国神华	33,649,802.96	22.30

24	600036	招商银行	33,516,257.00	22.21
25	000963	华东医药	32,941,950.50	21.83
26	601336	新华保险	32,488,769.00	21.53
27	601318	中国平安	32,383,330.00	21.46
28	601288	农业银行	32,381,242.00	21.46
29	600309	万华化学	32,344,379.63	21.44
30	601728	中国电信	32,037,285.25	21.23
31	601939	建设银行	31,917,351.38	21.15
32	601601	中国太保	31,540,894.00	20.90
33	601328	交通银行	31,373,790.86	20.79
34	601319	中国人保	31,247,515.00	20.71
35	000568	泸州老窖	30,979,884.74	20.53
36	002415	海康威视	30,850,211.56	20.45
37	003816	中国广核	30,830,417.43	20.43
38	601899	紫金矿业	30,751,849.00	20.38
39	600018	上港集团	29,625,623.00	19.63
40	300760	迈瑞医疗	29,551,232.00	19.59
41	600019	宝钢股份	29,298,452.20	19.42
42	300059	东方财富	29,090,020.94	19.28
43	601658	邮储银行	28,656,035.00	18.99
44	600050	中国联通	28,560,854.00	18.93
45	600183	生益科技	28,192,478.77	18.68
46	000977	浪潮信息	28,029,584.89	18.58
47	600031	三一重工	27,944,299.00	18.52
48	601138	工业富联	27,674,341.00	18.34
49	601988	中国银行	27,291,203.00	18.09
50	600809	山西汾酒	27,207,795.00	18.03
51	600919	江苏银行	26,732,729.00	17.72
52	002410	广联达	26,495,065.20	17.56
53	002241	歌尔股份	26,459,231.08	17.54
54	601985	中国核电	26,268,863.00	17.41
55	601633	长城汽车	26,076,581.00	17.28
56	601766	中国中车	25,977,651.00	17.22
57	603259	药明康德	25,738,527.30	17.06
58	002714	牧原股份	25,640,068.80	16.99
59	000858	五粮液	25,637,035.74	16.99
60	000338	潍柴动力	25,558,272.80	16.94
61	601225	陕西煤业	25,316,776.00	16.78
62	600406	国电南瑞	25,273,433.72	16.75
63	603288	海天味业	25,165,844.89	16.68
64	603501	韦尔股份	24,899,514.70	16.50
65	300433	蓝思科技	24,884,637.40	16.49
66	601186	中国铁建	24,488,381.43	16.23

67	601998	中信银行	24,427,141.60	16.19
68	000725	京东方 A	24,364,121.00	16.15
69	601888	中国中免	24,341,677.83	16.13
70	600941	中国移动	24,017,662.66	15.92
71	600268	国电南自	23,669,939.49	15.69
72	600015	华夏银行	23,636,775.20	15.67
73	688981	中芯国际	23,172,984.24	15.36
74	603993	洛阳钼业	23,117,847.00	15.32
75	600660	福耀玻璃	23,001,839.76	15.24
76	601877	正泰电器	22,813,207.80	15.12
77	002180	纳思达	22,596,187.16	14.98
78	002230	科大讯飞	22,133,009.00	14.67
79	000876	新希望	22,093,762.00	14.64
80	600096	云天化	21,929,838.62	14.53
81	688111	金山办公	21,882,640.03	14.50
82	300015	爱尔眼科	21,815,898.46	14.46
83	601857	中国石油	21,661,969.00	14.36
84	600362	江西铜业	21,654,117.00	14.35
85	600900	长江电力	21,304,823.00	14.12
86	002142	宁波银行	21,250,629.42	14.08
87	601818	光大银行	21,072,637.00	13.97
88	002916	深南电路	20,968,948.00	13.90
89	002249	大洋电机	20,938,241.64	13.88
90	600016	民生银行	20,900,461.80	13.85
91	002371	北方华创	20,862,468.72	13.83
92	002120	韵达股份	20,692,013.00	13.71
93	600795	国电电力	20,506,641.00	13.59
94	002027	分众传媒	20,172,388.56	13.37
95	603986	兆易创新	20,116,264.00	13.33
96	300498	温氏股份	20,096,544.00	13.32
97	000559	万向钱潮	20,048,206.20	13.29
98	600023	浙能电力	20,021,588.50	13.27
99	300999	金龙鱼	19,985,479.32	13.25
100	601688	华泰证券	19,950,354.00	13.22
101	002422	科伦药业	19,906,861.00	13.19
102	600887	伊利股份	19,857,776.00	13.16
103	300408	三环集团	19,564,246.00	12.97
104	601169	北京银行	19,537,960.92	12.95
105	601698	中国卫通	19,316,229.00	12.80
106	002236	大华股份	19,284,861.00	12.78
107	601600	中国铝业	18,774,148.28	12.44
108	600741	华域汽车	18,488,299.00	12.25
109	600958	东方证券	18,086,400.00	11.99

110	000830	鲁西化工	18,024,035.00	11.95
111	601669	中国电建	17,952,622.00	11.90
112	600602	云赛智联	17,847,663.00	11.83
113	600048	保利发展	17,778,369.00	11.78
114	601919	中远海控	17,706,784.00	11.74
115	600760	中航沈飞	17,648,033.14	11.70
116	601390	中国中铁	17,631,466.84	11.69
117	601012	隆基绿能	17,445,703.00	11.56
118	300124	汇川技术	17,180,694.00	11.39
119	600160	巨化股份	17,062,052.81	11.31
120	600875	东方电气	17,004,336.25	11.27
121	688008	澜起科技	16,840,026.99	11.16
122	688347	华虹公司	16,616,998.92	11.01
123	002736	国信证券	16,545,452.00	10.97
124	688009	中国通号	16,243,277.30	10.77
125	300442	润泽科技	16,116,077.00	10.68
126	600267	海正药业	16,077,784.31	10.66
127	601238	广汽集团	16,055,626.00	10.64
128	601800	中国交建	16,003,615.00	10.61
129	600600	青岛啤酒	15,935,136.00	10.56
130	600582	天地科技	15,913,734.87	10.55
131	002938	鹏鼎控股	15,810,831.00	10.48
132	600170	上海建工	15,767,175.15	10.45
133	000425	徐工机械	15,622,861.00	10.35
134	600489	中金黄金	15,448,148.65	10.24
135	600585	海螺水泥	15,336,119.00	10.16
136	603533	掌阅科技	15,288,479.00	10.13
137	601881	中国银河	15,268,034.00	10.12
138	000596	古井贡酒	15,157,676.00	10.05
139	600011	华能国际	15,051,027.00	9.98
140	601059	信达证券	15,008,687.00	9.95
141	600926	杭州银行	14,836,153.80	9.83
142	603799	华友钴业	14,764,113.00	9.78
143	601006	大秦铁路	14,508,880.00	9.62
144	600188	兖矿能源	14,442,494.00	9.57
145	002152	广电运通	14,104,670.10	9.35
146	601106	中国一重	14,049,430.00	9.31
147	300033	同花顺	14,035,575.00	9.30
148	002311	海大集团	13,859,592.00	9.19
149	600703	三安光电	13,801,900.20	9.15
150	000661	长春高新	13,747,231.00	9.11
151	002020	京新药业	13,743,910.00	9.11
152	000807	云铝股份	13,739,913.44	9.11

153	000100	TCL 科技	13,713,518.90	9.09
154	600999	招商证券	13,688,512.10	9.07
155	002292	奥飞娱乐	13,651,388.00	9.05
156	600918	中泰证券	13,631,998.00	9.03
157	000157	中联重科	13,611,498.00	9.02
158	600380	健康元	13,604,172.65	9.02
159	601212	白银有色	13,513,966.00	8.96
160	600332	白云山	13,474,013.00	8.93
161	300759	康龙化成	13,436,158.50	8.90
162	300014	亿纬锂能	13,422,911.00	8.90
163	001289	龙源电力	13,422,889.91	8.90
164	688363	华熙生物	13,405,479.37	8.88
165	600436	片仔癀	13,395,863.00	8.88
166	600745	闻泰科技	13,294,765.00	8.81
167	600812	华北制药	13,141,811.00	8.71
168	300641	正丹股份	13,055,977.00	8.65
169	002920	德赛西威	13,030,575.78	8.64
170	000050	深天马 A	12,995,513.00	8.61
171	600588	用友网络	12,824,234.00	8.50
172	603198	迎驾贡酒	12,738,629.38	8.44
173	000617	中油资本	12,712,734.00	8.43
174	002340	格林美	12,711,878.12	8.42
175	601061	中信金属	12,578,464.00	8.34
176	000538	云南白药	12,546,728.40	8.32
177	601236	红塔证券	12,502,604.80	8.29
178	002468	申通快递	12,359,283.00	8.19
179	600372	中航机载	12,289,245.80	8.14
180	600219	南山铝业	12,288,836.00	8.14
181	002414	高德红外	12,288,331.37	8.14
182	000776	广发证券	12,284,557.00	8.14
183	600196	复星医药	12,104,343.00	8.02
184	603296	华勤技术	12,036,226.45	7.98
185	601168	西部矿业	11,919,003.00	7.90
186	601018	宁波港	11,901,086.00	7.89
187	300768	迪普科技	11,838,488.51	7.85
188	002555	三七互娱	11,738,510.00	7.78
189	600584	长电科技	11,637,422.00	7.71
190	300232	洲明科技	11,566,029.79	7.67
191	002673	西部证券	11,555,255.00	7.66
192	002841	视源股份	11,452,875.00	7.59
193	002284	亚太股份	11,441,952.10	7.58
194	301025	读客文化	11,421,751.00	7.57
195	688396	华润微	11,407,773.88	7.56

196	600482	中国动力	11,162,783.00	7.40
197	601689	拓普集团	11,091,252.90	7.35
198	002886	沃特股份	11,060,098.00	7.33
199	688208	道通科技	11,033,618.97	7.31
200	600271	航天信息	11,024,019.00	7.31
201	600025	华能水电	10,990,959.01	7.28
202	601816	京沪高铁	10,956,142.00	7.26
203	002378	章源钨业	10,921,956.90	7.24
204	300454	深信服	10,911,629.80	7.23
205	300229	拓尔思	10,890,486.76	7.22
206	000401	冀东水泥	10,857,968.00	7.20
207	688313	仕佳光子	10,818,792.77	7.17
208	600428	中远海特	10,601,843.00	7.03
209	600893	航发动力	10,514,750.00	6.97
210	688252	天德钰	10,322,045.91	6.84
211	600150	中国船舶	10,267,599.00	6.80
212	002455	百川股份	10,245,170.28	6.79
213	002946	新乳业	10,202,488.00	6.76
214	601991	大唐发电	10,158,732.00	6.73
215	000999	华润三九	10,156,933.50	6.73
216	688728	格科微	10,069,105.27	6.67
217	002636	金安国纪	9,997,096.00	6.63
218	600517	国网英大	9,955,078.00	6.60
219	688472	阿特斯	9,885,668.72	6.55
220	000800	一汽解放	9,789,732.00	6.49
221	300529	健帆生物	9,709,059.00	6.43
222	600233	圆通速递	9,539,908.00	6.32
223	600497	驰宏锌锗	9,489,625.00	6.29
224	300274	阳光电源	9,411,153.20	6.24
225	000021	深科技	9,407,317.00	6.23
226	601898	中煤能源	9,339,944.00	6.19
227	000625	长安汽车	9,309,023.00	6.17
228	688088	虹软科技	9,288,782.37	6.16
229	000039	中集集团	9,286,010.00	6.15
230	600789	鲁抗医药	9,240,705.00	6.12
231	600500	中化国际	9,224,782.00	6.11
232	688591	泰凌微	9,115,475.97	6.04
233	601878	浙商证券	9,040,209.25	5.99
234	300308	中际旭创	9,024,640.33	5.98
235	601068	中铝国际	9,022,343.00	5.98
236	000729	燕京啤酒	9,019,315.00	5.98
237	300351	永贵电器	8,996,144.00	5.96
238	002632	道明光学	8,914,097.00	5.91

239	600027	华电国际	8,822,867.00	5.85
240	002550	千红制药	8,785,727.00	5.82
241	600061	国投资本	8,747,544.47	5.80
242	601117	中国化学	8,711,520.00	5.77
243	002537	海联金汇	8,690,769.40	5.76
244	000009	中国宝安	8,632,594.00	5.72
245	600623	华谊集团	8,576,596.00	5.68
246	002385	大北农	8,560,835.84	5.67
247	000060	中金岭南	8,522,856.00	5.65
248	300766	每日互动	8,457,962.00	5.61
249	002906	华阳集团	8,415,711.00	5.58
250	600438	通威股份	8,409,066.00	5.57
251	300661	圣邦股份	8,397,676.93	5.57
252	603025	大豪科技	8,371,634.24	5.55
253	601555	东吴证券	8,324,113.00	5.52
254	300660	江苏雷利	8,275,334.00	5.48
255	688362	甬矽电子	8,271,808.89	5.48
256	300684	中石科技	8,239,979.00	5.46
257	002612	朗姿股份	8,156,509.00	5.41
258	600066	宇通客车	8,122,512.00	5.38
259	000786	北新建材	8,062,892.00	5.34
260	601136	首创证券	8,046,186.00	5.33
261	600744	华银电力	8,006,006.36	5.31
262	002601	龙佰集团	7,996,420.44	5.30
263	301165	锐捷网络	7,992,596.00	5.30
264	600089	特变电工	7,968,404.00	5.28
265	600667	太极实业	7,906,188.00	5.24
266	600143	金发科技	7,902,092.00	5.24
267	603517	绝味食品	7,842,535.00	5.20
268	000969	安泰科技	7,818,948.00	5.18
269	002926	华西证券	7,686,495.00	5.09
270	603228	景旺电子	7,683,937.00	5.09
271	300913	兆龙互连	7,682,157.00	5.09
272	300413	芒果超媒	7,637,731.00	5.06
273	300463	迈克生物	7,624,376.02	5.05
274	300595	欧普康视	7,623,360.14	5.05
275	600021	上海电力	7,614,578.00	5.05
276	002558	巨人网络	7,563,126.72	5.01
277	688183	生益电子	7,525,062.66	4.99
278	601618	中国中冶	7,490,377.00	4.96
279	601066	中信建投	7,461,995.00	4.95
280	600835	上海机电	7,438,523.00	4.93
281	600886	国投电力	7,411,078.00	4.91

282	600062	华润双鹤	7,367,302.00	4.88
283	300957	贝泰妮	7,354,094.00	4.87
284	600335	国机汽车	7,334,234.00	4.86
285	000930	中粮科技	7,319,328.00	4.85
286	300558	贝达药业	7,305,477.00	4.84
287	002562	兄弟科技	7,271,754.00	4.82
288	600663	陆家嘴	7,156,080.52	4.74
289	600989	宝丰能源	7,056,822.00	4.68
290	603328	依顿电子	7,037,004.00	4.66
291	002493	荣盛石化	7,020,893.00	4.65
292	600637	东方明珠	6,986,720.00	4.63
293	300017	网宿科技	6,981,860.00	4.63
294	300233	金城医药	6,949,219.00	4.61
295	688223	晶科能源	6,909,714.56	4.58
296	601607	上海医药	6,884,908.10	4.56
297	300113	顺网科技	6,882,648.00	4.56
298	002648	卫星化学	6,881,429.93	4.56
299	002423	中粮资本	6,855,974.00	4.54
300	000708	中信特钢	6,821,817.00	4.52
301	000630	铜陵有色	6,802,975.00	4.51
302	600351	亚宝药业	6,761,844.12	4.48
303	603056	德邦股份	6,756,573.00	4.48
304	600098	广州发展	6,743,584.00	4.47
305	300896	爱美客	6,732,034.00	4.46
306	000166	申万宏源	6,703,644.90	4.44
307	002036	联创电子	6,700,267.00	4.44
308	002050	三花智控	6,616,850.00	4.39
309	601187	厦门银行	6,562,284.00	4.35
310	600161	天坛生物	6,550,496.04	4.34
311	600223	福瑞达	6,526,814.00	4.33
312	603659	璞泰来	6,513,670.40	4.32
313	002970	锐明技术	6,510,726.00	4.31
314	002179	中航光电	6,494,389.00	4.30
315	300628	亿联网络	6,480,710.00	4.30
316	688036	传音控股	6,446,144.72	4.27
317	600210	紫江企业	6,445,342.00	4.27
318	002151	北斗星通	6,393,807.00	4.24
319	301029	怡合达	6,373,685.00	4.22
320	600531	豫光金铅	6,286,928.00	4.17
321	600498	烽火通信	6,273,309.00	4.16
322	600420	国药现代	6,271,532.59	4.16
323	603118	共进股份	6,262,316.00	4.15
324	601399	国机重装	6,229,644.00	4.13

325	600968	海油发展	6,181,082.00	4.10
326	600549	厦门钨业	6,170,573.00	4.09
327	301301	川宁生物	6,157,774.00	4.08
328	601615	明阳智能	6,100,100.00	4.04
329	000878	云南铜业	6,071,809.00	4.02
330	603345	安井食品	6,053,380.56	4.01
331	300496	中科创达	6,046,169.86	4.01
332	000002	万科 A	6,042,915.00	4.00
333	002125	湘潭电化	5,993,204.00	3.97
334	002271	东方雨虹	5,953,596.00	3.95
335	000783	长江证券	5,934,716.00	3.93
336	000756	新华制药	5,905,631.24	3.91
337	600468	百利电气	5,897,217.00	3.91
338	600578	京能电力	5,897,140.00	3.91
339	601997	贵阳银行	5,880,651.00	3.90
340	300316	晶盛机电	5,874,353.00	3.89
341	603317	天味食品	5,868,773.12	3.89
342	300373	扬杰科技	5,813,406.36	3.85
343	002202	金风科技	5,800,861.00	3.84
344	002281	光迅科技	5,767,331.64	3.82
345	002384	东山精密	5,765,264.00	3.82
346	600718	东软集团	5,760,166.60	3.82
347	300533	冰川网络	5,701,278.00	3.78
348	688586	江航装备	5,699,607.70	3.78
349	688400	凌云光	5,674,135.85	3.76
350	603888	新华网	5,666,391.44	3.76
351	600938	中国海油	5,660,454.00	3.75
352	300975	商络电子	5,658,701.94	3.75
353	300579	数字认证	5,611,251.00	3.72
354	603893	瑞芯微	5,598,292.00	3.71
355	300369	绿盟科技	5,527,674.00	3.66
356	600928	西安银行	5,512,963.32	3.65
357	300738	奥飞数据	5,488,036.00	3.64
358	300398	飞凯材料	5,482,264.00	3.63
359	600629	华建集团	5,477,849.00	3.63
360	603392	万泰生物	5,474,420.88	3.63
361	300215	电科院	5,445,605.00	3.61
362	605499	东鹏饮料	5,421,811.00	3.59
363	600346	恒力石化	5,415,640.00	3.59
364	000636	风华高科	5,361,184.00	3.55
365	002563	森马服饰	5,351,443.00	3.55
366	601231	环旭电子	5,313,045.00	3.52
367	002128	电投能源	5,209,116.00	3.45

368	601311	骆驼股份	5,162,907.00	3.42
369	601101	昊华能源	5,154,273.00	3.42
370	688484	南芯科技	5,149,592.18	3.41
371	300206	理邦仪器	5,112,728.00	3.39
372	000895	双汇发展	5,085,005.00	3.37
373	603171	税友股份	5,077,684.00	3.37
374	601179	中国西电	5,066,967.00	3.36
375	002074	国轩高科	5,066,694.00	3.36
376	603806	福斯特	5,050,927.20	3.35
377	603915	国茂股份	5,035,333.00	3.34
378	300978	东箭科技	5,028,054.34	3.33
379	603195	公牛集团	5,005,041.59	3.32
380	601456	国联证券	4,960,621.00	3.29
381	603013	亚普股份	4,932,616.00	3.27
382	001965	招商公路	4,928,628.00	3.27
383	300722	新余国科	4,894,309.79	3.24
384	688128	中国电研	4,884,193.91	3.24
385	688209	英集芯	4,879,673.95	3.23
386	300024	机器人	4,840,267.00	3.21
387	300136	信维通信	4,815,320.00	3.19
388	300919	中伟股份	4,727,693.40	3.13
389	603299	苏盐井神	4,723,502.00	3.13
390	600409	三友化工	4,699,536.00	3.11
391	300424	航新科技	4,644,562.40	3.08
392	601228	广州港	4,644,195.00	3.08
393	601699	潞安环能	4,602,926.00	3.05
394	002293	罗莱生活	4,600,579.70	3.05
395	000825	太钢不锈	4,599,243.92	3.05
396	600979	广安爱众	4,591,281.00	3.04
397	600017	日照港	4,557,399.00	3.02
398	600101	明星电力	4,543,663.70	3.01
399	601872	招商轮船	4,533,089.00	3.00
400	300101	振芯科技	4,526,063.00	3.00
401	601577	长沙银行	4,524,568.00	3.00
402	000997	新大陆	4,515,800.00	2.99
403	300458	全志科技	4,513,675.00	2.99
404	688588	凌志软件	4,478,478.47	2.97
405	002945	华林证券	4,443,604.36	2.94
406	002011	盾安环境	4,402,463.00	2.92
407	601609	金田股份	4,389,752.00	2.91
408	600776	东方通信	4,382,964.00	2.90
409	300207	欣旺达	4,335,079.00	2.87
410	002925	盈趣科技	4,330,130.00	2.87

411	600141	兴发集团	4,271,507.00	2.83
412	002649	博彦科技	4,243,721.00	2.81
413	002245	蔚蓝锂芯	4,214,274.68	2.79
414	600803	新奥股份	4,203,001.00	2.79
415	603256	宏和科技	4,188,283.00	2.78
416	002056	横店东磁	4,184,874.00	2.77
417	600236	桂冠电力	4,182,496.00	2.77
418	300142	沃森生物	4,164,743.00	2.76
419	600699	均胜电子	4,159,830.00	2.76
420	002139	拓邦股份	4,155,353.00	2.75
421	002511	中顺洁柔	4,149,870.20	2.75
422	300634	彩讯股份	4,144,076.00	2.75
423	601608	中信重工	4,132,268.00	2.74
424	000539	粤电力 A	4,096,802.00	2.72
425	603766	隆鑫通用	4,095,766.00	2.71
426	300160	秀强股份	4,092,721.00	2.71
427	601108	财通证券	4,050,374.00	2.68
428	300601	康泰生物	4,041,700.00	2.68
429	000921	海信家电	4,034,978.00	2.67
430	600132	重庆啤酒	4,029,418.00	2.67
431	000728	国元证券	4,000,811.00	2.65
432	600315	上海家化	3,969,225.00	2.63
433	600909	华安证券	3,932,837.00	2.61
434	300409	道氏技术	3,928,665.00	2.60
435	002603	以岭药业	3,897,230.00	2.58
436	000792	盐湖股份	3,895,863.00	2.58
437	601916	浙商银行	3,878,551.00	2.57
438	002459	晶澳科技	3,866,576.00	2.56
439	300079	数码视讯	3,840,331.00	2.55
440	300082	奥克股份	3,753,988.00	2.49
441	002539	云图控股	3,737,182.00	2.48
442	300832	新产业	3,707,110.00	2.46
443	002907	华森制药	3,703,800.00	2.45
444	002237	恒邦股份	3,703,094.00	2.45
445	002396	星网锐捷	3,694,494.00	2.45
446	002185	华天科技	3,686,405.00	2.44
447	002335	科华数据	3,683,229.00	2.44
448	301297	富乐德	3,656,602.00	2.42
449	002797	第一创业	3,644,393.00	2.42
450	300170	汉得信息	3,642,676.00	2.41
451	603019	中科曙光	3,620,144.00	2.40
452	300039	上海凯宝	3,602,032.00	2.39
453	600863	内蒙华电	3,574,874.00	2.37

454	002565	顺灏股份	3,508,110.00	2.32
455	600754	锦江酒店	3,498,722.00	2.32
456	688798	艾为电子	3,488,387.95	2.31
457	601788	光大证券	3,462,511.00	2.29
458	601696	中银证券	3,428,907.00	2.27
459	600426	华鲁恒升	3,421,932.00	2.27
460	002032	苏泊尔	3,408,381.00	2.26
461	000960	锡业股份	3,392,695.00	2.25
462	301370	国科恒泰	3,391,416.00	2.25
463	301260	格力博	3,366,048.00	2.23
464	300755	华致酒行	3,363,629.00	2.23
465	301175	中科环保	3,350,619.00	2.22
466	600073	光明肉业	3,350,061.00	2.22
467	300315	掌趣科技	3,341,490.00	2.21
468	300880	迦南智能	3,332,903.00	2.21
469	603127	昭衍新药	3,318,946.00	2.20
470	300648	星云股份	3,290,174.00	2.18
471	000768	中航西飞	3,273,889.00	2.17
472	600026	中远海能	3,258,645.00	2.16
473	002460	赣锋锂业	3,228,226.40	2.14
474	000850	华茂股份	3,227,763.00	2.14
475	600619	海立股份	3,221,339.00	2.13
476	300735	光弘科技	3,205,541.00	2.12
477	688249	晶合集成	3,204,788.02	2.12
478	301500	飞南资源	3,198,520.00	2.12
479	300159	新研股份	3,191,840.00	2.12
480	001227	兰州银行	3,191,774.00	2.12
481	000987	越秀资本	3,189,088.59	2.11
482	600038	中直股份	3,186,647.00	2.11
483	002519	银河电子	3,184,011.00	2.11
484	600299	安迪苏	3,183,837.00	2.11
485	600609	金杯汽车	3,169,208.00	2.10
486	002815	崇达技术	3,096,547.00	2.05
487	001213	中铁特货	3,089,693.40	2.05
488	002010	传化智联	3,081,227.72	2.04
489	600079	人福医药	3,073,623.00	2.04
490	301078	孩子王	3,065,804.78	2.03
491	002320	海峡股份	3,056,602.00	2.03
492	001979	招商蛇口	3,054,996.00	2.02
493	600006	东风股份	3,054,578.00	2.02
494	300341	麦克奥迪	3,051,521.00	2.02
495	600985	淮北矿业	3,049,813.00	2.02
496	300255	常山药业	3,041,327.00	2.02

497	002106	莱宝高科	3,038,581.00	2.01
498	601116	三江购物	3,033,468.00	2.01
499	603883	老百姓	3,024,460.40	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	8,363,310,920.44
卖出股票收入（成交）总额	6,993,554,443.15

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

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，2024 年 6 月因违规经营，被国家金融监督管理总局地方监管局罚款，2024 年其分支行多次因违规被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局、证监会分局罚款、警示等。

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	4,142,490.66
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	71,074,810.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	75,217,301.42

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
国泰君安沪深 300 指 数增强 发起 A	11,028	59,997.2 7	575,378,027.76	86.96%	86,271,838.31	13.04%
国泰君安沪深 300 指 数增强 发起 C	11,692	91,340.6 3	937,739,158.09	87.81%	130,215,504.0 6	12.19%
合计	22,720	76,126.9 6	1,513,117,185.8 5	87.48%	216,487,342.3 7	12.52%

注：分类基金机构/个人投资者持有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）。

9.2 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	630,056.31	0.0952%
	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C	16,725.55	0.0016%
	合计	646,781.86	0.0374%

注：分类基金管理人的从业人员持有基金占基金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	国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	10~50
	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安沪深 300 指数增强发起 A	10~50
	国泰君安沪深 300 指数增强发起 C	0
	合计	10~50

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。

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	15,019,000.00	0.87%	15,019,000.00	0.87%	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	17,761.02	0.00%	-	-	-
基金经理等人员	245,239.23	0.01%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	383,781.61	0.02%	-	-	-
合计	15,665,781.86	0.90%	15,019,000.00	0.87%	-

注：其他为公司普通员工持有份额，持有期限为不低于 6 个月。

§ 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
本报告期期初基金份额总额	64,205,788.82	106,779,627.00
本报告期基金总申购份额	714,736,807.54	1,970,023,601.29
减：本报告期基金总赎回份额	117,292,730.29	1,008,848,566.14
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	661,649,866.07	1,067,954,662.15

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：

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高级管理人员变更公告》，由叶明同志代为履行首席信息官职责，朱晓力同志不再担任公司首席信息官职务，生效日期为 2024 年 2 月 26 日。

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》，陶耿同志兼任公司财务负责人，吕巍同志兼任公司首席风险官；叶明同志不再兼任财务负责人、首席风险官职务，生效日期为 2024 年 3 月 18 日。

2024 年 8 月 15 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》，吴楠同志和周诗宇同志不再担任公司副总裁职务，生效日期为 2024 年 8 月 13 日。

2024 年 9 月 7 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》，丁杰能同志担任公司副总裁职务，生效日期为 2024 年 9 月 5 日。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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于 2024-11-5 日改聘为其审计的会计师事务所。报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 40,000.00 元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为改聘日至今。

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

报告期内，本基金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

报告期内，本基金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	14,152,334,440.90	92.17%	1,031,965.62	91.78%	-
光大证券股份有限公司	3	1,202,094,585.92	7.83%	92,443.80	8.22%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

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旗下基金 2023 年第 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	2024-01-22
2	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2023 年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-01-22
3	上海国泰君安证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	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、上交所	2024-02-28
4	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	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、上交所	2024-03-20
5	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	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、上交所	2024-03-20
6	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	证监会指定网站、公司官网	2024-03-29
7	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 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	2024-03-29
8	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）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-04-18
9	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）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-04-18
10	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（更新）（2024 年第 1 号）	证监会指定网站、公司官网	2024-04-18
11	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-04-22
12	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年第 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	2024-04-22
13	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）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-06-28
14	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金（C 类份	证监会指定网站、公司官网	2024-06-28

	额) 基金产品资料概要更新		
15	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-07-19
16	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年第 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	2024-07-19
17	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	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、上交所	2024-08-15
18	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年中期报告	证监会指定网站、公司官网	2024-08-30
19	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 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	2024-08-30
20	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	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、上交所	2024-09-07
21	国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-10-25
22	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 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	2024-10-25
23	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国泰君安资管 APP 开通基金转换业务的公告	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	2024-10-31
24	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	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、上交所	2024-11-06
25	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下部分基金在国泰君安资管 APP 转换业务费用计算方法、转换业务适用范围和规则的公告	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	2024-11-07
26	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下部分产品在直销 APP 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	2024-11-25
27	在本报告期内刊登的其他公告	-	-

§ 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	20240101-20240204	35,982,312.37	-	20,963,312.37	15,019,000.00	0.87%
	2	20240722-20241208	-	338,924,835.72	269,453,180.76	69,471,654.96	4.02%
	3	20240101-20240527	46,412,941.29	212,154,899.00	-	258,567,840.29	14.95%
	4	20240101-20240121, 20240126-20240129	34,714,824.66	22,355,227.59	-	57,070,052.25	3.30%
产品特有风险							
本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%,则面临大额赎回的情况,可能导致: (1)基金在短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》的约定决定部分延缓赎回,如果连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响; (2)基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平; (3)因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动; (4)基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略; (5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。							

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
二〇二五年三月三十一日