

国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金

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	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	11
3.3 过去三年基金的利润分配情况	14
§ 4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	20
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	20
§ 5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	20
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	20
§ 6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	21
§ 7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	24
7.3 净资产变动表	26
7.4 报表附注	27
§ 8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	78
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	78
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	78

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.....	78
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	78
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	79
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	79
8.12 投资组合报告附注	79
§ 9 基金份额持有人信息.....	80
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	80
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	81
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	81
§ 10 开放式基金份额变动.....	81
§ 11 重大事件揭示	82
11.1 基金份额持有人大会决议	82
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.....	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	82
11.4 基金投资策略的改变	83
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	83
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	83
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	83
11.8 其他重大事件.....	83
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	85
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.....	85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	86

§ 13 备查文件目录	86
13.1 备查文件目录.....	86
13.2 存放地点	86
13.3 查阅方式	86

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	国泰君安中证 500 指数增强	
基金主代码	014155	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 15 日	
基金管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,211,021,390.31 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安中证 500 指数增强 A	国泰君安中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	014155	014156
报告期末下属分级基金的份额总额	1,512,370,458.39 份	698,650,931.92 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，通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数产品，在标的指数成份券权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。 股票投资策略为本基金的核心策略，主要包括以下几个方面： 1) 行业配置 本基金在行业配置方面尽量遵循基准指数的行业市值占比，尽量控制投资组合相对于基准指数的行业暴露带来的风险损失。 2) 个股选择 本基金根据股票库中可选投资标的期望收益率、流动性和市场风险偏好等要素选择风险收益比最具吸引力的个股，并根据投资标的的公司股价主要驱动因素的变化动态调整投资组合，而在投资组合管理层面需要充分考虑其相对于中证 500 指数的风险偏离度。 A、股票池的建立

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		上海国泰君安证券资产管理有限公司	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	周直毅
	联系电话	021-38676022	021-68475608
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	custody@bosscn.cn
客户服务电话		95521	95594
传真		021-38871190	021-68476901
注册地址		上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室	上海市黄浦区中山南路 688 号
办公地址		上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 37 层
邮政编码		200120	200120
法定代表人		陶耿	金煜

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gtjazg.com
基金年度报告备置地点	上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	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	2024 年		2023 年		2022 年	
期间数据	国泰君安中证 500 指数增强 A	国泰君安中证 500 指数增强 C	国泰君安中证 500 指数增强 A	国泰君安中证 500 指数增强 C	国泰君安中证 500 指数增强 A	国泰君安中证 500 指数增强 C

和指标						
本期已实现收益	143,787,368.93	49,426,229.54	-52,630,033.87	-40,550,274.89	-58,980,579.81	-38,870,650.60
本期利润	119,731,104.39	54,849,968.24	-60,810,436.69	-47,665,725.12	-82,898,773.21	-52,702,521.24
加权平均基金份额本期利润	0.0866	0.0721	-0.0526	-0.0645	-0.1090	-0.1167
本期加权平均净值利润率	9.88%	8.35%	-5.62%	-6.97%	-11.72%	-12.57%
本期基金份额净	11.41%	10.95%	-2.60%	-2.98%	-11.34%	-11.70%

值 增 长 率						
3.1 .2 期 末 数 据 和 指 标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期 末 可 供 分 配 利 润	- 35,725,345.3 0	- 24,783,419 .17	- 186,950,050. 52	- 141,512,532 .46	- 85,805,614 .26	- 55,776,463 .74
期 末 可 供 分 配 基 金 份 额 利 润	-0.0236	-0.0355	-0.1236	-0.1307	-0.1002	-0.1040
期 末 基 金 资 产 净 值	1,476,645,11 3.09	673,867,51 2.75	1,326,165,05 7.77	941,064,756 .65	770,119,74 9.37	480,552,44 7.98
期 末 基	0.9764	0.9645	0.8764	0.8693	0.8998	0.8960

金 份 额 净 值						
3.1 .3 累 计 期 末 指 标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基 金 份 额 累 计 净 值 增 长 率	-2.36%	-3.55%	-12.36%	-13.07%	-10.02%	-10.40%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰君安中证 500 指数增强 A 净值表现

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	1.03%	1.99%	-0.23%	1.93%	1.26%	0.06%
过去六个月	17.27%	1.94%	15.13%	1.91%	2.14%	0.03%
过去一年	11.41%	1.75%	5.40%	1.73%	6.01%	0.02%

过去三年	-3.79%	1.34%	-20.91%	1.33%	17.12%	0.01%
自基金合同生效起至今	-2.36%	1.33%	-20.54%	1.32%	18.18%	0.01%

国泰君安中证 500 指数增强 C 净值表现

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	0.93%	1.99%	-0.23%	1.93%	1.16%	0.06%
过去六个月	17.02%	1.94%	15.13%	1.91%	1.89%	0.03%
过去一年	10.95%	1.75%	5.40%	1.73%	5.55%	0.02%
过去三年	-4.95%	1.34%	-20.91%	1.33%	15.96%	0.01%
自基金合同生效起至今	-3.55%	1.33%	-20.54%	1.32%	16.99%	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

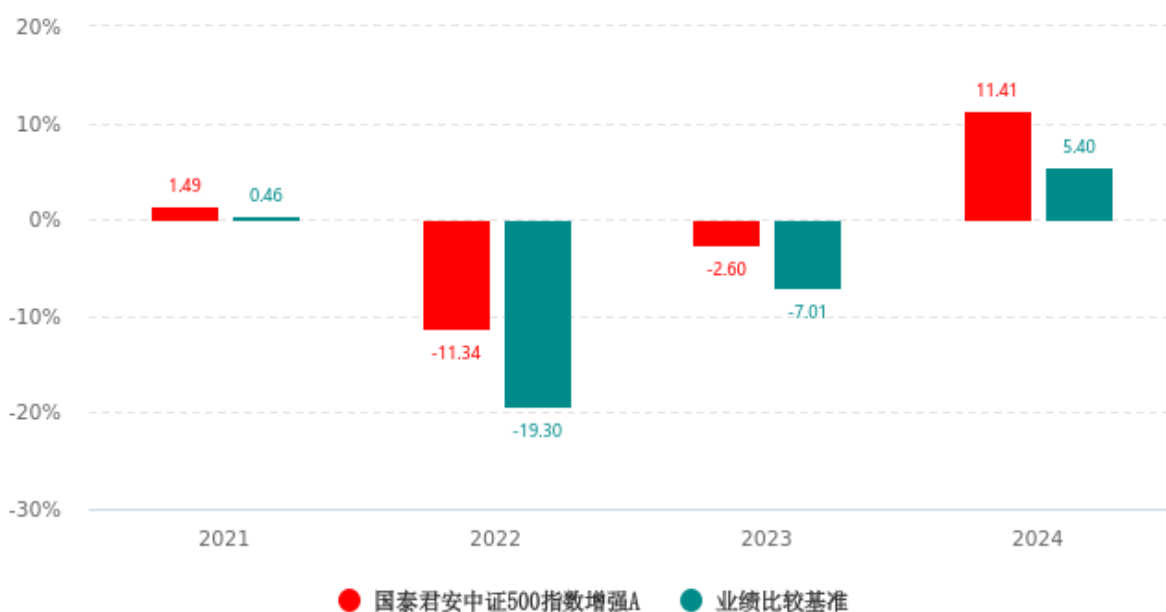
国泰君安中证500指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年12月15日-2024年12月31日)



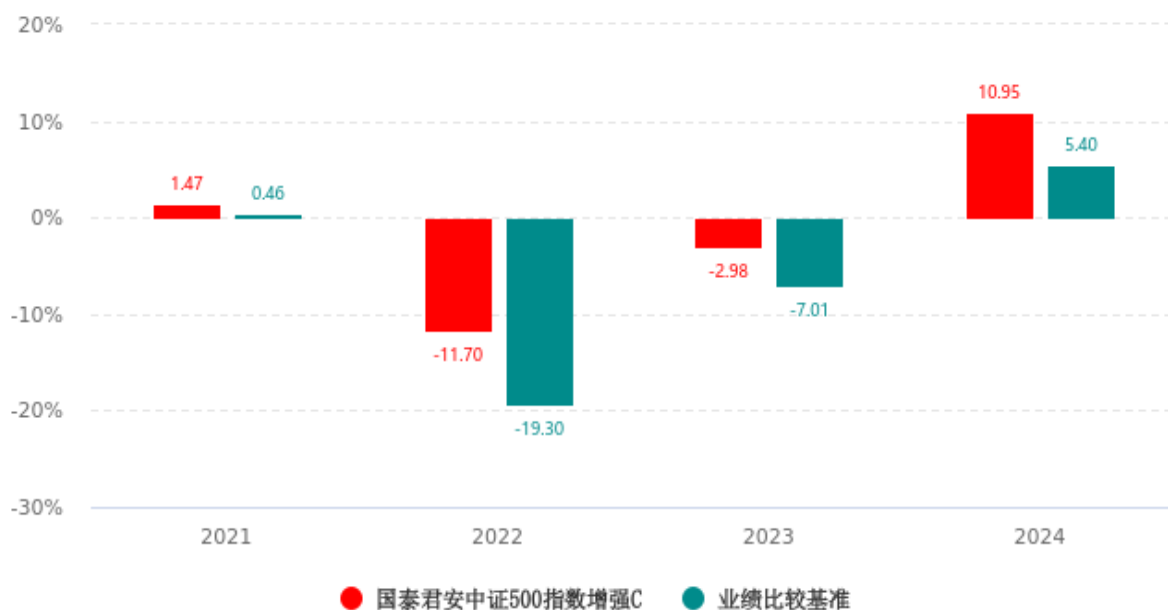
国泰君安中证500指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年12月15日-2024年12月31日)



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 2021 年 12 月 15 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 2021 年 12 月 15 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。	2021-12-15	—	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。
邓雅琨	国泰君安中证 500 指数增强基金经理，国泰君安中证香港科技指数发起（QDII）基金经理。现任量化投资部（公募）基金经理。	2024-05-16	—	3 年	邓雅琨，卡耐基梅隆大学计算金融专业，硕士研究生。2021 年 3 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任权益与衍生品部量化研究员助理，量化投资部研究员助理、投资助理，现任量化投资部（公募）基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 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，中证 500 指数表现稳健（涨幅 5.46%），虽不及沪深 300 指数（涨幅 14.68%），但好于中证 1000 指数（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。

从中证 500 指数当前的估值水平来看，截至 12 月底其加权 PE 和整体 PE 分别在 28 倍和 28 倍左右，依然处于历史较为低估的水平，在历史上的分位数为 37%左右，而用 PB 估值的话，则历史分位数更低，在市场主要宽基指数当中是历史相对估值最低的指数之一，为 15%左右。另外一方面，即便剔除中证 500 指数中煤炭、有色、石油石化、钢铁和基础化工等五大强周期行业的成分股，从历史纵向来分析，其加权 PE 历史分位数也仍处低位，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。未来随着经济的逐步企稳向好，作为市场中优质中盘股的代表，中证 500 指数有望迎来估值和盈利的双击。我们认为作为一个价值股和成长股、周期股和非周期股、新兴行业 and 传统行业均相对均衡的中盘宽基指数，中证 500 指数依然是当前市场环境下进可攻、退可守的选择。

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，

也本没有一种投资方法论可以通吃所有风格的行情，但是量化投资从投资理念和投资逻辑来讲并未发生本质性改变，以博取 Alpha 为主要目的的宽基增强型产品在当前市场点位仍具有很高的性价比。尽管市场风格和行业走势会发生变化，但我们仍将坚持一贯的投资理念和投资组合管理体系。在本基金中，我们通过挖掘有投资逻辑的 Alpha 因子，不断改进底层量化模型以及定期监控策略的表现等方式来增强策略表现。我们一直坚守一贯的投资体系和理念，并尽可能以此来稳定投资者对我们超额收益率的预期。在量化增强层面，我们将结合财务数据为基础的基本面信号和实时量价信号，并不断挖掘基于另类数据的 Alpha 因子，通过机器学习模型来有效选择因子并做出预测，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中证 500 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。我们认为中证 500 指数当前依然处于历史低估阶段，成长性良好，指数未来上涨的空间依然大于下跌的空间，我们将努力通过科学的手段增强量化模型的超额收益率水平，以此不断为客户增厚投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安中证 500 指数增强 A 基金份额净值为 0.9764 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 11.41%，同期业绩比较基准收益率为 5.40%；截至报告期末国泰君安中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 0.9645 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 10.95%，同期业绩比较基准收益率为 5.40%。

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。中证 500 指数作为市场当前中盘股的典型代表，兼具成长和价值双重属性，不管是相对估值和绝对估值，均有较强安全垫。从量化模型的 Alpha 角度来看，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中证 500 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

本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2025]200Z1977 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“国泰君安中证 500 指数增强基金”）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中证 500 指数增强基金 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中证 500 指数增强基金，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	国泰君安中证 500 指数增强基金的基金管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估国泰君安中证 500 指数增强基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算国泰君安中证 500 指数增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督国泰君安中证 500 指数增强基金的财务报告过程。
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中证 500 指数增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国泰君安中证 500 指数增强基金不能持续经营。 （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：国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金
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	122,062,885.91	288,213,888.11
结算备付金		5,449,442.89	19,607,250.57
存出保证金		3,793,041.60	1,435,315.20
交易性金融资产	7.4.7.2	2,002,902,446.73	2,132,056,415.86
其中：股票投资		2,002,902,446.73	2,132,056,415.86
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		33,126,160.57	1,780,876.92
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.5	—	—
资产总计		2,167,333,977.70	2,443,093,746.66
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		14,453,899.43	173,072,051.18
应付管理人报酬		1,810,570.02	1,964,989.84
应付托管费		271,585.49	294,748.47
应付销售服务费		234,360.89	360,936.83
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	50,936.03	171,205.92
负债合计		16,821,351.86	175,863,932.24
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	2,211,021,390.31	2,595,692,397.40
未分配利润	7.4.7.8	-60,508,764.47	-328,462,582.98
净资产合计		2,150,512,625.84	2,267,229,814.42
负债和净资产总计		2,167,333,977.70	2,443,093,746.66

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,211,021,390.31 份。其中国泰君安中证 500 指数增强 A 基金份额净值 0.9764 元，基金份额总额 1,512,370,458.39 份；国泰君安中证 500 指数增强 C 基金份额净值 0.9645 元，基金份额总额 698,650,931.92 份。

7.2 利润表

会计主体：国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：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	上年度可比期间
-----	-----	----------------	---------

		01 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		198,914,657.72	-85,381,295.01
1. 利息收入		872,423.90	819,394.54
其中：存款利息收入	7.4.7.9	872,423.90	819,394.54
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		215,698,989.01	-73,762,280.14
其中：股票投资收益	7.4.7.10	191,141,843.01	-93,801,093.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.11	-1,687,119.40	-2,602,411.06
股利收益	7.4.7.12	26,244,265.40	22,641,224.56
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	-18,632,525.84	-15,295,853.05
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	975,770.65	2,857,443.64
减：二、营业总支出		24,333,585.09	23,094,866.80
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	18,705,502.29	17,567,318.27
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,805,825.39	2,635,097.67
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,639,031.70	2,717,417.25
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		13,039.71	4,907.61
8. 其他费用	7.4.7.15	170,186.00	170,126.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		174,581,072.63	-108,476,161.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		174,581,072.63	-108,476,161.81
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		174,581,072.63	-108,476,161.81

7.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：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	2,595,692,397.40	-328,462,582.98	2,267,229,814.42
二、本期期初净资产	2,595,692,397.40	-328,462,582.98	2,267,229,814.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-384,671,007.09	267,953,818.51	-116,717,188.58
（一）、综合收益总额	-	174,581,072.63	174,581,072.63
（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）	-384,671,007.09	93,372,745.88	-291,298,261.21
其中：1. 基金申购款	1,609,541,645.57	-137,194,744.91	1,472,346,900.66
2. 基金赎回款	- 1,994,212,652.66	230,567,490.79	- 1,763,645,161.87
（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	2,211,021,390.31	-60,508,764.47	2,150,512,625.84

项 目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,392,254,275.35	-141,582,078.00	1,250,672,197.35
二、本期期初净资产	1,392,254,275.35	-141,582,078.00	1,250,672,197.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,203,438,122.05	-186,880,504.98	1,016,557,617.07
（一）、综合收益总额	-	-108,476,161.81	-108,476,161.81
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	1,203,438,122.05	-78,404,343.17	1,125,033,778.88
其中：1. 基金申购款	2,768,082,073.14	-195,523,765.84	2,572,558,307.30
2. 基金赎回款	-	117,119,422.67	-
	1,564,643,951.09		1,447,524,528.42
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	2,595,692,397.40	-328,462,582.98	2,267,229,814.42

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

国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]3391 号《关于准予国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由上海国泰君安证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币

1,160,406,264.46 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 1179 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2021 年 12 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,160,704,146.74 份，其中认购资金利息折合 297,882.28 份基金份额。本基金的基金管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购费、申购费，但不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购时不收取认购费、申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类

基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份券(包括存托凭证)、备选成份券(包括存托凭证)、其他国内依法发行上市的股票和存托凭证(包括主板、创业板和其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转换债)、可交换债、次级债、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、中期票据等)、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人经履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、存托凭证资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于中证 500 指数成份券及其备选成份券的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，待履行适当程序后，以变更后的规定为准。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×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	60,568,364.02	199,396,393.60
等于：本金	60,552,082.89	199,376,499.48
加：应计利息	16,281.13	19,894.12
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	61,494,521.89	88,817,494.51
等于：本金	61,492,532.93	88,811,139.69
加：应计利息	1,988.96	6,354.82
减：坏账准备	-	-
合计	122,062,885.91	288,213,888.11

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		2,059,267,335.96	-	2,002,902,446.73	-56,364,889.23
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,059,267,335.96	-	2,002,902,446.73	56,364,889.23
上年度末 2023 年 12 月 31 日					
项目		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,171,268,187.63	-	2,132,056,415.86	-39,211,771.77
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,171,268,187.63	-	2,132,056,415.86	-39,211,771.77

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	33,002,042.50	-	-	-
股指期货	33,002,042.50	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	33,002,042.50	-	-	-
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	11,874,914.1	0.00	-	-

	2			
—股指期货	11,874,914.12	0.00	—	—
其他衍生工具	—	—	—	—
合计	11,874,914.12	—	—	—

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
IC2501	IC2501	1	1,143,920.00	-32,424.17
IC2503	IC2503	17	19,296,360.00	-633,618.33
IC2506	IC2506	10	11,168,400.00	-727,320.00
合计				-1,393,362.50
减：可抵销期货暂收款				-1,393,362.50
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	936.03	1,205.92
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	50,000.00	50,000.00
预提信息披露费	-	120,000.00
合计	50,936.03	171,205.92

7.4.7.7 实收基金

国泰君安中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 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	1,513,115,108.29	1,513,115,108.29
本期申购	670,698,775.41	670,698,775.41
本期赎回（以“-”号填列）	-671,443,425.31	-671,443,425.31
本期末	1,512,370,458.39	1,512,370,458.39

国泰君安中证 500 指数增强 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	1,082,577,289.11	1,082,577,289.11
本期申购	938,842,870.16	938,842,870.16
本期赎回（以“-”号填列）	-1,322,769,227.35	-1,322,769,227.35
本期末	698,650,931.92	698,650,931.92

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

国泰君安中证 500 指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-143,157,208.48	-43,792,842.04	-186,950,050.52

本期期初	-143,157,208.48	-43,792,842.04	-186,950,050.52
本期利润	143,787,368.93	-24,056,264.54	119,731,104.39
本期基金份额交易产生的变动数	10,143,524.90	21,350,075.93	31,493,600.83
其中：基金申购款	-59,559,820.74	19,521,135.72	-40,038,685.02
基金赎回款	69,703,345.64	1,828,940.21	71,532,285.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,773,685.35	-46,499,030.65	-35,725,345.30

国泰君安中证 500 指数增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-110,311,033.17	-31,201,499.29	-141,512,532.46
本期期初	-110,311,033.17	-31,201,499.29	-141,512,532.46
本期利润	49,426,229.54	5,423,738.70	54,849,968.24
本期基金份额交易产生的变动数	57,431,966.67	4,447,178.38	61,879,145.05
其中：基金申购款	-106,656,657.29	9,500,597.40	-97,156,059.89
基金赎回款	164,088,623.96	-5,053,419.02	159,035,204.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,452,836.96	-21,330,582.21	-24,783,419.17

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 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	510,160.24	389,144.10
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	104,481.44	217,121.86
结算备付金利息收入	257,782.22	213,128.58
其他	-	-
合计	872,423.90	819,394.54

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 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	20,772,849,770.32	36,982,054,103.23
减：卖出股票成本总额	20,565,716,279.00	37,034,168,768.64
减：交易费用	15,991,648.31	41,686,428.23
买卖股票差价收入	191,141,843.01	-93,801,093.64

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 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-1,468,551.62	-2,337,979.11
减：其他衍生工具收益应缴纳 增值税	108,664.28	40,896.61
减：交易费用	109,903.50	223,535.34
合计	-1,687,119.40	-2,602,411.06

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 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	26,244,265.40	22,641,224.56
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	26,244,265.40	22,641,224.56

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 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-17,153,117.46	-15,420,952.16
——股票投资	-17,153,117.46	-15,420,952.16
——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	-1,479,408.38	125,099.11
——权证投资	-	-
期货投资	-1,479,408.38	125,099.11
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	-18,632,525.84	-15,295,853.05

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 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	975,770.65	2,857,443.64
合计	975,770.65	2,857,443.64

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 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	186.00	126.00
合计	170,186.00	170,126.00

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 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	41,223,379,611.79	100.00%	74,989,407,044.99	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

本基金本报告期及上年度可比期间未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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

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	2,961,339.29	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券	5,346,233.26	100.00%	0.00	0.00%

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 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	18,705,502.29	17,567,318.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,014,131.83	6,742,471.55
应支付基金管理人的净管理费	11,691,370.46	10,824,846.72

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X1.00%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,805,825.39	2,635,097.67

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

日托管费=前一日基金资产净值 X0.15%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 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		
	国泰君安中证 500 指数 增强 A	国泰君安中证 500 指数 增强 C	合计
上海银行	—	3,253.48	3,253.48
国泰君安证券	—	862,100.40	862,100.40
国泰君安资管	—	1,098,162.98	1,098,162.98
合计	—	1,963,516.86	1,963,516.86
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安中证 500 指数	国泰君安中证 500 指数	合计

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

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

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

国泰君安中证 500 指数增强 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 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2021 年 12 月 15 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	0.00	9,999,450
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	9,999,450.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

国泰君安中证 500 指数增强 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 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2021 年 12 月 15 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	0
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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 01 月 01 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
上海银行	60,568,364.02	510,160.24	199,396,393.60	389,144.10
国泰君安证券	61,494,521.89	104,481.44	88,817,494.51	217,121.86

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人上海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

金额单位：人民币元

本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日				
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入

				数量（单位： 股/张）	总金额
上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
国泰君安证券	301456	盘古智能	网下询价	4,061.00	154,155.56

注：本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 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	-
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	先锋精科	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	-

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	-
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	-
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	-
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	185	2,306.95	4,930.25	-
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银行股份有限公司，其他银行存款为国泰君安证券券商保证金，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行

人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 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	122,062,885.91	-	-	-	122,062,885.91
结算备付金	5,449,442.89	-	-	-	5,449,442.89
存出保证金	3,793,041.60	-	-	-	3,793,041.60
交易性金融资产	-	-	-	2,002,902,446.73	2,002,902,446.73
应收申购款	-	-	-	33,126,160.57	33,126,160.57
资产总计	131,305,370.40	-	-	2,036,028,607.30	2,167,333,977.70
负债					
应付赎回	-	-	-	14,453,899.43	14,453,899.43

款					
应付管理人报酬	-	-	-	1,810,570.02	1,810,570.02
应付托管费	-	-	-	271,585.49	271,585.49
应付销售服务费	-	-	-	234,360.89	234,360.89
其他负债	-	-	-	50,936.03	50,936.03
负债总计	-	-	-	16,821,351.86	16,821,351.86
利率敏感度缺口	131,305,370.40	-	-	2,019,207,255.44	2,150,512,625.84
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	288,213,888.11	-	-	-	288,213,888.11
结算备付金	19,607,250.57	-	-	-	19,607,250.57
存出保证金	1,435,315.20	-	-	-	1,435,315.20
交易性金融资产	-	-	-	2,132,056,415.86	2,132,056,415.86
应收申购款	-	-	-	1,780,876.92	1,780,876.92
资产总计	309,256,453.88	-	-	2,133,837,292.78	2,443,093,746.66
负债					
应付赎回款	-	-	-	173,072,051.18	173,072,051.18
应付管理人报酬	-	-	-	1,964,989.84	1,964,989.84
应付托管费	-	-	-	294,748.47	294,748.47
应付销售服务费	-	-	-	360,936.83	360,936.83
其他负债	-	-	-	171,205.92	171,205.92
负债总计	-	-	-	175,863,932.24	175,863,932.24
利率敏感度缺口	309,256,453.88	-	-	1,957,973,360.54	2,267,229,814.42

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	2,002,902,446.73	93.14	2,132,056,415.86	94.04
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	2,002,902,446.73	93.14	2,132,056,415.86	94.04

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%	107,601,000.16	111,458,169.05
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-107,601,000.16	-111,458,169.05

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	2,002,406,248.10	2,130,673,151.99
第二层次	27,736.50	898,742.02
第三层次	468,462.13	484,521.85
合计	2,002,902,446.73	2,132,056,415.86

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	-	484,521.85	484,521.85
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,029,021.54	1,029,021.54
转出第三层次	-	1,305,285.49	1,305,285.49
当期利得或损失总额	-	260,204.23	260,204.23
其中：计入损益的利得或损失	-	260,204.23	260,204.23
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	468,462.13	468,462.13
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	-	267,717.89	267,717.89
项目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,276,658.43	1,276,658.43
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,069,836.67	1,069,836.67
转出第三层次	-	2,079,590.14	2,079,590.14
当期利得或损失总额	-	217,616.89	217,616.89
其中：计入损益的利得或损失	-	217,616.89	217,616.89
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	484,521.85	484,521.85

期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	35,473.31	35,473.31
--	---	-----------	-----------

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	468,462.13	亚式期权模型	预期年化波动率	34.23%-574.44%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	484,521.85	亚式期权模型	预期年化波动率	14.62%~217.75%	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	2,002,902,446.73	92.41
	其中：股票	2,002,902,446.73	92.41
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	127,512,328.80	5.88
8	其他各项资产	36,919,202.17	1.70
9	合计	2,167,333,977.70	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	1,582,966.00	0.07
B	采矿业	86,154,390.00	4.01
C	制造业	981,439,950.35	45.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	87,454,502.00	4.07
E	建筑业	34,196,872.60	1.59

F	批发和零售业	37,226,143.00	1.73
G	交通运输、仓储和邮政业	36,074,101.00	1.68
H	住宿和餐饮业	2,072,871.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	164,825,943.48	7.66
J	金融业	206,547,544.73	9.60
K	房地产业	5,073,969.30	0.24
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	9,354,140.46	0.43
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	8,493,685.00	0.39
R	文化、体育和娱乐业	2,754,786.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	1,663,251,864.92	77.34

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	521,528.00	0.02
B	采矿业	3,233,622.00	0.15
C	制造业	215,943,372.89	10.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	734,294.00	0.03
E	建筑业	891,013.00	0.04
F	批发和零售业	17,558,430.00	0.82
G	交通运输、仓储和邮政业	2,840,846.00	0.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,607,527.40	2.17
J	金融业	25,971,374.00	1.21
K	房地产业	6,160,931.00	0.29
L	租赁和商务服务业	3,070,759.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	8,566,753.56	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	4,656,972.96	0.22
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	2,893,158.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	339,650,581.81	15.79

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	002273	水晶光电	1,274,365	28,316,390.30	1.32
2	600096	云天化	1,262,000	28,142,600.00	1.31
3	688469	芯联集成	4,769,100	24,465,483.00	1.14
4	000021	深科技	1,272,800	24,259,568.00	1.13
5	601555	东吴证券	3,084,700	24,060,660.00	1.12
6	002385	大北农	5,452,450	23,609,108.50	1.10
7	002414	高德红外	3,141,152	23,338,759.36	1.09
8	000997	新大陆	1,161,180	23,165,541.00	1.08
9	600380	健康元	2,054,963	23,159,433.01	1.08
10	600517	国网英大	4,068,600	22,417,986.00	1.04
11	600968	海油发展	5,119,000	21,858,130.00	1.02
12	601866	中远海发	8,237,000	21,498,570.00	1.00
13	002926	华西证券	2,542,400	21,127,344.00	0.98
14	000783	长江证券	3,097,100	21,122,222.00	0.98
15	601168	西部矿业	1,299,000	20,874,930.00	0.97
16	000009	中国宝安	2,268,181	20,753,856.15	0.97
17	600170	上海建工	7,676,164	20,341,834.60	0.95

				0	
18	600879	航天电子	2,263,000	20,276,480.0 0	0.94
19	600141	兴发集团	929,800	20,176,660.0 0	0.94
20	601399	国机重装	6,337,494	19,519,481.5 2	0.91
21	000401	冀东水泥	3,693,400	19,316,482.0 0	0.90
22	600582	天地科技	3,038,700	18,779,166.0 0	0.87
23	603087	甘李药业	420,500	18,544,050.0 0	0.86
24	300601	康泰生物	1,071,211	18,371,268.6 5	0.85
25	000039	中集集团	2,342,570	18,201,768.9 0	0.85
26	600583	海油工程	3,325,000	18,187,750.0 0	0.85
27	603000	人民网	818,000	18,028,720.0 0	0.84
28	601608	中信重工	4,259,900	17,891,580.0 0	0.83
29	000559	万向钱潮	2,881,315	17,720,087.2 5	0.82
30	002558	巨人网络	1,392,900	17,675,901.0 0	0.82
31	601997	贵阳银行	2,866,300	17,197,800.0 0	0.80
32	002368	太极股份	724,500	17,156,160.0 0	0.80
33	000932	华菱钢铁	3,900,600	16,304,508.0 0	0.76
34	300699	光威复材	460,180	15,945,237.0 0	0.74
35	688120	华海清科	97,566	15,902,282.3 4	0.74
36	688180	君实生物	579,811	15,846,234.6 3	0.74
37	600497	驰宏锌锗	2,811,200	15,658,384.0 0	0.73
38	000539	粤电力 A	3,359,700	15,219,441.0 0	0.71

39	600578	京能电力	4,286,400	15,088,128.0 0	0.70
40	600021	上海电力	1,626,100	14,911,337.0 0	0.69
41	603927	中科软	681,120	14,780,304.0 0	0.69
42	600295	鄂尔多斯	1,513,528	14,772,033.2 8	0.69
43	300339	润和软件	289,200	14,468,676.0 0	0.67
44	688772	珠海冠宇	890,653	14,321,700.2 4	0.67
45	601966	玲珑轮胎	793,700	14,318,348.0 0	0.67
46	600637	东方明珠	1,826,188	14,171,218.8 8	0.66
47	000921	海信家电	482,543	13,945,492.7 0	0.65
48	600704	物产中大	2,725,100	13,789,006.0 0	0.64
49	002500	山西证券	2,179,783	13,689,037.2 4	0.64
50	000683	远兴能源	2,392,460	13,373,851.4 0	0.62
51	002410	广联达	1,123,400	13,211,184.0 0	0.61
52	002185	华天科技	1,134,900	13,176,189.0 0	0.61
53	300373	扬杰科技	300,800	13,090,816.0 0	0.61
54	601991	大唐发电	4,592,800	13,089,480.0 0	0.61
55	300573	兴齐眼药	185,745	12,961,286.1 0	0.60
56	600098	广州发展	1,977,700	12,696,834.0 0	0.59
57	600352	浙江龙盛	1,212,300	12,474,567.0 0	0.58
58	300054	鼎龙股份	477,000	12,411,540.0 0	0.58
59	002008	大族激光	471,520	11,788,000.0 0	0.55
60	000987	越秀资本	1,657,602	11,636,366.0 4	0.54

61	603893	瑞芯微	105,600	11,622,336.00	0.54
62	002984	森麒麟	470,380	11,599,570.80	0.54
63	688099	晶晨股份	167,376	11,495,383.68	0.53
64	300529	健帆生物	391,100	11,474,874.00	0.53
65	688005	容百科技	353,419	11,150,369.45	0.52
66	000887	中鼎股份	827,600	10,858,112.00	0.50
67	000060	中金岭南	2,242,905	10,519,224.45	0.49
68	601696	中银证券	937,550	10,463,058.00	0.49
69	300207	欣旺达	467,300	10,425,463.00	0.48
70	600906	财达证券	1,466,300	10,410,730.00	0.48
71	000830	鲁西化工	855,501	10,000,806.69	0.47
72	000728	国元证券	1,189,000	9,940,040.00	0.46
73	300763	锦浪科技	161,800	9,881,126.00	0.46
74	601918	新集能源	1,369,700	9,834,446.00	0.46
75	000050	深天马 A	1,087,958	9,824,260.74	0.46
76	000988	华工科技	219,900	9,521,670.00	0.44
77	300142	沃森生物	780,300	9,426,024.00	0.44
78	300002	神州泰岳	785,700	9,106,263.00	0.42
79	600909	华安证券	1,488,200	9,018,492.00	0.42
80	002340	格林美	1,380,900	9,017,277.00	0.42
81	601231	环旭电子	526,400	8,685,600.00	0.40
82	300558	贝达药业	155,800	8,402,294.00	0.39
83	000729	燕京啤酒	696,400	8,384,656.00	0.39
84	002202	金风科技	770,300	7,957,199.00	0.37
85	002625	光启技术	166,300	7,949,140.00	0.37
86	000034	神州数码	224,700	7,875,735.00	0.37
87	600392	盛和资源	744,100	7,649,348.00	0.36
88	688122	西部超导	177,664	7,607,572.48	0.35
89	601179	中国西电	1,000,900	7,596,831.00	0.35
90	601106	中国一重	2,582,900	7,516,239.00	0.35
91	601156	东航物流	420,300	7,090,461.00	0.33
92	300012	华测检测	564,100	7,011,763.00	0.33

93	000960	锡业股份	490,900	6,887,327.00	0.32
94	603596	伯特利	152,200	6,786,598.00	0.32
95	300888	稳健医疗	156,300	6,577,104.00	0.31
96	300136	信维通信	258,200	6,568,608.00	0.31
97	601958	金钼股份	631,700	6,354,902.00	0.30
98	603816	顾家家居	228,500	6,302,030.00	0.29
99	000733	振华科技	147,500	6,220,075.00	0.29
100	600970	中材国际	653,500	6,195,180.00	0.29
101	600316	洪都航空	188,020	6,039,202.40	0.28
102	001286	陕西能源	647,800	6,011,584.00	0.28
103	600699	均胜电子	379,454	5,946,044.18	0.28
104	600998	九州通	1,104,300	5,654,016.00	0.26
105	600339	中油工程	1,575,300	5,639,574.00	0.26
106	600859	王府井	362,300	5,583,043.00	0.26
107	300001	特锐德	226,400	4,969,480.00	0.23
108	301267	华夏眼科	260,450	4,958,968.00	0.23
109	601099	太平洋	1,111,855	4,736,502.30	0.22
110	300567	精测电子	73,400	4,719,620.00	0.22
111	002557	洽洽食品	162,400	4,717,720.00	0.22
112	600418	江淮汽车	123,400	4,627,500.00	0.22
113	600487	亨通光电	260,200	4,480,644.00	0.21
114	002444	巨星科技	131,000	4,237,850.00	0.20
115	600060	海信视像	209,100	4,169,454.00	0.19
116	300724	捷佳伟创	64,200	4,058,082.00	0.19
117	600521	华海药业	224,400	4,010,028.00	0.19
118	688234	天岳先进	77,969	3,992,012.80	0.19
119	601717	郑煤机	298,800	3,878,424.00	0.18
120	600282	南钢股份	807,700	3,788,113.00	0.18
121	300604	长川科技	85,400	3,768,702.00	0.18
122	603129	春风动力	23,900	3,753,973.00	0.17
123	601666	平煤股份	371,400	3,721,428.00	0.17
124	002128	电投能源	181,100	3,545,938.00	0.16
125	600008	首创环保	1,077,200	3,533,216.00	0.16
126	600498	烽火通信	181,400	3,530,044.00	0.16
127	002608	江苏国信	460,200	3,529,734.00	0.16
128	600208	衢州发展	1,160,000	3,433,600.00	0.16
129	600872	中炬高新	151,300	3,331,626.00	0.15
130	000883	湖北能源	653,000	3,251,940.00	0.15
131	000513	丽珠集团	84,100	3,195,800.00	0.15
132	688331	荣昌生物	104,191	3,137,191.01	0.15
133	002281	光迅科技	60,100	3,135,417.00	0.15
134	601598	中国外运	561,800	3,005,630.00	0.14
135	002152	广电运通	251,700	2,934,822.00	0.14

136	600763	通策医疗	64,900	2,881,560.00	0.13
137	688578	艾力斯	46,093	2,760,970.70	0.13
138	600765	中航重机	129,200	2,644,724.00	0.12
139	600549	厦门钨业	136,800	2,636,136.00	0.12
140	603179	新泉股份	61,600	2,630,320.00	0.12
141	600959	江苏有线	780,400	2,614,340.00	0.12
142	002120	韵达股份	341,500	2,568,080.00	0.12
143	600062	华润双鹤	126,700	2,508,660.00	0.12
144	002841	视源股份	67,600	2,495,116.00	0.12
145	002138	顺络电子	79,100	2,490,068.00	0.12
146	601108	财通证券	303,100	2,476,327.00	0.12
147	600109	国金证券	282,300	2,464,479.00	0.11
148	688248	南网科技	72,994	2,342,377.46	0.11
149	300803	指南针	24,300	2,331,585.00	0.11
150	603650	彤程新材	64,900	2,269,553.00	0.11
151	601858	中国科传	106,300	2,166,394.00	0.10
152	600258	首旅酒店	141,300	2,072,871.00	0.10
153	002517	恺英网络	146,100	1,988,421.00	0.09
154	605358	立昂微	80,000	1,981,600.00	0.09
155	600056	中国医药	176,500	1,959,150.00	0.09
156	301301	川宁生物	165,100	1,958,086.00	0.09
157	600004	白云机场	199,100	1,911,360.00	0.09
158	000032	深桑达 A	107,600	1,898,064.00	0.09
159	300919	中伟股份	52,500	1,896,300.00	0.09
160	301236	软通动力	31,825	1,868,445.75	0.09
161	300751	迈为股份	17,000	1,787,550.00	0.08
162	002019	亿帆医药	166,600	1,785,952.00	0.08
163	002156	通富微电	60,300	1,781,865.00	0.08
164	600546	山煤国际	150,200	1,776,866.00	0.08
165	300037	新宙邦	46,000	1,722,240.00	0.08
166	002532	天山铝业	217,500	1,711,725.00	0.08
167	601118	海南橡胶	292,600	1,582,966.00	0.07
168	002373	千方科技	150,900	1,530,126.00	0.07
169	002690	美亚光电	100,400	1,487,928.00	0.07
170	688538	和辉光电	588,723	1,365,837.36	0.06
171	601567	三星医疗	44,300	1,362,668.00	0.06
172	688425	铁建重工	304,340	1,339,096.00	0.06
173	002065	东华软件	183,600	1,332,936.00	0.06
174	000738	航发控制	57,800	1,285,472.00	0.06
175	601061	中信金属	175,400	1,273,404.00	0.06
176	300476	胜宏科技	30,000	1,262,700.00	0.06
177	600486	扬农化工	20,700	1,197,909.00	0.06
178	000723	美锦能源	259,900	1,172,149.00	0.05

179	688516	奥特维	26,297	1,138,923.07	0.05
180	002465	海格通信	88,300	969,534.00	0.05
181	002430	杭氧股份	41,700	909,060.00	0.04
182	000750	国海证券	204,700	876,116.00	0.04
183	688213	思特威	10,900	847,148.00	0.04
184	600271	航天信息	89,300	813,523.00	0.04
185	600007	中国国贸	31,900	780,274.00	0.04
186	603939	益丰药房	29,100	702,183.00	0.03
187	600862	中航高科	27,100	684,546.00	0.03
188	002044	美年健康	142,300	653,157.00	0.03
189	600155	华创云信	83,300	616,420.00	0.03
190	601098	中南传媒	39,200	588,392.00	0.03
191	600299	安迪苏	45,600	572,280.00	0.03
192	601577	长沙银行	60,400	536,956.00	0.02
193	603707	健友股份	38,600	512,222.00	0.02
194	600848	上海临港	50,113	506,141.30	0.02
195	300957	贝泰妮	11,400	486,666.00	0.02
196	601665	齐鲁银行	87,000	486,330.00	0.02
197	300677	英科医疗	18,200	460,096.00	0.02
198	688363	华熙生物	7,772	396,682.88	0.02
199	603883	老百姓	23,800	389,606.00	0.02
200	688385	复旦微电	9,824	377,143.36	0.02
201	301165	锐捷网络	4,700	339,340.00	0.02
202	688778	厦钨新能	6,950	317,198.00	0.01
203	688065	凯赛生物	7,451	289,098.80	0.01
204	300595	欧普康视	13,800	261,510.00	0.01
205	601155	新城控股	21,100	252,356.00	0.01
206	603899	晨光股份	7,900	238,975.00	0.01
207	300017	网宿科技	20,291	214,475.87	0.01
208	603228	景旺电子	7,500	208,800.00	0.01
209	600536	中国软件	4,000	186,760.00	0.01
210	001227	兰州银行	75,300	185,238.00	0.01
211	002850	科达利	1,800	175,824.00	0.01
212	600529	山东药玻	6,600	170,082.00	0.01
213	000591	太阳能	25,800	122,808.00	0.01
214	600606	绿地控股	58,200	122,220.00	0.01
215	688052	纳芯微	800	104,240.00	0.00
216	002244	滨江集团	11,800	101,598.00	0.00
217	688249	晶合集成	4,118	96,114.12	0.00
218	603444	吉比特	300	65,652.00	0.00
219	688220	翱捷科技	800	43,272.00	0.00
220	000423	东阿阿胶	500	31,360.00	0.00
221	002487	大金重工	400	8,196.00	0.00

222	688278	特宝生物	50	3,668.50	0.00
223	688475	萤石网络	46	1,388.74	0.00
224	688521	芯原股份	10	524.30	0.00
225	688567	孚能科技	42	487.20	0.00
226	603658	安图生物	8	349.12	0.00
227	603858	步长制药	7	110.60	0.00
228	000898	鞍钢股份	27	64.80	0.00
229	688387	信科移动	2	11.92	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	000617	中油资本	2,392,900	16,487,081.00	0.77
2	603986	兆易创新	113,500	12,121,800.00	0.56
3	600875	东方电气	645,000	10,249,050.00	0.48
4	000166	申万宏源	1,678,800	8,981,580.00	0.42
5	002396	星网锐捷	425,200	8,074,548.00	0.38
6	300014	亿纬锂能	172,700	8,071,998.00	0.38
7	600267	海正药业	967,500	8,030,250.00	0.37
8	688158	优刻得	487,379	6,813,558.42	0.32
9	600887	伊利股份	215,900	6,515,862.00	0.30
10	601096	宏盛华源	1,486,300	6,465,405.00	0.30
11	300735	光弘科技	225,900	6,322,941.00	0.29
12	301221	光庭信息	116,500	5,659,570.00	0.26
13	603799	华友钴业	168,400	4,927,384.00	0.23
14	603259	药明康德	88,600	4,876,544.00	0.23
15	000895	双汇发展	186,300	4,836,348.00	0.22
16	002489	浙江永强	1,485,300	4,812,372.00	0.22
17	002916	深南电路	37,140	4,642,500.00	0.22
18	300079	数码视讯	857,000	4,636,370.00	0.22
19	600742	一汽富维	501,800	4,440,930.00	0.21
20	000026	飞亚达	404,400	4,193,628.00	0.20
21	600050	中国联通	767,200	4,073,832.00	0.19
22	301370	国科恒泰	373,500	4,033,800.00	0.19
23	300722	新余国科	148,600	4,015,172.00	0.19
24	000977	浪潮信息	73,700	3,823,556.00	0.18
25	688568	中科星图	70,283	3,586,541.49	0.17
26	002920	德赛西威	32,200	3,545,542.00	0.16

27	300729	乐歌股份	221,500	3,517,420.00	0.16
28	002033	丽江股份	395,408	3,507,268.96	0.16
29	300533	冰川网络	172,300	3,404,648.00	0.16
30	300215	电科院	547,700	3,247,861.00	0.15
31	002773	康弘药业	165,500	3,243,800.00	0.15
32	300628	亿联网络	82,900	3,199,940.00	0.15
33	000726	鲁泰 A	489,900	3,194,148.00	0.15
34	600340	华夏幸福	1,171,900	3,152,411.00	0.15
35	300424	航新科技	169,100	3,053,946.00	0.14
36	300502	新易盛	24,500	2,831,710.00	0.13
37	300433	蓝思科技	124,700	2,730,930.00	0.13
38	000725	京东方 A	619,100	2,717,849.00	0.13
39	688588	凌志软件	189,150	2,610,270.00	0.12
40	301376	致欧科技	134,500	2,571,640.00	0.12
41	002550	千红制药	410,500	2,545,100.00	0.12
42	603501	韦尔股份	23,400	2,443,194.00	0.11
43	300531	优博讯	174,600	2,435,670.00	0.11
44	002565	顺灏股份	800,000	2,432,000.00	0.11
45	002255	海陆重工	435,100	2,419,156.00	0.11
46	002376	新北洋	354,200	2,309,384.00	0.11
47	300917	特发服务	47,100	2,278,698.00	0.11
48	300400	劲拓股份	140,400	2,277,288.00	0.11
49	688508	芯朋微	52,668	2,263,143.96	0.11
50	601633	长城汽车	84,800	2,232,784.00	0.10
51	605299	舒华体育	277,700	2,191,053.00	0.10
52	601857	中国石油	240,100	2,146,494.00	0.10
53	688590	新致软件	130,068	2,084,990.04	0.10
54	300341	麦克奥迪	117,200	2,052,172.00	0.10
55	688209	英集芯	114,092	2,016,005.64	0.09
56	300184	力源信息	208,000	1,940,640.00	0.09
57	300579	数字认证	61,400	1,929,188.00	0.09
58	002803	吉宏股份	152,100	1,928,628.00	0.09
59	002228	合兴包装	641,686	1,925,058.00	0.09
60	688312	燕麦科技	61,200	1,884,960.00	0.09
61	002613	北玻股份	465,500	1,880,620.00	0.09
62	688070	纵横股份	53,147	1,876,089.10	0.09
63	002459	晶澳科技	132,400	1,820,500.00	0.08
64	002293	罗莱生活	227,900	1,777,620.00	0.08
65	600812	华北制药	343,400	1,775,378.00	0.08
66	603888	新华网	76,200	1,702,308.00	0.08
67	600790	轻纺城	451,300	1,692,375.00	0.08
68	002548	金新农	425,100	1,687,647.00	0.08
69	688591	泰凌微	53,050	1,665,770.00	0.08

70	301025	读客文化	174,200	1,660,126.00	0.08
71	688512	慧智微	165,195	1,637,082.45	0.08
72	000957	中通客车	145,300	1,598,300.00	0.07
73	002578	闽发铝业	532,800	1,593,072.00	0.07
74	688348	昱能科技	32,579	1,589,855.20	0.07
75	600664	哈药股份	382,200	1,578,486.00	0.07
76	300545	联得装备	49,700	1,557,101.00	0.07
77	002912	中新赛克	58,000	1,484,220.00	0.07
78	600990	四创电子	67,754	1,441,805.12	0.07
79	603288	海天味业	31,260	1,434,834.00	0.07
80	300978	东箭科技	127,600	1,389,564.00	0.06
81	600941	中国移动	11,700	1,382,472.00	0.06
82	688660	电气风电	150,400	1,353,600.00	0.06
83	002562	兄弟科技	312,800	1,329,400.00	0.06
84	688553	汇宇制药	82,400	1,252,480.00	0.06
85	002642	荣联科技	174,700	1,249,105.00	0.06
86	600300	维维股份	384,700	1,238,734.00	0.06
87	688586	江航装备	129,424	1,238,587.68	0.06
88	002020	京新药业	95,600	1,223,680.00	0.06
89	688543	国科军工	24,406	1,223,228.72	0.06
90	300170	汉得信息	98,000	1,215,200.00	0.06
91	002164	宁波东力	241,100	1,207,911.00	0.06
92	000417	合百集团	189,100	1,206,458.00	0.06
93	603167	渤海轮渡	132,900	1,174,836.00	0.05
94	300399	天利科技	47,700	1,171,512.00	0.05
95	002519	银河电子	195,000	1,158,300.00	0.05
96	002421	达实智能	326,700	1,120,581.00	0.05
97	600722	金牛化工	237,700	1,112,436.00	0.05
98	300768	迪普科技	62,600	1,095,500.00	0.05
99	300781	因赛集团	18,500	1,092,055.00	0.05
100	601899	紫金矿业	71,900	1,087,128.00	0.05
101	300369	绿盟科技	146,100	1,050,459.00	0.05
102	688176	亚虹医药	133,212	904,509.48	0.04
103	002345	潮宏基	150,900	876,729.00	0.04
104	300032	金龙机电	192,500	868,175.00	0.04
105	000931	中关村	178,100	847,756.00	0.04
106	600428	中远海特	114,200	833,660.00	0.04
107	601919	中远海控	53,700	832,350.00	0.04
108	300654	世纪天鸿	80,800	815,272.00	0.04
109	002627	三峡旅游	158,200	794,164.00	0.04
110	688652	京仪装备	16,000	785,600.00	0.04
111	688798	艾为电子	11,000	768,020.00	0.04
112	603408	建霖家居	56,700	710,451.00	0.03

113	300398	飞凯材料	45,000	709,200.00	0.03
114	000920	沃顿科技	76,900	685,948.00	0.03
115	300541	先进数通	49,794	674,708.70	0.03
116	688088	虹软科技	17,043	657,178.08	0.03
117	300578	会畅通讯	32,800	631,400.00	0.03
118	301099	雅创电子	14,700	609,315.00	0.03
119	600219	南山铝业	155,000	606,050.00	0.03
120	002249	大洋电机	100,119	587,698.53	0.03
121	300121	阳谷华泰	46,500	562,185.00	0.03
122	601117	中国化学	66,700	552,943.00	0.03
123	002446	盛路通信	81,400	533,170.00	0.02
124	300761	立华股份	26,800	521,528.00	0.02
125	601766	中国中车	61,900	518,722.00	0.02
126	688522	纳睿雷达	9,200	518,328.00	0.02
127	300632	光莆股份	46,500	515,685.00	0.02
128	300445	康斯特	29,000	471,830.00	0.02
129	002461	珠江啤酒	43,200	427,248.00	0.02
130	002556	辉隆股份	74,500	414,965.00	0.02
131	688222	成都先导	33,100	407,792.00	0.02
132	000543	皖能电力	50,200	397,082.00	0.02
133	300434	金石亚药	47,100	388,575.00	0.02
134	601600	中国铝业	52,700	387,345.00	0.02
135	600383	金地集团	86,900	380,622.00	0.02
136	300581	晨曦航空	33,870	379,682.70	0.02
137	002536	飞龙股份	32,400	375,192.00	0.02
138	688066	航天宏图	18,000	367,200.00	0.02
139	002250	联化科技	65,500	360,905.00	0.02
140	002549	凯美特气	58,000	355,540.00	0.02
141	300447	全信股份	25,000	354,250.00	0.02
142	000965	天保基建	116,400	349,200.00	0.02
143	300039	上海凯宝	56,100	346,698.00	0.02
144	600478	科力远	83,600	345,268.00	0.02
145	600644	乐山电力	55,100	337,212.00	0.02
146	301036	双乐股份	7,200	282,240.00	0.01
147	600367	红星发展	23,900	275,806.00	0.01
148	601169	北京银行	44,700	274,905.00	0.01
149	300788	中信出版	8,600	271,502.00	0.01
150	688550	瑞联新材	7,800	244,062.00	0.01
151	603386	骏亚科技	20,900	232,408.00	0.01
152	000419	通程控股	40,000	228,400.00	0.01
153	600386	北巴传媒	47,800	213,666.00	0.01
154	601828	美凯龙	62,300	199,983.00	0.01
155	601818	光大银行	51,000	197,370.00	0.01

156	688625	呈和科技	5,100	194,718.00	0.01
157	300546	雄帝科技	11,200	188,384.00	0.01
158	601068	中铝国际	41,400	182,574.00	0.01
159	600710	苏美达	18,900	175,770.00	0.01
160	603687	大胜达	22,804	166,241.16	0.01
161	300637	扬帆新材	17,500	161,000.00	0.01
162	600284	浦东建设	24,800	155,496.00	0.01
163	688472	阿特斯	11,100	139,416.00	0.01
164	688252	天德钰	5,800	138,910.00	0.01
165	301052	果麦文化	5,100	129,744.00	0.01
166	300890	翔丰华	4,200	127,092.00	0.01
167	603739	蔚蓝生物	10,300	123,497.00	0.01
168	600210	紫江企业	17,500	115,675.00	0.01
169	300270	中威电子	16,100	115,115.00	0.01
170	603890	春秋电子	9,500	111,625.00	0.01
171	300662	科锐国际	4,100	86,346.00	0.00
172	600468	百利电气	17,900	84,130.00	0.00
173	002179	中航光电	2,000	78,600.00	0.00
174	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.00
175	688615	合合信息	289	47,910.42	0.00
176	002367	康力电梯	6,800	46,716.00	0.00
177	002585	双星新材	8,700	46,458.00	0.00
178	300634	彩讯股份	2,100	45,780.00	0.00
179	688579	山大地纬	4,614	42,402.66	0.00
180	300438	鹏辉能源	1,500	42,165.00	0.00
181	000963	华东医药	1,200	41,520.00	0.00
182	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00
183	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.00
184	300691	联合光电	2,000	39,440.00	0.00
185	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
186	300160	秀强股份	6,800	36,992.00	0.00
187	300101	振芯科技	1,600	34,656.00	0.00
188	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
189	600015	华夏银行	3,800	30,438.00	0.00
190	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
191	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
192	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.00
193	688372	伟测科技	400	23,408.00	0.00
194	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
195	601949	中国出版	2,300	16,514.00	0.00
196	002703	浙江世宝	1,400	15,918.00	0.00
197	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
198	300274	阳光电源	200	14,766.00	0.00

199	300666	江丰电子	200	13,890.00	0.00
200	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
201	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
202	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
203	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
204	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
205	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
206	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
207	002906	华阳集团	300	9,225.00	0.00
208	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
209	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
210	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
211	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
212	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
213	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
214	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
215	688128	中国电研	136	2,857.36	0.00
216	688313	仕佳光子	115	1,884.85	0.00
217	688107	安路科技	24	709.92	0.00
218	688141	杰华特	23	704.03	0.00
219	688062	迈威生物	33	666.60	0.00
220	300176	鸿特科技	38	262.96	0.00
221	688010	福光股份	9	256.50	0.00
222	688981	中芯国际	2	189.24	0.00
223	688063	派能科技	4	160.20	0.00
224	688055	龙腾光电	31	128.03	0.00
225	002427	尤夫股份	35	121.80	0.00
226	688221	前沿生物	10	97.60	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	000559	万向钱潮	94,107,563.89	4.15
2	301236	软通动力	92,732,260.50	4.09
3	300502	新易盛	89,148,019.69	3.93
4	600879	航天电子	86,073,244.40	3.80
5	601168	西部矿业	86,066,003.00	3.80
6	600497	驰宏锌锗	84,457,769.00	3.73
7	002185	华天科技	81,191,625.05	3.58
8	000021	深科技	81,119,903.78	3.58

9	000050	深天马 A	81,086,129.95	3.58
10	688099	晶晨股份	80,743,548.35	3.56
11	600418	江淮汽车	80,468,578.57	3.55
12	002625	光启技术	76,984,920.66	3.40
13	000039	中集集团	76,380,974.09	3.37
14	688772	珠海冠宇	75,248,295.37	3.32
15	002273	水晶光电	73,053,166.64	3.22
16	601179	中国西电	73,041,439.50	3.22
17	601991	大唐发电	71,876,731.00	3.17
18	300595	欧普康视	68,304,705.32	3.01
19	601608	中信重工	67,530,824.18	2.98
20	002385	大北农	67,360,534.20	2.97
21	600096	云天化	67,298,489.00	2.97
22	603893	瑞芯微	67,125,856.00	2.96
23	300558	贝达药业	67,093,253.20	2.96
24	300054	鼎龙股份	66,031,858.00	2.91
25	600299	安迪苏	65,978,930.53	2.91
26	600141	兴发集团	65,219,590.40	2.88
27	601118	海南橡胶	64,927,060.74	2.86
28	601231	环旭电子	64,438,379.00	2.84
29	600066	宇通客车	64,140,670.90	2.83
30	600839	四川长虹	64,048,896.00	2.82
31	300394	天孚通信	63,988,827.76	2.82
32	300207	欣旺达	63,914,456.20	2.82
33	603228	景旺电子	63,541,823.73	2.80
34	000630	铜陵有色	62,620,514.00	2.76
35	002340	格林美	61,674,905.00	2.72
36	002156	通富微电	61,472,448.00	2.71
37	300136	信维通信	61,354,923.24	2.71
38	300529	健帆生物	61,179,710.12	2.70
39	000921	海信家电	60,404,433.13	2.66
40	000783	长江证券	60,297,905.82	2.66
41	600098	广州发展	60,186,019.70	2.65
42	601555	东吴证券	59,933,646.00	2.64
43	600498	烽火通信	59,690,070.87	2.63
44	300088	长信科技	59,667,740.00	2.63
45	600968	海油发展	59,575,041.64	2.63
46	000878	云南铜业	59,452,134.00	2.62
47	002422	科伦药业	59,062,696.69	2.61
48	000683	远兴能源	58,964,142.60	2.60
49	300803	指南针	58,894,820.00	2.60
50	600549	厦门钨业	58,877,548.58	2.60
51	300724	捷佳伟创	58,699,004.22	2.59

52	002202	金风科技	58,678,504.40	2.59
53	600827	百联股份	58,597,942.33	2.58
54	600038	中直股份	58,357,699.00	2.57
55	600699	均胜电子	58,286,183.00	2.57
56	601633	长城汽车	58,257,974.20	2.57
57	002120	韵达股份	58,040,634.00	2.56
58	601108	财通证券	57,727,713.50	2.55
59	600500	中化国际	56,855,008.90	2.51
60	600985	淮北矿业	56,491,197.10	2.49
61	601997	贵阳银行	56,216,826.00	2.48
62	600050	中国联通	56,053,504.00	2.47
63	600062	华润双鹤	55,896,869.63	2.47
64	600582	天地科技	55,778,458.33	2.46
65	000729	燕京啤酒	55,357,934.34	2.44
66	600392	盛和资源	55,087,300.91	2.43
67	601666	平煤股份	54,913,769.14	2.42
68	000009	中国宝安	54,759,758.08	2.42
69	600637	东方明珠	54,735,355.76	2.41
70	600521	华海药业	54,508,153.00	2.40
71	002532	天山铝业	54,335,484.00	2.40
72	000825	太钢不锈	54,009,062.00	2.38
73	600021	上海电力	53,836,172.08	2.37
74	603000	人民网	53,553,319.96	2.36
75	600517	国网英大	53,492,683.00	2.36
76	000988	华工科技	53,395,637.24	2.36
77	000830	鲁西化工	53,349,066.00	2.35
78	603650	彤程新材	53,322,642.44	2.35
79	300357	我武生物	53,289,750.64	2.35
80	002423	中粮资本	53,015,038.61	2.34
81	601717	郑煤机	52,996,396.00	2.34
82	600704	物产中大	52,993,710.00	2.34
83	000539	粤电力 A	52,499,192.00	2.32
84	688248	南网科技	52,497,892.91	2.32
85	600079	人福医药	52,064,026.01	2.30
86	002558	巨人网络	51,504,636.00	2.27
87	000997	新大陆	51,176,948.80	2.26
88	000932	华菱钢铁	50,915,888.40	2.25
89	002128	电投能源	50,523,267.00	2.23
90	601966	玲珑轮胎	50,007,255.60	2.21
91	600282	南钢股份	49,884,314.00	2.20
92	600909	华安证券	49,866,913.83	2.20
93	002152	广电运通	49,829,005.40	2.20
94	002019	亿帆医药	49,506,759.00	2.18

95	600482	中国动力	48,587,588.00	2.14
96	600380	健康元	48,519,350.32	2.14
97	000887	中鼎股份	48,444,705.51	2.14
98	002414	高德红外	47,899,030.95	2.11
99	600339	中油工程	47,836,810.69	2.11
100	000728	国元证券	47,817,196.00	2.11
101	688005	容百科技	47,457,972.93	2.09
102	002008	大族激光	47,258,345.00	2.08
103	600863	内蒙华电	47,132,149.39	2.08
104	300017	网宿科技	46,677,720.07	2.06
105	601857	中国石油	46,451,877.00	2.05
106	601958	金钼股份	46,119,573.00	2.03
107	300383	光环新网	46,047,328.00	2.03
108	002056	横店东磁	46,039,357.00	2.03
109	603317	天味食品	46,034,491.58	2.03
110	002281	光迅科技	45,738,869.00	2.02
111	000060	中金岭南	45,527,852.35	2.01
112	688208	道通科技	45,387,478.40	2.00

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600497	驰宏锌锗	93,771,086.00	4.14
2	000559	万向钱潮	93,217,806.78	4.11
3	301236	软通动力	92,086,558.50	4.06
4	000050	深天马 A	90,285,983.86	3.98
5	300502	新易盛	88,339,491.82	3.90
6	603228	景旺电子	86,847,239.44	3.83
7	600498	烽火通信	85,963,459.54	3.79
8	300558	贝达药业	84,954,328.32	3.75
9	002423	中粮资本	81,580,615.09	3.60
10	600418	江淮汽车	80,510,806.00	3.55
11	600062	华润双鹤	79,551,319.00	3.51
12	300595	欧普康视	78,965,842.45	3.48
13	688099	晶晨股份	76,404,449.73	3.37
14	601179	中国西电	74,767,083.69	3.30
15	600141	兴发集团	74,644,347.68	3.29
16	002625	光启技术	72,414,490.16	3.19
17	600096	云天化	72,196,112.00	3.18
18	002185	华天科技	72,133,451.78	3.18

19	002152	广电运通	72,131,050.62	3.18
20	300088	长信科技	70,924,920.31	3.13
21	300724	捷佳伟创	70,021,279.50	3.09
22	600879	航天电子	69,549,550.84	3.07
23	300357	我武生物	69,304,095.68	3.06
24	000021	深科技	68,269,532.38	3.01
25	300394	天孚通信	67,955,075.36	3.00
26	601168	西部矿业	67,915,608.47	3.00
27	600299	安迪苏	67,045,318.89	2.96
28	002056	横店东磁	67,038,153.07	2.96
29	000630	铜陵有色	66,953,138.50	2.95
30	000039	中集集团	66,906,698.80	2.95
31	688772	珠海冠宇	66,632,705.96	2.94
32	600839	四川长虹	66,538,978.00	2.93
33	002532	天山铝业	66,453,309.10	2.93
34	002673	西部证券	66,241,479.46	2.92
35	600582	天地科技	66,097,376.02	2.92
36	000729	燕京啤酒	65,193,779.28	2.88
37	601231	环旭电子	64,536,144.19	2.85
38	000878	云南铜业	64,496,905.00	2.84
39	601118	海南橡胶	64,146,166.66	2.83
40	000960	锡业股份	63,835,755.32	2.82
41	600500	中化国际	62,748,866.10	2.77
42	002422	科伦药业	62,682,005.94	2.76
43	300136	信维通信	62,642,556.00	2.76
44	002156	通富微电	62,277,947.00	2.75
45	600066	宇通客车	61,891,951.71	2.73
46	600038	中直股份	61,627,601.00	2.72
47	688819	天能股份	61,509,867.86	2.71
48	603317	天味食品	61,444,397.08	2.71
49	002120	韵达股份	61,331,306.00	2.71
50	603893	瑞芯微	61,140,312.98	2.70
51	600549	厦门钨业	60,945,635.00	2.69
52	002340	格林美	60,606,006.07	2.67
53	600637	东方明珠	60,480,624.70	2.67
54	000060	中金岭南	60,197,277.36	2.66
55	002558	巨人网络	59,769,025.00	2.64
56	601608	中信重工	59,622,489.80	2.63
57	300529	健帆生物	59,269,650.85	2.61
58	000830	鲁西化工	59,256,339.58	2.61
59	300207	欣旺达	58,706,978.24	2.59
60	601577	长沙银行	58,097,855.44	2.56
61	600827	百联股份	57,925,519.06	2.55

62	300383	光环新网	57,902,193.00	2.55
63	600699	均胜电子	57,476,071.34	2.54
64	601633	长城汽车	57,420,297.36	2.53
65	601991	大唐发电	57,282,423.00	2.53
66	000738	航发控制	57,033,603.00	2.52
67	300803	指南针	56,280,868.86	2.48
68	002563	森马服饰	56,051,274.08	2.47
69	603650	彤程新材	55,972,981.19	2.47
70	601216	君正集团	55,901,071.68	2.47
71	002202	金风科技	55,454,593.20	2.45
72	000739	普洛药业	55,348,523.34	2.44
73	000825	太钢不锈	55,274,247.50	2.44
74	601108	财通证券	54,820,385.60	2.42
75	600642	申能股份	54,494,784.04	2.40
76	600050	中国联通	54,242,307.00	2.39
77	600985	淮北矿业	54,160,112.90	2.39
78	600580	卧龙电驱	53,391,017.99	2.35
79	688248	南网科技	52,789,845.63	2.33
80	300054	鼎龙股份	52,389,647.00	2.31
81	000783	长江证券	52,252,556.48	2.30
82	600737	中粮糖业	51,588,137.56	2.28
83	000959	首钢股份	51,450,812.93	2.27
84	600482	中国动力	51,439,110.00	2.27
85	002273	水晶光电	51,415,208.23	2.27
86	002128	电投能源	51,375,720.92	2.27
87	600392	盛和资源	51,235,326.10	2.26
88	601666	平煤股份	51,169,819.35	2.26
89	600521	华海药业	50,908,894.80	2.25
90	000887	中鼎股份	50,786,115.52	2.24
91	000728	国元证券	50,552,415.50	2.23
92	601000	唐山港	50,372,522.62	2.22
93	600535	天士力	49,490,758.20	2.18
94	600079	人福医药	49,079,824.43	2.16
95	000636	风华高科	49,069,112.64	2.16
96	002281	光迅科技	48,715,667.00	2.15
97	601857	中国石油	48,469,944.00	2.14
98	600970	中材国际	48,098,251.65	2.12
99	000932	华菱钢铁	48,092,779.00	2.12
100	300024	机器人	47,104,559.86	2.08
101	600098	广州发展	46,984,283.56	2.07
102	000988	华工科技	46,906,568.36	2.07
103	600143	金发科技	46,657,150.87	2.06
104	688208	道通科技	46,605,851.43	2.06

105	300009	安科生物	46,509,134.05	2.05
106	300474	景嘉微	46,471,751.62	2.05
107	688521	芯原股份	46,179,808.59	2.04
108	603056	德邦股份	45,920,073.82	2.03
109	600863	内蒙华电	45,848,939.91	2.02
110	000987	越秀资本	45,730,832.74	2.02
111	601717	郑煤机	45,572,410.00	2.01
112	300017	网宿科技	45,534,487.00	2.01
113	002019	亿帆医药	45,491,695.00	2.01
114	000921	海信家电	45,423,099.16	2.00
115	600390	五矿资本	45,409,840.70	2.00

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	20,453,715,427.33
卖出股票收入（成交）总额	20,772,849,770.32

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

8.12 投资组合报告附注

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

本基金持有的前十名证券发行主体东吴证券股份有限公司，2024 年 2 月因未认真履行信披义务，被上海证券交易所书面警示；2024 年 4-5 月因非公开发行业务未勤勉尽责，被证监会立案调查、书面警示，被深证交易所通报批评；2024 年 11 月因未依法履行职责被证监会罚款并责令改正。

本基金持有的前十名证券发行主体国网英大股份有限公司，2024 年 4 月因信息披露虚假或严重误导性陈述，被证监会分局责令改正。

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	3,793,041.60

2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	33,126,160.57
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	36,919,202.17

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国泰君安中证 500 指数增强 A	511,589	2,956.22	478,956,975.97	31.67%	1,033,413,482.42	68.33%
国泰君安中证 500 指数增强 C	183,330	3,810.89	351,621,489.57	50.33%	347,029,442.35	49.67%

合计	694,919	3,181.70	830,578,465.54	37.57%	1,380,442,924.77	62.43%
----	---------	----------	----------------	--------	------------------	--------

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	国泰君安中证 500 指数增强 A	2,881,085.01	0.1905%
	国泰君安中证 500 指数增强 C	1,468,407.60	0.2102%
	合计	4,349,492.61	0.1967%

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

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安中证 500 指数 增强 A	国泰君安中证 500 指数 增强 C
基金合同生效日（2021 年 12 月 15 日）基金 份额总额	720,641,928.72	440,062,218.02
本报告期期初基金份额总额	1,513,115,108.29	1,082,577,289.11
本报告期基金总申购份额	670,698,775.41	938,842,870.16
减：本报告期基金总赎回份额	671,443,425.31	1,322,769,227.35
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	1,512,370,458.39	698,650,931.92

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 50,000.00 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

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无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	41,223,379,611.79	100.00%	2,961,339.29	100.00%	-

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	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年第四季	证监会指定网站、公司官网	2024-01-22

	度报告		
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	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金 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	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-04-22
9	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
10	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2024-05-16
11	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-05-21
12	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-05-21
13	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 1 号）	证监会指定网站、公司官网	2024-05-21
14	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-07-19
15	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
16	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
17	国泰君安中证 500 指数增强型	证监会指定网站、公司官网	2024-08-30

	证券投资基金 2024 年中期报告		
18	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
19	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
20	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-10-25
21	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
22	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
23	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
24	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
25	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-12-13
26	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-12-13
27	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 2 号）	证监会指定网站、公司官网	2024-12-13
28	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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站
<http://www.gtjazg.com>。

13.3 查阅方式

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

上海国泰君安证券资产管理有限公司
二〇二五年三月三十一日