

国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 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:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 08 月 30 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。本中期报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年01月01日起至2024年06月30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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 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.....	13

§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
7.6 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.....	61
7.7 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.....	61
7.8 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.....	61
7.9 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.....	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
7.12 投资组合报告附注.....	61

§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
8.3 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	63
§ 9 开放式基金份额变动	64
§ 10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
10.2 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.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
10.8 其他重大事件.....	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
11.1 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.....	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§ 12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	国泰君安中证 1000 指数增强	
基金主代码	015867	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 08 月 16 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	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	779,251,349.36 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 1000 指数增强 A	国泰君安中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	015867	015868
报告期末下属分级基金的份 额总额	327,460,558.29 份	451,790,791.07 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，在力求对中证 1000 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	<ol style="list-style-type: none"> 1、股票投资策略 2、债券投资策略 3、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略 4、资产支持证券投资策略 5、股指期货投资策略 6、国债期货投资策略 7、融资及转融通证券出借业务投资策略
业绩比较基准	中证 1000 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负 责人	姓名	吕巍
	联系电话	021-38676022
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com
客户服务电话	95521	95599
传真	021-38871190	010-68121816
注册地址	上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室	北京市东城区建国门内大街 69 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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200120	100031
法定代表人	陶耿	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名 称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理 人互联网网址	www.gtjazg.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2024 年 01 月 01 日-2024 年 06 月 30 日）	
	国泰君安中证 1000 指数增 强 A	国泰君安中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	-26,971,036.65	-70,544,744.89
本期利润	-33,771,240.84	-86,708,691.35
加权平均基金份额本期利润	-0.0997	-0.1243
本期加权平均净值利润率	-11.51%	-14.46%
本期基金份额净值增长率	-10.42%	-10.60%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-55,133,462.50	-78,876,085.29
期末可供分配基金份额利润	-0.1684	-0.1746
期末基金资产净值	272,327,095.79	372,914,705.78
期末基金份额净值	0.8316	0.8254
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-16.84%	-17.46%

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 1000 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
过去一个月	-6.58%	1.44%	-8.15%	1.36%	1.57%	0.08%
过去三个月	-5.46%	1.47%	-9.51%	1.42%	4.05%	0.05%
过去六个月	-10.42%	1.91%	-15.97%	1.87%	5.55%	0.04%
过去一年	-16.85%	1.49%	-24.61%	1.47%	7.76%	0.02%
自基金合同生效起至今	-16.84%	1.28%	-31.27%	1.29%	14.43%	-0.01%

国泰君安中证 1000 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
过去一个月	-6.61%	1.44%	-8.15%	1.36%	1.54%	0.08%
过去三个月	-5.55%	1.47%	-9.51%	1.42%	3.96%	0.05%
过去六个月	-10.60%	1.91%	-15.97%	1.87%	5.37%	0.04%
过去一年	-17.18%	1.49%	-24.61%	1.47%	7.43%	0.02%
自基金合同生效起至今	-17.46%	1.28%	-31.27%	1.29%	13.81%	-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1000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

(2022年08月16日-2024年06月30日)



国泰君安中证1000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

(2022年08月16日-2024年06月30日)



§ 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 6 月 30 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 53 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡崇海	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金	2022-08-16	-	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。

	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。				
--	---------------------------------	--	--	--	--

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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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 2 次。本基金与本公司管理的其他组合在不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 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

上半年，市场风险偏好降至冰点，投资者在不确定性笼罩下寻求避风港，红利及大型垄断性国企成为资金青睐的对象，展现出显著的超额收益。这不仅反映了投资者对确定性资产的强烈需求，也揭示了市场在动荡时期的价值回归趋势。同时，今年两市跑赢沪深 300 指数的公司不足 15%，而跑赢中证 500 的公司也不到 1/4，整体市场平均涨跌幅超过 20%，显示出明显的亏钱效应，这对以

分散化持股为主要投资风格的量化策略并不友好。

从主要风险因子的走势来看，一季度许多风险因子走势极端，规模因子和非线性规模因子一度达到历史 20 倍标准差的极端水平，残差波动率和短期反转等因子也多次达到历史极值。二季度许多风险因子延续了之前的走势。上半年大盘风格和价值风格表现优于成长风格和中小盘风格，大盘价值指数表现相对较好，高股息为代表的防御风格总体表现优于其他风格指数。动量因子延续 2023 年的稳定走势，持续表现强劲，分析师情绪因子相较 2023 年四季度出现明显提升。Alpha 表现方面，上半年整体基本面因子表现较好，财务质量和估值类因子表现强劲。实时量价因子在一季度表现受制于春节前后小票的极端行情，波动较大，在春节后市场反弹阶段逐步回到历史稳态表现，二季度受制于市场风险事件及投资者情绪恶化，出现极端缩量行情，实时量价因子因此表现一般。鉴于今年市场环境的复杂性，我们特别重视提升业绩稳定性。展望未来，随着经济进一步复苏以及政策进一步发力，资本市场信息和活跃度有望逐步恢复，我们认为基本面和量价模型会有较好的发挥空间，同时我们也将根据市场的演化过程不断引入新因子和改进原有模型，强化选股模型对不同风格的适应能力，在保持稳中求胜的风格下追求更好的超额收益率。

从中证 1000 指数当前的估值水平来看，截至 6 月底其加权 PE 和整体 PE 分别在 30 倍和 32 倍左右，依然处于历史较为低估的水平，整体 PE 在历史上的分位数低于 18.6%，而用 PB 估值的话，则历史分位数更低，处于历史分位数 5.5% 之内。从业绩的可持续角度来看，估值进一步向下的空间要显著小于向上的空间。未来随着经济的全面逐步复苏，有望迎来估值和盈利的双击。我们认为做为一个高成长性、盈利增长潜力巨大，行业分布均匀的中小盘宽基指数，中证 1000 指数依然是当前市场环境下成长和进攻性资产的选择。

随着我国积极的财政政策适度加力，高水平对外开放政策不断延续，以及消费需求仍处于充分释放阶段，未来市场具备回升条件，我们预计，未来市场板块轮动速度仍然较快。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，并尽可能以此来稳定投资者对我们超额收益率的预期。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。在量化增强层面，我们将结合财务数据为基础的基本面信号和实时量价信号，通过机器学习模型来有效选择因子，并通过投资组合管理来控制模型在主要市场风险和行业上相对于基准指数的暴露程度，力求以较为稳定的方式增强中证 1000 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 1000 指数当前依然处于历史低估阶段，成长性良好，指数未来上涨的空间依然远大于下跌的空间，我们将努力通过科学的手段增强量化模型的超额收益率水平，以此不断为客户增厚投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 0.8316 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.42%，同期业绩比较基准收益率为-15.97%；截至报告期末国泰君安中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 0.8254 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.60%，同期业绩比较基准收益率为-15.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，A 股权益市场估值仍然处于历史底部位置，A 股指数具有较高的配置性价比，在积极的财政和货币政策的支撑下，A 股依然有望延续震荡反弹的格局。海外方面，美联储降息预期再次扩张，引来美元指数和美债利率的进一步走弱，人民币汇率回升，有助于海外资金加速回流 A 股。国内方面，监管层面对股票市场的非常态波动采取了积极行动，“国九条”的实施与打击财务造假举措的不断推进，短期内对中小市值公司确实造成一定情绪面的冲击，但长远来看，这些措施犹如“刮骨疗伤”，短期的阵痛反而有利于资本市场中长期的健康发展，在提升上市公司质量和注重投资者回报的同时，为投资者创造更加透明和公平的投资环境。审视当下的行情，诚然目前市场依然处于风险偏好较低的缩量博弈阶段，市场信心的恢复尚需时日，但是我们认为大多数股票的市场化“出清”较为彻底，过去多年的下跌对当下复杂经济环境和国际政治形势的估值消化已经较为充分，“磨底”的煎熬并不妨碍我们对于下半年主要股票宽基指数的行情变得积极乐观起来。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—上海国泰君安证券资产管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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

本托管人认为，上海国泰君安证券资产管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，上海国泰君安证券资产管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	50,248,017.60	137,588,188.36
结算备付金		4,270,428.75	8,988,273.99
存出保证金		1,865,472.00	1,413,120.00
交易性金融资产	6.4.7.2	594,467,956.44	1,221,467,913.87

其中：股票投资		594,467,956.44	1,221,467,913.87
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		906,519.03	1,787,300.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		651,758,393.82	1,371,244,796.91
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产 款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		5,602,140.49	65,789,523.93
应付管理人报酬		566,795.39	1,180,358.76

应付托管费		85,019.28	177,053.81
应付销售服务费		134,271.37	367,427.07
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	6.4.7.6	128,365.72	160,013.99
负债合计		6,516,592.25	67,674,377.56
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	779,251,349.36	1,410,006,840.95
未分配利润	6.4.7.8	-134,009,547.79	-106,436,421.60
净资产合计		645,241,801.57	1,303,570,419.35
负债和净资产总计		651,758,393.82	1,371,244,796.91

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 779,251,349.36 份。其中国泰君安中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 0.8316 元，基金份额总额 327,460,558.29 份；国泰君安中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 0.8254 元，基金份额总额 451,790,791.07 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-114,076,551.76	64,042,508.67
1. 利息收入		230,936.80	137,331.22
其中：存款利息收入	6.4.7.9	230,936.80	137,331.22
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）		-91,545,914.37	49,561,708.93
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-96,744,972.86	45,294,058.54
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	6.4.7.11	-716,097.88	914,887.15
股利收益	6.4.7.12	5,915,156.37	3,352,763.24
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-22,964,150.65	13,848,167.92
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	202,576.46	495,300.60
减：二、营业总支出		6,403,380.43	3,410,800.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,446,281.11	2,446,877.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	666,942.10	367,031.57
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,195,462.83	506,981.47
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		881.13	4,643.55
8. 其他费用	6.4.7.15	93,813.26	85,266.72

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-120,479,932.19	60,631,707.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-120,479,932.19	60,631,707.89
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-120,479,932.19	60,631,707.89

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,410,006,840.95	-106,436,421.60	1,303,570,419.35
二、本期期初净资产	1,410,006,840.95	-106,436,421.60	1,303,570,419.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-630,755,491.59	-27,573,126.19	-658,328,617.78
（一）、综合收益总额	-	-120,479,932.19	-120,479,932.19
（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）	-630,755,491.59	92,906,806.00	-537,848,685.59
其中：1. 基金申购款	365,599,994.23	-49,719,829.64	315,880,164.59
2. 基金赎回款	-996,355,485.82	142,626,635.64	-853,728,850.18
（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	779,251,349.36	-134,009,547.79	645,241,801.57
项目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	583,221,036.84	-55,719,264.90	527,501,771.94
二、本期期初净资产	583,221,036.84	-55,719,264.90	527,501,771.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	43,772,190.04	54,362,760.19	98,134,950.23
（一）、综合收益总额	-	60,631,707.89	60,631,707.89
（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）	43,772,190.04	-6,268,947.70	37,503,242.34

其中：1. 基金申购款	550,024,143.14	-4,648,039.89	545,376,103.25
2. 基金赎回款	-506,251,953.10	-1,620,907.81	-507,872,860.91
(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	626,993,226.88	-1,356,504.71	625,636,722.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陶耿	陶耿	茹建江
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)已获中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]983 号《关于准予国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》，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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2022 年 8 月 1 日至 2022 年 8 月 12 日共募集 609,312,722.10 元(不含认购资金利息)，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(2022)验字第 0724 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2022 年 8 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额 609,392,211.62 份基金份额，其中认购资金利息折合 79,489.52 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》，本基金根据是否收取认购费、申购费、销售服务费，将基金份额分为不同的类别。投资人在认购、申购时收取认购费、申购费，但不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；投资人在认购、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 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要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%,投资于中证 1000 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 1000 指数收益率 \times 95%+同期银行活期存款利率(税后) \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报告所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
活期存款	28,008,509.48
等于：本金	28,004,731.63
加：应计利息	3,777.85
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	22,239,508.12
等于：本金	22,238,080.34
加：应计利息	1,427.78
减：坏账准备	-
合计	50,248,017.60

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。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	631,180,642.44	-	594,467,956.44	-36,712,686.00
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	631,180,642.44	-	594,467,956.44	-36,712,686.00

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 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 06 月 30 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	15,998,626.00	0.00	-	-
股指期货	15,998,626.00	0.00	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	15,998,626.00	0.00	-	-

6.4.7.3.2 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
IM2407	IM2407	16	15,545,600.00	-453,026.00
合计				-453,026.00
减：可抵销期货暂收款				-453,026.00
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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	129.97
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	-
预提信息披露费	59,672.34
预提审计费	24,863.02
其他应付	43,700.39
合计	128,365.72

6.4.7.7 实收基金

国泰君安中证 1000 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 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	350,853,146.00	350,853,146.00
本期申购	41,735,539.40	41,735,539.40
本期赎回（以“-”号填列）	-65,128,127.11	-65,128,127.11
本期末	327,460,558.29	327,460,558.29

国泰君安中证 1000 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 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,059,153,694.95	1,059,153,694.95
本期申购	323,864,454.83	323,864,454.83
本期赎回（以“-”号填列）	-931,227,358.71	-931,227,358.71
本期末	451,790,791.07	451,790,791.07

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

国泰君安中证 1000 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	-13,663,694.18	-11,485,093.89	- 25,148,788.07
本期期初	-13,663,694.18	-11,485,093.89	- 25,148,788.07
本期利润	-26,971,036.65	-6,800,204.19	- 33,771,240.84
本期基金份额交易产生的变动数	2,720,439.76	1,066,126.65	3,786,566.41
其中：基金申购款	-3,835,450.29	-1,539,517.93	-5,374,968.22
基金赎回款	6,555,890.05	2,605,644.58	9,161,534.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-37,914,291.07	-17,219,171.43	- 55,133,462.50

国泰君安中证 1000 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	-46,677,029.73	-34,610,603.80	- 81,287,633.53
本期期初	-46,677,029.73	-34,610,603.80	- 81,287,633.53
本期利润	-70,544,744.89	-16,163,946.46	- 86,708,691.35
本期基金份额交易产生的变动数	62,011,512.15	27,108,727.44	89,120,239.59
其中：基金申购款	-32,971,076.91	-11,373,784.51	- 44,344,861.42
基金赎回款	94,982,589.06	38,482,511.95	133,465,101.0 1
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-55,210,262.47	-23,665,822.82	- 78,876,085.29

6.4.7.9 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 06 月 30 日
活期存款利息收入	130,958.40
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	26,718.17

结算备付金利息收入	73,260.23
其他	-
合计	230,936.80

6.4.7.10 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 06 月 30 日
卖出股票成交总额	5,388,525,194.80
减：卖出股票成本总额	5,481,148,945.96
减：交易费用	4,121,221.70
买卖股票差价收入	-96,744,972.86

6.4.7.11 衍生工具收益

6.4.7.11.1 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 06 月 30 日
股指期货投资收益	-667,721.54
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	7,342.87
减：交易费用	41,033.47
合计	-716,097.88

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,915,156.37
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	5,915,156.37

6.4.7.13 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 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-22,334,152.19
——股票投资	-22,334,152.19
——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	-629,998.46
——权证投资	-
——期货投资	-629,998.46
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	-22,964,150.65

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	202,576.46
合计	202,576.46

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	9,277.90
合计	93,813.26

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)	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、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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 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	10,263,698,145.54	100.00%	12,934,151,809.07	100.00%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 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	768,482.43	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 06 月 30 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	921,987.72	100.00%	0.00	0.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,446,281.11	2,446,877.47
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,220,308.08	971,040.42
应支付基金管理人的净管理费	3,225,973.03	1,475,837.05

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	666,942.10	367,031.57

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：

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

6.4.10.2.3 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 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安中证 1000 指数 增强 A	国泰君安中证 1000 指数 增强 C	合计
国泰君安证券	-	247,109.38	247,109.38

国泰君安资管	-	585,752.31	585,752.31
合计	-	832,861.69	832,861.69
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 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安中证 1000 指数 增强 A	国泰君安中证 1000 指数 增强 C	合计
国泰君安证券	-	325,044.32	325,044.32
国泰君安资管	-	55,121.60	55,121.60
合计	-	380,165.92	380,165.92

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。

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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国泰君安中证 1000 指数增强 C

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2022 年 08 月 16 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	8,314,279.78	-
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	8,314,279.78	-
报告期末持有的基金份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	0.00%	-

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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行，本基金本报告期

未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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 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	22,239,508.1 2	26,718.17	20,769,856.5 7	29,872.03
农业银行	28,008,509.4 8	130,958.40	16,229,560.4 5	77,199.26

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国农业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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须做说明的其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688717	艾罗能源	2023 年 12 月 26	1-6 个月 (含	网下新	55.66	47.02	11,303	629,124.98	531,467.06	-

		日)	股 限 售						
301589	诺瓦星云	2024年02月01日	1-6个月(含)	网下新股限售	126.89	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	-
603350	安乃达	2024年06月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-
688709	成都华微	2024年01月31日	1-6个月(含)	网下新股限售	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-
301536	星宸科技	2024年03月20日	1-6个月(含)	网下新股限售	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
688584	上海合晶	2024年02月01日	1-6个月(含)	网下新股限售	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
301580	爱迪特	2024年06月19日	1-6个月(含)	网下新股限售	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
688691	灿芯股份	2024年04月02日	1-6个月(含)	网下新股限售	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-

301566	达利凯普	2023年12月22日	1-6个月(含)	创业板打新限售	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024年05月28日	1-6个月(含)	网下新股限售	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301587	中瑞股份	2024年03月27日	1-6个月(含)	网下新股限售	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024年03月26日	1-6个月(含)	网下新股限售	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024年04月03日	1-6个月(含)	网下新股限售	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688530	欧莱新材	2024年04月29日	1-6个月(含)	网下新股限售	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024年03月06日	1-6个月(含)	网下新股限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
30150	华阳	2024	1-6个月	网	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-

2	智能	年 01 月 26 日	月 (含)	下新股限售						
603325	博隆技术	2024 年 01 月 03 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603381	永臻股份	2024 年 06 月 19 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
603344	星德胜	2024 年 03 月 13 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
001359	平安电工	2024 年 03 月 19 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603312	西典新能	2024 年 01 月 04 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
001379	腾达科技	2024 年 01 月 11 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024 年 01 月 17 日	1-6 个月 (含)	网下新	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-

		日)	股 限 售						
--	--	---	---	-------------	--	--	--	--	--	--

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末成本 总额	期末估值 总额	备注
300630	普利制药	2024-05-06	-	12.35	2024-07-08	9.88	16,700	228,246.55	206,245.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司，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 6 月 30 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）。

6.4.13.3 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 6 月 30 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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 6.4.12。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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	50,248,017.60	-	-	-	50,248,017.60
结算备付金	4,270,428.75	-	-	-	4,270,428.75
存出保证金	1,865,472.00	-	-	-	1,865,472.00
交易性金融资产	-	-	-	594,467,956.44	594,467,956.44
应收申购款	-	-	-	906,519.03	906,519.03
资产总计	56,383,918.35	-	-	595,374,475.47	651,758,393.82
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,602,140.49	5,602,140.49
应付管理人报酬	-	-	-	566,795.39	566,795.39
应付托管费	-	-	-	85,019.28	85,019.28
应付销售服务费	-	-	-	134,271.37	134,271.37
其他负债	-	-	-	128,365.72	128,365.72
负债总计	-	-	-	6,516,592.25	6,516,592.25
利率敏感度缺口	56,383,918.35	-	-	588,857,883.22	645,241,801.57
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	137,588,188.36	-	-	-	137,588,188.36
结算备付金	8,988,273.99	-	-	-	8,988,273.99
存出保证金	1,413,120.00	-	-	-	1,413,120.00
交易性金融资产	-	-	-	1,221,467,913.87	1,221,467,913.87
应收申购款	-	-	-	1,787,300.69	1,787,300.69
资产总计	147,989,582.35	-	-	1,223,255,214.56	1,371,244,796.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	65,789,523.93	65,789,523.93
应付管理人报酬	-	-	-	1,180,358.76	1,180,358.76
应付托管费	-	-	-	177,053.81	177,053.81
应付销售服务费	-	-	-	367,427.07	367,427.07
其他负债	-	-	-	160,013.99	160,013.99
负债总计	-	-	-	67,674,377.56	67,674,377.56

利率敏感度缺口	147,989,582.35	-	-	1,155,580,837.00	1,303,570,419.35
---------	----------------	---	---	------------------	------------------

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 06 月 30 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)。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 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	594,467,956.44	92.13	1,221,467,913.87	93.70
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	594,467,956.44	92.13	1,221,467,913.87	93.70

	4		7
--	---	--	---

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 6.4.7.3)。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。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)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 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	32,378,587.62	64,014,470.98
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-32,378,587.62	-64,014,470.98

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	593,318,491.58	1,220,093,214.86
第二层次	227,853.56	898,742.02
第三层次	921,611.30	475,956.99
合计	594,467,956.44	1,221,467,913.87

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.15 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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	594,467,956.44	91.21
	其中：股票	594,467,956.44	91.21
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	54,518,446.35	8.36
8	其他各项资产	2,771,991.03	0.43
9	合计	651,758,393.82	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,845,243.00	0.44
B	采矿业	13,363,330.00	2.07
C	制造业	335,462,655.82	51.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,514,903.10	2.09
E	建筑业	3,482,669.28	0.54
F	批发和零售业	9,880,454.06	1.53
G	交通运输、仓储和邮政业	20,302,668.60	3.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	65,568,295.71	10.16
J	金融业	2,895,039.60	0.45
K	房地产业	3,048,249.32	0.47
L	租赁和商务服务业	2,702,723.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	7,850,321.10	1.22
N	水利、环境和公共设施管理业	2,702,802.00	0.42
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	3,367,916.14	0.52
S	综合	-	-
	合计	486,987,270.73	75.47

7.2.2 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	4,094,280.00	0.63
C	制造业	72,741,854.26	11.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,986,199.00	1.70
E	建筑业	2,157,838.00	0.33
F	批发和零售业	1,029,019.20	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	2,233,110.00	0.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,356,662.56	0.52
J	金融业	2,667,230.70	0.41
K	房地产业	5,118,630.24	0.79

L	租赁和商务服务业	2,780,135.00	0.43
M	科学研究和技术服务业	52,681.95	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	19,872.00	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	-	-
S	综合	243,172.80	0.04
	合计	107,480,685.71	16.66

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 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	占基金资产净值比例 (%)
1	002468	申通快递	679,276	5,705,918.40	0.88
2	688088	虹软科技	190,524	5,498,522.64	0.85
3	002020	京新药业	515,800	5,400,426.00	0.84
4	300735	光弘科技	247,700	5,350,320.00	0.83
5	600602	云赛智联	475,000	5,244,000.00	0.81
6	300229	拓尔思	384,900	5,169,207.00	0.80
7	688586	江航飞机装备	549,143	5,107,029.90	0.79
8	600596	新安股份	663,007	5,038,853.20	0.78
9	002245	蔚蓝锂芯	648,900	5,028,975.00	0.78
10	002292	奥飞娱乐	833,800	4,986,124.00	0.77
11	002237	恒邦股份	423,100	4,869,881.00	0.75
12	600420	国药现代	451,400	4,820,952.00	0.75
13	300034	钢研高纳	296,100	4,705,029.00	0.73
14	603328	依顿电子	596,500	4,688,490.00	0.73
15	000969	安泰科技	555,800	4,407,494.00	0.68
16	003021	兆威机电	95,100	4,388,865.00	0.68
17	600718	东软集团	509,500	4,213,565.00	0.65
18	002378	章源钨业	720,900	4,137,966.00	0.64
19	601311	骆驼股份	506,400	4,061,328.00	0.63
20	002100	天康生物	585,000	4,054,050.00	0.63
21	603013	亚普股份	294,600	3,968,262.00	0.62

22	000913	钱江摩托	250,800	3,952,608.00	0.61
23	300113	顺网科技	384,200	3,934,208.00	0.61
24	000758	中色股份	769,700	3,910,076.00	0.61
25	600428	中远海特	638,100	3,905,172.00	0.61
26	300463	迈克生物	342,100	3,893,098.00	0.60
27	300233	金城医药	255,600	3,813,552.00	0.59
28	300747	锐科激光	214,200	3,802,050.00	0.59
29	002036	联创电子	559,000	3,773,250.00	0.58
30	600006	东风汽车	583,100	3,726,009.00	0.58
31	600480	凌云股份	376,600	3,701,978.00	0.57
32	002906	华阳集团	136,300	3,647,388.00	0.57
33	600335	国机汽车	614,600	3,546,242.00	0.55
34	300634	彩讯股份	205,100	3,451,833.00	0.53
35	301171	易点天下	229,300	3,370,710.00	0.52
36	300725	药石科技	124,500	3,332,865.00	0.52
37	300821	东岳硅材	486,400	3,326,976.00	0.52
38	003039	顺控发展	265,100	3,321,703.00	0.51
39	002446	盛路通信	586,900	3,315,985.00	0.51
40	688380	中微半导	197,964	3,309,958.08	0.51
41	002534	西子洁能	330,293	3,306,232.93	0.51
42	002550	千红制药	609,800	3,286,822.00	0.51
43	300768	迪普科技	269,550	3,194,167.50	0.50
44	002351	漫步者	241,100	3,170,465.00	0.49
45	603229	奥翔药业	314,400	3,159,720.00	0.49
46	688362	甬矽电子	161,428	3,141,388.88	0.49
47	002249	大洋电机	662,900	3,135,517.00	0.49
48	000600	建投能源	495,999	3,124,793.70	0.48
49	001338	永顺泰	316,100	3,097,780.00	0.48
50	300973	立高食品	108,700	3,053,383.00	0.47
51	600559	老白干酒	167,500	3,045,150.00	0.47
52	601069	西部黄金	258,500	3,006,355.00	0.47
53	603212	赛伍技术	269,200	2,971,968.00	0.46
54	300737	科顺股份	688,937	2,962,429.10	0.46
55	301262	海看股份	130,100	2,933,755.00	0.45
56	603169	兰石重装	651,200	2,930,400.00	0.45
57	002946	新乳业	333,400	2,920,584.00	0.45
58	688289	圣湘生物	165,768	2,914,201.44	0.45
59	000735	罗牛山	657,100	2,845,243.00	0.44
60	002023	海特高新	302,900	2,771,535.00	0.43
61	603025	大豪科技	195,400	2,700,428.00	0.42
62	300660	江苏雷利	105,500	2,692,360.00	0.42
63	300482	万孚生物	109,680	2,676,192.00	0.41
64	300620	光库科技	71,200	2,618,736.00	0.41

65	688123	聚辰半导体	42,770	2,601,699.10	0.40
66	688127	蓝特光学	139,883	2,572,448.37	0.40
67	300031	宝通科技	179,000	2,572,230.00	0.40
68	002706	良信股份	373,500	2,562,210.00	0.40
69	601101	昊华能源	274,900	2,526,331.00	0.39
70	001213	中铁特货	631,500	2,494,425.00	0.39
71	603118	共进股份	370,800	2,484,360.00	0.39
72	300602	飞荣达	163,200	2,465,952.00	0.38
73	000517	荣安地产	916,900	2,457,292.00	0.38
74	301316	慧博云通	163,800	2,404,584.00	0.37
75	002635	安洁科技	152,700	2,357,688.00	0.37
76	300741	华宝股份	150,651	2,295,921.24	0.36
77	600409	三友化工	455,200	2,285,104.00	0.35
78	002010	传化智联	594,200	2,281,728.00	0.35
79	300596	利安隆	84,000	2,278,920.00	0.35
80	601001	晋控煤业	136,300	2,251,676.00	0.35
81	301071	力量钻石	79,800	2,211,258.00	0.34
82	000795	英洛华	397,100	2,199,934.00	0.34
83	002139	拓邦股份	203,500	2,161,170.00	0.33
84	002267	陕天然气	284,400	2,150,064.00	0.33
85	300773	拉卡拉	172,200	2,140,446.00	0.33
86	603299	苏盐井神	225,063	2,138,098.50	0.33
87	688128	中国电器研究院	124,233	2,138,049.93	0.33
88	000990	诚志股份	286,400	2,130,816.00	0.33
89	300303	聚飞光电	427,600	2,078,136.00	0.32
90	002777	久远银海	138,600	2,077,614.00	0.32
91	688141	杰华特微电子	127,141	2,054,598.56	0.32
92	688776	国光电气	36,808	2,039,163.20	0.32
93	603055	台华新材	199,900	2,024,987.00	0.31
94	601038	一拖股份	126,600	2,001,546.00	0.31
95	300115	长盈精密	163,900	1,965,161.00	0.30
96	688208	道通科技	81,189	1,959,902.46	0.30
97	002145	中核钛白	594,900	1,951,272.00	0.30
98	300674	宇信科技	173,600	1,923,488.00	0.30
99	688336	三生国健	91,967	1,871,528.45	0.29
100	600562	国睿科技	135,696	1,853,607.36	0.29
101	688209	英集芯科技	148,245	1,839,720.45	0.29
102	601375	中原证券	538,200	1,835,262.00	0.28
103	603693	江苏新能	157,700	1,832,474.00	0.28
104	002539	云图控股	255,800	1,823,854.00	0.28
105	603098	森特股份	230,000	1,807,800.00	0.28
106	002612	朗姿股份	130,200	1,799,364.00	0.28

107	000837	秦川机床	244,050	1,796,208.00	0.28
108	002274	华昌化工	239,400	1,776,348.00	0.28
109	300188	国投智能	156,500	1,738,715.00	0.27
110	688389	深圳普门科技	106,932	1,738,714.32	0.27
111	002773	康弘药业	79,500	1,721,175.00	0.27
112	605507	国邦医药	102,700	1,709,955.00	0.27
113	603896	寿仙谷	72,700	1,706,269.00	0.26
114	002913	奥士康	63,600	1,705,116.00	0.26
115	300624	万兴科技	31,780	1,686,564.60	0.26
116	600929	雪天盐业	317,100	1,680,630.00	0.26
117	002990	盛视科技	81,700	1,644,621.00	0.25
118	300039	上海凯宝	298,500	1,596,975.00	0.25
119	301080	百普赛斯	44,300	1,550,500.00	0.24
120	002646	天佑德酒	151,200	1,546,776.00	0.24
121	600761	安徽合力	71,400	1,545,096.00	0.24
122	688315	诺禾致源科技	140,280	1,531,857.60	0.24
123	002215	诺普信	204,300	1,522,035.00	0.24
124	300045	华力创通	86,100	1,519,665.00	0.24
125	600601	方正科技	495,700	1,487,100.00	0.23
126	301327	华宝新能	25,520	1,462,296.00	0.23
127	002034	旺能环境	112,200	1,459,722.00	0.23
128	688352	硕中科技	127,931	1,459,692.71	0.23
129	601222	林洋能源	230,700	1,446,489.00	0.22
130	600812	华北制药	349,600	1,440,352.00	0.22
131	600577	精达股份	361,000	1,433,170.00	0.22
132	002617	露笑科技	294,400	1,413,120.00	0.22
133	601890	亚星锚链	199,900	1,409,295.00	0.22
134	688007	光峰科技	87,174	1,403,501.40	0.22
135	300182	捷成股份	377,900	1,402,009.00	0.22
136	000065	北方国际	133,700	1,386,469.00	0.21
137	300638	广和通	80,600	1,378,260.00	0.21
138	688183	生益电子	70,380	1,363,964.40	0.21
139	300170	汉得信息	219,400	1,347,116.00	0.21
140	002043	兔宝宝	129,800	1,346,026.00	0.21
141	000555	神州信息	143,800	1,340,216.00	0.21
142	600776	东方通信	132,200	1,299,526.00	0.20
143	002467	二六三	384,710	1,284,931.40	0.20
144	002191	劲嘉股份	349,676	1,262,330.36	0.20
145	600750	江中药业	54,400	1,257,184.00	0.19
146	300035	中科电气	147,000	1,250,970.00	0.19
147	000035	中国天楹	275,800	1,249,374.00	0.19
148	000810	创维数字	145,200	1,245,816.00	0.19
149	002204	大连重工	290,900	1,242,143.00	0.19

150	600269	赣粤高速	239,600	1,238,732.00	0.19
151	301301	川宁生物	96,000	1,226,880.00	0.19
152	688239	贵州航宇科技	34,729	1,208,569.20	0.19
153	600787	中储股份	243,900	1,173,159.00	0.18
154	301175	中科环保	266,000	1,167,740.00	0.18
155	603308	应流股份	93,700	1,163,754.00	0.18
156	600389	江山股份	81,200	1,145,732.00	0.18
157	600125	铁龙物流	187,300	1,118,181.00	0.17
158	600916	中国黄金	114,900	1,105,338.00	0.17
159	600610	中毅达	273,300	1,087,734.00	0.17
160	002925	盈趣科技	85,800	1,087,086.00	0.17
161	002993	奥海科技	29,200	1,086,240.00	0.17
162	000690	宝新能源	212,500	1,083,750.00	0.17
163	300451	创业慧康	307,900	1,065,334.00	0.17
164	301078	孩子王	202,300	1,023,638.00	0.16
165	688403	汇成股份	119,485	1,013,232.80	0.16
166	600459	贵研铂业	73,900	998,389.00	0.15
167	601801	皖新传媒	143,098	991,669.14	0.15
168	603306	华懋科技	54,800	990,236.00	0.15
169	600210	紫江企业	184,400	981,008.00	0.15
170	600623	华谊集团	167,600	968,728.00	0.15
171	000821	京山轻机	85,300	966,449.00	0.15
172	002320	海峡股份	186,600	962,856.00	0.15
173	688531	日联科技股份	20,374	940,463.84	0.15
174	300409	道氏技术	109,100	933,896.00	0.14
175	603489	DR 八方股份	34,400	928,112.00	0.14
176	002782	可立克	83,100	920,748.00	0.14
177	600572	康恩贝	200,400	895,788.00	0.14
178	600717	天津港	208,300	889,441.00	0.14
179	002004	华邦健康	233,900	888,820.00	0.14
180	002537	海联金汇	166,950	863,131.50	0.13
181	688116	天奈科技	37,388	862,915.04	0.13
182	603766	隆鑫通用	126,800	859,704.00	0.13
183	688105	XD 诺唯赞生物	42,239	845,202.39	0.13
184	000828	东莞控股	93,400	841,534.00	0.13
185	600201	生物股份	115,600	833,476.00	0.13
186	600869	远东股份	235,000	820,150.00	0.13
187	600587	新华医疗	50,800	799,592.00	0.12
188	300783	三只松鼠	36,000	787,320.00	0.12
189	603297	永新光学	12,900	780,321.00	0.12
190	600158	中体产业	99,800	767,462.00	0.12
191	002567	唐人神	139,400	747,184.00	0.12

192	600682	南京新百	149,400	745,506.00	0.12
193	603888	新华网	34,373	739,363.23	0.11
194	002099	海翔药业	144,000	735,840.00	0.11
195	300841	康华生物	14,500	734,280.00	0.11
196	000917	电广传媒	142,800	721,140.00	0.11
197	000928	中钢国际	127,800	709,290.00	0.11
198	300232	洲明科技	135,400	706,788.00	0.11
199	002545	东方铁塔	103,500	704,835.00	0.11
200	002315	焦点科技	26,000	700,960.00	0.11
201	300134	大富科技	101,400	691,548.00	0.11
202	688432	有研硅	70,867	686,701.23	0.11
203	601952	苏垦农发	75,900	684,618.00	0.11
204	002416	爱施德	72,400	640,740.00	0.10
205	688498	源杰科技	4,800	628,752.00	0.10
206	601975	招商南油	172,600	619,634.00	0.10
207	300738	奥飞数据	61,100	618,332.00	0.10
208	601126	四方股份	31,600	607,352.00	0.09
209	300573	兴齐眼药	3,700	606,800.00	0.09
210	002097	山河智能	98,400	593,352.00	0.09
211	002851	麦格米特	22,800	589,152.00	0.09
212	000426	兴业银锡	43,300	588,014.00	0.09
213	600556	天下秀	161,200	586,768.00	0.09
214	688800	瑞可达连接系统	20,885	586,450.80	0.09
215	002332	仙琚制药	50,900	580,769.00	0.09
216	603595	东尼电子	27,400	564,166.00	0.09
217	002242	九阳股份	53,800	563,824.00	0.09
218	688383	新益昌科技	10,800	562,788.00	0.09
219	603162	海通发展	60,034	558,316.20	0.09
220	002745	木林森	67,600	544,856.00	0.08
221	002837	英维克	25,450	544,375.50	0.08
222	300772	运达股份	56,020	537,792.00	0.08
223	601969	海南矿业	84,800	537,632.00	0.08
224	603348	文灿股份	19,100	528,879.00	0.08
225	002901	大博医疗	20,300	524,349.00	0.08
226	600971	恒源煤电	43,900	524,166.00	0.08
227	603920	世运电路	26,400	521,136.00	0.08
228	600963	岳阳林纸	140,505	515,653.35	0.08
229	002265	建设工业	59,700	515,211.00	0.08
230	603881	数据港	40,050	509,035.50	0.08
231	600933	爱柯迪	33,400	493,986.00	0.08
232	600064	南京高科	80,876	490,917.32	0.08
233	600645	中源协和	30,100	484,610.00	0.08

234	300206	理邦仪器	54,500	468,155.00	0.07
235	301155	海力风电	11,500	462,645.00	0.07
236	600586	金晶科技	77,882	451,715.60	0.07
237	002312	川发龙蟒	65,700	442,161.00	0.07
238	300348	长亮科技	60,500	412,610.00	0.06
239	600502	安徽建工	95,700	411,510.00	0.06
240	600400	红豆股份	187,000	405,790.00	0.06
241	688279	峰昭科技	3,652	405,006.80	0.06
242	600320	振华重工	118,300	404,586.00	0.06
243	601068	中铝国际	94,900	399,529.00	0.06
244	600835	上海机电	34,700	399,397.00	0.06
245	002727	一心堂	26,100	393,849.00	0.06
246	600993	马应龙	14,400	384,048.00	0.06
247	000030	富奥股份	77,300	379,543.00	0.06
248	300257	开山股份	36,800	371,680.00	0.06
249	600531	豫光金铅	56,700	365,148.00	0.06
250	603678	火炬电子	14,500	358,005.00	0.06
251	603915	国茂股份	32,120	330,514.80	0.05
252	600864	哈投股份	69,000	327,750.00	0.05
253	300672	国科微	6,200	327,608.00	0.05
254	600033	福建高速	93,300	312,555.00	0.05
255	605020	永和股份	16,200	310,716.00	0.05
256	300226	上海钢联	18,100	306,614.00	0.05
257	300887	谱尼测试	39,000	288,600.00	0.04
258	600475	华光环能	32,800	285,688.00	0.04
259	600908	无锡银行	53,700	285,684.00	0.04
260	601369	陕鼓动力	34,800	279,096.00	0.04
261	600223	福瑞达	39,400	278,558.00	0.04
262	301069	凯盛新材	21,200	277,932.00	0.04
263	601333	广深铁路	85,700	277,668.00	0.04
264	000034	神州数码	11,900	272,391.00	0.04
265	600961	株冶集团	28,200	266,208.00	0.04
266	688608	恒玄科技	1,800	263,484.00	0.04
267	300428	立中集团	14,100	262,119.00	0.04
268	600391	航发科技	16,800	256,200.00	0.04
269	600771	广誉远	13,600	256,088.00	0.04
270	603368	柳药集团	14,400	252,000.00	0.04
271	603267	鸿远电子	7,300	248,930.00	0.04
272	000657	中钨高新	26,700	244,038.00	0.04
273	002068	黑猫股份	34,100	242,110.00	0.04
274	002967	广电计量	20,400	240,720.00	0.04
275	603983	丸美股份	8,600	236,758.00	0.04
276	300587	天铁股份	58,100	234,724.00	0.04

277	601137	博威合金	15,000	228,600.00	0.04
278	600252	中恒集团	101,700	220,689.00	0.03
279	002135	东南网架	54,400	215,424.00	0.03
280	688019	安集科技	1,700	213,860.00	0.03
281	600285	羚锐制药	8,800	213,048.00	0.03
282	600509	天富能源	38,600	212,686.00	0.03
283	000019	深粮控股	36,800	211,232.00	0.03
284	605111	新洁能	6,900	211,071.00	0.03
285	301087	可孚医疗	6,200	210,180.00	0.03
286	600312	平高电气	10,800	210,060.00	0.03
287	002349	精华制药	31,400	205,984.00	0.03
288	000429	粤高速 A	19,700	205,077.00	0.03
289	601163	三角轮胎	13,300	202,426.00	0.03
290	002701	奥瑞金	47,200	196,352.00	0.03
291	002182	宝武镁业	17,000	191,760.00	0.03
292	002651	利君股份	34,200	187,758.00	0.03
293	300687	赛意信息	13,400	186,528.00	0.03
294	300755	华致酒行	13,500	184,410.00	0.03
295	603919	金徽酒	9,700	176,249.00	0.03
296	000650	仁和药业	28,400	167,560.00	0.03
297	300432	富临精工	25,550	164,542.00	0.03
298	002075	沙钢股份	43,500	163,995.00	0.03
299	000567	海德股份	28,760	161,343.60	0.03
300	002961	瑞达期货	14,700	160,965.00	0.02
301	300857	协创数据	2,700	153,900.00	0.02
302	605333	沪光股份	5,400	150,390.00	0.02
303	600063	皖维高新	42,700	150,304.00	0.02
304	301219	腾远钴业	3,900	149,214.00	0.02
305	688381	帝奥微电子	7,287	141,950.76	0.02
306	002544	普天科技	7,500	140,175.00	0.02
307	002434	万里扬	28,300	138,670.00	0.02
308	688526	武汉科前生物	9,386	137,880.34	0.02
309	002048	宁波华翔	9,900	128,106.00	0.02
310	000875	吉电股份	22,800	121,524.00	0.02
311	002171	楚江新材	18,200	119,938.00	0.02
312	601949	中国出版	20,000	118,200.00	0.02
313	603936	博敏电子	14,000	117,600.00	0.02
314	000058	深赛格	21,300	114,381.00	0.02
315	601677	明泰铝业	9,800	113,288.00	0.02
316	605589	圣泉集团	5,500	111,595.00	0.02
317	600163	中闽能源	22,900	110,378.00	0.02
318	600449	宁夏建材	8,800	103,400.00	0.02
319	603439	贵州三力	8,000	102,080.00	0.02

320	002125	湘潭电化	10,400	101,192.00	0.02
321	301246	宏源药业	7,500	100,950.00	0.02
322	000528	柳工	8,900	99,591.00	0.02
323	300953	震裕科技	1,800	97,560.00	0.02
324	003040	楚天龙	7,800	95,940.00	0.01
325	300049	福瑞股份	1,900	95,646.00	0.01
326	603039	泛微网络	3,000	95,280.00	0.01
327	002051	中工国际	13,593	94,607.28	0.01
328	600266	城建发展	24,400	91,256.00	0.01
329	600882	妙可蓝多	7,200	89,784.00	0.01
330	603103	横店影视	6,400	88,576.00	0.01
331	688110	东芯股份	4,500	85,815.00	0.01
332	688388	嘉元科技	8,742	85,234.50	0.01
333	688508	芯朋微电子	2,312	84,087.44	0.01
334	300457	赢合科技	4,700	83,801.00	0.01
335	601619	嘉泽新能	26,400	79,992.00	0.01
336	300068	南都电源	9,600	79,488.00	0.01
337	688798	艾为电子	1,400	79,268.00	0.01
338	688048	长光华芯	2,500	78,100.00	0.01
339	600648	外高桥	8,671	76,825.06	0.01
340	300685	艾德生物	4,200	74,088.00	0.01
341	603638	艾迪精密	5,200	72,956.00	0.01
342	601187	厦门银行	12,800	68,224.00	0.01
343	688139	海尔生物	1,794	66,736.80	0.01
344	002456	欧菲光	8,500	66,385.00	0.01
345	688686	奥普特科技	1,000	64,030.00	0.01
346	002276	万马股份	8,500	60,945.00	0.01
347	002061	浙江交科	16,420	59,933.00	0.01
348	688046	药康生物	5,838	59,664.36	0.01
349	000550	江铃汽车	2,700	58,617.00	0.01
350	600305	恒顺醋业	7,800	56,394.00	0.01
351	300476	胜宏科技	1,700	54,842.00	0.01
352	000686	东北证券	9,700	54,126.00	0.01
353	300382	斯莱克	9,100	53,781.00	0.01
354	300260	新莱应材	2,200	46,068.00	0.01
355	600211	西藏药业	1,300	42,354.00	0.01
356	600037	歌华有线	6,300	37,674.00	0.01
357	688066	北京航天宏图	2,100	37,380.00	0.01
358	603567	珍宝岛	3,100	32,643.00	0.01
359	603733	仙鹤股份	1,800	31,644.00	0.00
360	600810	XD 神马股份	4,867	30,175.40	0.00
361	002511	中顺洁柔	4,000	27,680.00	0.00
362	002250	联化科技	5,600	26,880.00	0.00

363	600366	宁波韵升	4,700	24,534.00	0.00
364	688559	海目星激光	650	21,378.50	0.00
365	600775	南京熊猫	2,500	20,000.00	0.00
366	000968	蓝焰控股	3,000	19,080.00	0.00
367	603556	海兴电力	400	18,732.00	0.00
368	000966	长源电力	4,040	17,816.40	0.00
369	002985	北摩高科	500	11,015.00	0.00
370	300140	节能环境	1,800	10,746.00	0.00
371	688408	中信博新能源	113	10,405.04	0.00
372	603612	索通发展	800	10,208.00	0.00
373	600007	中国国贸	400	8,784.00	0.00
374	600295	鄂尔多斯	800	7,936.00	0.00
375	002698	博实股份	300	3,681.00	0.00
376	688232	国泰新点软件	122	2,405.84	0.00
377	300757	罗博特科	20	1,747.00	0.00
378	002948	青岛银行	500	1,685.00	0.00
379	301367	怡和嘉业	20	1,244.00	0.00
380	688091	上海谊众药业	50	1,129.50	0.00
381	300598	诚迈科技	40	1,123.20	0.00
382	688202	美迪西生物医 药	35	911.75	0.00
383	688166	博瑞生物医药	25	875.00	0.00
384	300346	南大光电	30	857.70	0.00
385	688658	悦康药业	17	303.28	0.00
386	002226	江南化工	40	179.20	0.00
387	688062	迈威生物	6	173.64	0.00
388	603730	岱美股份	10	99.40	0.00
389	688575	XD 亚辉龙生 物	1	23.32	0.00

7.3.2 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	占基金资产净值比例 (%)
1	000830	鲁西化工	291,500	3,378,485.00	0.52
2	002241	歌尔股份	153,400	2,992,834.00	0.46
3	003816	中国广核	557,900	2,583,077.00	0.40
4	002422	科伦药业	83,200	2,523,456.00	0.39
5	000930	中粮科技	501,100	2,520,533.00	0.39
6	002519	银河电子	473,900	2,326,849.00	0.36
7	601991	大唐发电	682,300	2,053,723.00	0.32
8	601877	正泰电器	106,600	2,031,796.00	0.31

9	600736	苏州高新	485,389	2,019,218.24	0.31
10	002120	韵达股份	259,900	2,011,626.00	0.31
11	301260	格力博	136,400	1,857,768.00	0.29
12	603823	百合花	187,100	1,809,257.00	0.28
13	600048	保利发展	194,800	1,706,448.00	0.26
14	000568	泸州老窖	11,700	1,678,833.00	0.26
15	000524	岭南控股	207,700	1,674,062.00	0.26
16	601633	长城汽车	65,200	1,649,560.00	0.26
17	600468	百利电气	369,850	1,594,053.50	0.25
18	600027	华电国际	227,800	1,580,932.00	0.25
19	688249	晶合集成	106,700	1,565,289.00	0.24
20	000725	京东方 A	381,400	1,559,926.00	0.24
21	600578	京能电力	468,300	1,517,292.00	0.24
22	000960	锡业股份	97,900	1,516,471.00	0.24
23	002897	意华股份	38,500	1,449,910.00	0.22
24	600062	华润双鹤	68,900	1,349,062.00	0.21
25	002907	华森制药	103,800	1,309,956.00	0.20
26	600362	江西铜业	55,000	1,302,400.00	0.20
27	600789	鲁抗医药	183,700	1,285,900.00	0.20
28	600019	宝钢股份	178,400	1,186,360.00	0.18
29	300047	天源迪科	181,000	1,183,740.00	0.18
30	600096	云天化	60,500	1,174,910.00	0.18
31	601888	中国中免	17,700	1,106,073.00	0.17
32	688378	奥来德光电	45,201	1,060,415.46	0.16
33	002054	德美化工	204,718	1,005,165.38	0.16
34	601668	中国建筑	184,200	978,102.00	0.15
35	002340	格林美	153,500	977,795.00	0.15
36	002757	南兴股份	78,100	941,105.00	0.15
37	601168	西部矿业	50,900	913,655.00	0.14
38	300539	横河精密	110,300	887,915.00	0.14
39	600819	耀皮玻璃	206,800	872,696.00	0.14
40	603790	雅运股份	87,100	836,160.00	0.13
41	002399	海普瑞	95,100	824,517.00	0.13
42	002642	荣联科技	158,400	817,344.00	0.13
43	601186	中国铁建	95,000	814,150.00	0.13
44	002601	龙佰集团	42,800	794,796.00	0.12
45	000630	铜陵有色	217,100	783,731.00	0.12
46	600011	华能国际	80,800	777,296.00	0.12
47	002026	山东威达	86,200	715,460.00	0.11
48	605228	神通科技	82,200	705,276.00	0.11
49	300357	我武生物	34,800	703,656.00	0.11
50	600021	上海电力	68,800	680,432.00	0.11
51	000786	北新建材	22,800	676,248.00	0.10

52	603501	韦尔股份	6,800	675,716.00	0.10
53	002449	国星光电	92,100	655,752.00	0.10
54	300403	汉宇集团	95,700	653,631.00	0.10
55	601898	中煤能源	52,300	652,704.00	0.10
56	300408	三环集团	22,000	642,180.00	0.10
57	600863	内蒙华电	138,400	642,176.00	0.10
58	600183	生益科技	30,400	640,224.00	0.10
59	688313	仕佳光子	66,906	636,945.12	0.10
60	600809	山西汾酒	2,900	611,552.00	0.09
61	600030	中信证券	31,500	574,245.00	0.09
62	002046	国机精工	56,300	572,571.00	0.09
63	300017	网宿科技	67,600	534,040.00	0.08
64	688717	艾罗能源	11,303	531,467.06	0.08
65	605369	拱东医疗	12,900	514,710.00	0.08
66	002284	亚太股份	73,200	494,832.00	0.08
67	600031	三一重工	29,900	493,350.00	0.08
68	002206	海利得	128,600	491,252.00	0.08
69	600367	红星发展	49,300	488,563.00	0.08
70	601600	中国铝业	63,400	483,742.00	0.07
71	002128	电投能源	22,600	476,860.00	0.07
72	603610	麒盛科技	48,200	476,216.00	0.07
73	601229	上海银行	65,100	472,626.00	0.07
74	002106	莱宝高科	43,000	468,700.00	0.07
75	000565	渝三峡 A	112,900	454,987.00	0.07
76	600325	华发股份	69,800	453,700.00	0.07
77	600028	中国石化	71,600	452,512.00	0.07
78	600727	鲁北化工	71,300	449,190.00	0.07
79	688472	阿特斯阳光电 力	42,300	430,614.00	0.07
80	601016	节能风电	143,400	428,766.00	0.07
81	601666	平煤股份	37,800	423,360.00	0.07
82	300381	溢多利	64,900	398,486.00	0.06
83	002577	雷柏科技	32,000	395,840.00	0.06
84	600141	兴发集团	20,300	387,324.00	0.06
85	600015	华夏银行	57,800	369,920.00	0.06
86	601669	中国电建	65,400	365,586.00	0.06
87	600489	中金黄金	24,600	364,080.00	0.06
88	301408	华人健康	33,200	339,636.00	0.05
89	600619	海立股份	65,400	338,118.00	0.05
90	002558	巨人网络	35,700	337,008.00	0.05
91	603203	XD 快克智能	14,200	334,836.00	0.05
92	002587	奥拓电子	59,500	320,110.00	0.05
93	603367	辰欣药业	22,900	319,226.00	0.05

94	600612	老凤祥	5,200	302,588.00	0.05
95	688055	昆山龙腾光电	94,824	300,592.08	0.05
96	000066	中国长城	34,200	299,250.00	0.05
97	000042	中洲控股	75,200	297,040.00	0.05
98	000538	云南白药	5,800	296,670.00	0.05
99	601857	中国石油	28,200	291,024.00	0.05
100	002244	滨江集团	39,300	285,318.00	0.04
101	603517	绝味食品	18,400	283,360.00	0.04
102	000060	中金岭南	66,300	281,112.00	0.04
103	600023	浙能电力	39,300	279,423.00	0.04
104	601318	中国平安	6,300	260,568.00	0.04
105	600617	国新能源	101,920	254,800.00	0.04
106	002406	远东传动	51,300	252,909.00	0.04
107	601319	中国人保	48,900	251,835.00	0.04
108	603883	老百姓	13,670	250,981.20	0.04
109	601336	新华保险	8,200	246,246.00	0.04
110	000833	粤桂股份	51,960	243,172.80	0.04
111	600814	杭州解百	41,200	243,080.00	0.04
112	603399	吉翔股份	38,900	240,791.00	0.04
113	002896	中大力德	8,500	237,150.00	0.04
114	002613	北玻股份	67,600	235,248.00	0.04
115	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.04
116	000926	福星股份	68,500	217,145.00	0.03
117	600406	国电南瑞	8,600	214,656.00	0.03
118	688233	神工半导体	11,138	214,629.26	0.03
119	300630	普利制药	16,700	206,245.00	0.03
120	601231	环旭电子	12,200	195,810.00	0.03
121	603998	方盛制药	19,000	195,130.00	0.03
122	688363	华熙生物	3,351	189,566.07	0.03
123	601225	陕西煤业	7,300	188,121.00	0.03
124	600549	厦门钨业	10,900	188,025.00	0.03
125	688150	莱特光电股份	9,500	184,300.00	0.03
126	688787	海天瑞声	3,319	182,146.72	0.03
127	600760	中航沈飞	4,500	180,450.00	0.03
128	300684	中石科技	10,000	173,400.00	0.03
129	603658	安图生物	3,700	170,459.00	0.03
130	603198	迎驾贡酒	2,900	166,750.00	0.03
131	600018	上港集团	28,800	166,464.00	0.03
132	600497	驰宏锌锗	31,000	165,540.00	0.03
133	300709	精研科技	6,200	156,736.00	0.02
134	002825	纳尔股份	25,000	155,750.00	0.02
135	603296	华勤技术	2,800	154,644.00	0.02
136	688601	力芯微股份	3,528	154,138.32	0.02

137	688138	清溢光电	7,124	153,166.00	0.02
138	600315	上海家化	8,400	149,352.00	0.02
139	000063	中兴通讯	5,300	148,241.00	0.02
140	603041	美思德	14,600	146,000.00	0.02
141	601216	君正集团	39,300	145,017.00	0.02
142	603897	长城科技	8,000	140,400.00	0.02
143	001979	招商蛇口	15,900	139,761.00	0.02
144	300153	科泰电源	23,400	139,230.00	0.02
145	000975	银泰黄金	8,400	136,836.00	0.02
146	300909	汇创达	6,100	136,274.00	0.02
147	000636	风华高科	10,000	130,600.00	0.02
148	605018	长华集团	14,300	129,558.00	0.02
149	002845	同兴达	9,200	121,624.00	0.02
150	601500	通用股份	22,600	120,684.00	0.02
151	000920	沃顿科技	15,600	114,348.00	0.02
152	601116	三江购物	15,000	114,150.00	0.02
153	603317	天味食品	10,000	114,100.00	0.02
154	002294	信立泰	4,200	111,846.00	0.02
155	688182	灿勤科技	8,402	111,242.48	0.02
156	300176	派生科技	25,100	110,691.00	0.02
157	603309	维力医疗	9,900	108,999.00	0.02
158	603633	徕木股份	12,400	98,084.00	0.02
159	603496	恒为科技	4,000	97,800.00	0.02
160	000001	平安银行	9,600	97,440.00	0.02
161	000738	航发控制	4,800	96,336.00	0.01
162	002185	华天科技	11,300	92,095.00	0.01
163	688036	传音控股	1,200	91,848.00	0.01
164	601108	财通证券	13,570	89,697.70	0.01
165	300003	乐普医疗	5,700	84,588.00	0.01
166	002876	三利谱	3,500	84,420.00	0.01
167	600523	贵航股份	7,700	76,230.00	0.01
168	601628	中国人寿	2,400	74,520.00	0.01
169	600765	中航重机	3,500	71,400.00	0.01
170	600642	申能股份	7,800	68,874.00	0.01
171	300758	七彩化学	6,200	66,650.00	0.01
172	601577	长沙银行	8,100	66,258.00	0.01
173	600990	四创电子	3,700	64,935.00	0.01
174	688475	萤石网络	1,900	64,809.00	0.01
175	603939	益丰药房	2,600	63,830.00	0.01
176	002423	中粮资本	8,300	62,167.00	0.01
177	600025	华能水电	5,600	60,368.00	0.01
178	601198	东兴证券	7,500	59,700.00	0.01
179	600098	广州发展	8,700	55,680.00	0.01

180	603056	德邦股份	4,200	55,020.00	0.01
181	003035	南网能源	11,900	52,360.00	0.01
182	603676	卫信康	6,500	52,065.00	0.01
183	002557	洽洽食品	1,700	47,923.00	0.01
184	002779	中坚科技	1,600	45,344.00	0.01
185	688728	格科微有限公司	3,600	43,596.00	0.01
186	600517	国网英大	9,200	39,836.00	0.01
187	601615	明阳智能	4,200	39,648.00	0.01
188	000551	创元科技	4,400	38,412.00	0.01
189	002264	新华都	6,100	31,171.00	0.00
190	601121	宝地矿业	5,200	29,588.00	0.00
191	300288	朗玛信息	2,600	27,482.00	0.00
192	300341	麦克奥迪	2,700	23,166.00	0.00
193	603350	C安乃达	1,051	21,608.56	0.00
194	605218	伟时电子	1,300	20,995.00	0.00
195	600488	津药药业	5,800	19,894.00	0.00
196	002616	长青集团	4,600	19,872.00	0.00
197	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
198	603186	华正新材	800	19,024.00	0.00
199	000501	武商集团	2,600	17,342.00	0.00
200	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
201	688584	上海合晶硅材料	866	13,760.74	0.00
202	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
203	603266	天龙股份	700	11,844.00	0.00
204	603090	宏盛股份	600	10,692.00	0.00
205	688691	灿芯半导体股份	247	10,499.97	0.00
206	600050	中国联通	2,200	10,340.00	0.00
207	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
208	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
209	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
210	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
211	603345	安井食品	100	7,431.00	0.00
212	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
213	603258	电魂网络	400	6,460.00	0.00
214	300351	永贵电器	400	5,920.00	0.00
215	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
216	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
217	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
218	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
219	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00

220	002001	新和成	217	4,166.40	0.00
221	603344	星德胜科技	182	4,124.12	0.00
222	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
223	600979	广安爱众	1,000	3,360.00	0.00
224	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
225	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
226	603375	盛景微电子	72	2,800.80	0.00
227	600351	亚宝药业	400	2,244.00	0.00
228	601881	中国银河	200	2,172.00	0.00
229	688561	奇安信集团	45	1,062.90	0.00
230	688566	吉贝尔药业	40	900.00	0.00
231	688252	天德钰科技	49	711.97	0.00
232	688317	上海之江生物	40	576.40	0.00
233	688772	珠海冠宇电池	25	372.50	0.00
234	688219	会通股份	44	341.88	0.00
235	002741	光华科技	37	332.26	0.00
236	300488	恒锋工具	13	264.55	0.00
237	688247	宣泰医药	32	263.04	0.00
238	688222	成都先导	22	249.70	0.00
239	002923	润都股份	14	129.64	0.00
240	300004	南风股份	21	91.14	0.00
241	688509	正元地信	25	72.25	0.00
242	688189	南新制药	3	16.89	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000550	江铃汽车	18,255,425.0 0	1.40
2	600602	云赛智联	17,896,230.0 0	1.37
3	000555	神州信息	16,758,711.0 0	1.29
4	300735	光弘科技	16,564,929.0 4	1.27
5	600028	中国石化	16,468,291.0 0	1.26
6	600480	凌云股份	15,497,530.0 0	1.19

7	000600	建投能源	15,285,509.04	1.17
8	000810	创维数字	15,228,858.00	1.17
9	001338	永顺泰	15,036,994.00	1.15
10	002292	奥飞娱乐	15,027,722.00	1.15
11	300233	金城医药	14,767,256.00	1.13
12	688128	中国电器研究院	14,406,605.78	1.11
13	603299	苏盐井神	14,405,749.00	1.11
14	601068	中铝国际	14,249,859.00	1.09
15	000969	安泰科技	14,138,866.00	1.08
16	300229	拓尔思	13,896,059.00	1.07
17	003021	兆威机电	13,623,481.29	1.05
18	600776	东方通信	13,468,181.00	1.03
19	002895	川恒股份	13,426,612.00	1.03
20	002697	红旗连锁	13,273,391.28	1.02

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。

7.4.2 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	000550	江铃汽车	24,382,013.00	1.87
2	603583	捷昌驱动	20,988,134.53	1.61
3	300476	胜宏科技	20,876,799.48	1.60
4	688128	中国电器研究院	19,269,337.75	1.48

5	600776	东方通信	19,206,011.0 0	1.47
6	601019	山东出版	18,931,712.8 8	1.45
7	000555	神州信息	18,538,364.7 6	1.42
8	002913	奥士康	18,085,264.0 0	1.39
9	600812	华北制药	18,010,005.3 2	1.38
10	301165	锐捷网络	17,752,235.0 0	1.36
11	300457	赢合科技	17,530,221.0 0	1.34
12	002773	康弘药业	17,283,068.0 0	1.33
13	601068	中铝国际	17,076,248.0 0	1.31
14	002204	大连重工	16,996,346.1 4	1.30
15	002895	川恒股份	16,701,267.0 0	1.28
16	600966	博汇纸业	16,637,845.0 0	1.28
17	600028	中国石化	16,581,447.0 0	1.27
18	601801	皖新传媒	16,473,649.5 8	1.26
19	000928	中钢国际	16,247,683.0 0	1.25
20	601949	中国出版	16,198,319.4 8	1.24

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。

7.4.3 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	4,876,483,140.72
卖出股票收入（成交）总额	5,388,525,194.80

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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货。若本基金投资股指期货，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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可投资国债期货。若本基金投资国债期货，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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,865,472.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	906,519.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,771,991.03

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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	持有份额	占总份额比

				比例		例
国泰君安中证 1000 指数增强 A	11,363	28,818.14	99,413,454.96	30.36%	228,047,103.33	69.64%
国泰君安中证 1000 指数增强 C	7,728	58,461.54	276,825,988.85	61.27%	174,964,802.22	38.73%
合计	19,091	40,817.73	376,239,443.81	48.28%	403,011,905.55	51.72%

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）。

8.2 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 1000 指数增强 A	2,736,184.67	0.8356%
	国泰君安中证 1000 指数增强 C	446,691.71	0.0989%
	合计	3,182,876.38	0.4085%

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）。

8.3 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 1000 指数增强 A	>100
	国泰君安中证 1000 指数增强 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安中证 1000 指数增强 A	>100
	国泰君安中证 1000 指数增强 C	0
	合计	>100

注：同时为基金管理人高级管理人员（含基金投资和部门负责人）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 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安中证 1000 指数增强 A	国泰君安中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2022 年 08 月 16 日）基金份额总额	332,110,120.07	277,282,091.55
本报告期期初基金份额总额	350,853,146.00	1,059,153,694.95
本报告期基金总申购份额	41,735,539.40	323,864,454.83
减：本报告期基金总赎回份额	65,128,127.11	931,227,358.71
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	327,460,558.29	451,790,791.07

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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》。自 2024 年 2 月 26 日起叶明同志代为履行公司首席信息官，朱晓力同志不再担任公司首席信息官职务。

2024 年 3 月 20 日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》。自 2024 年 3 月 18 日起陶耿同志兼任公司财务负责人，叶明同志不再兼任公司财务负责人职务。

2024 年 3 月 20 日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》。自 2024 年 3 月 18 日起吕巍同志兼任公司首席风险官，叶明同志不再兼任公司首席风险官职务。

2、报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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。

10.6.2 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	2	10,263,698,145.54	100.00%	768,482.43	100.00%	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-

10.8 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 1000 指数增强型证券投资基金 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	国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 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 2024 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 1000 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 1000 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	2024-06-28
11	国泰君安中证 1000 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	2024-06-28

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20240628-20240630	156,618,861.29	-	-	156,618,861.29	20.10%
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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复;
- 2、《国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》;
- 3、《国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》;
- 4、《国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》;
- 5、法律意见书;
- 6、管理人业务资格批件、营业执照;
- 7、托管人业务资格批件、营业执照;
- 8、中国证监会要求的其他文件。

12.2 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>。

12.3 查阅方式

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

上海国泰君安证券资产管理有限公司

二〇二四年八月三十日