

国泰君安中证 500 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:上海银行股份有限公司

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。

基金托管人上海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.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15

§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	59

§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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	61
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件.....	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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.....	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安中证 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	1,971,197,750.73 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	1,361,641,186.71 份	609,556,564.02 份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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。</p>
投资策略	<p>本基金为增强型指数产品，在标的指数成份券权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。</p> <p>股票投资策略为本基金的核心策略，主要包括以下几个方面：</p> <p>1) 行业配置</p> <p>本基金在行业配置方面尽量遵循基准指数的行业市值占比，尽量控制投资组合相对于基准指数的行业暴露带来的风险损失。</p> <p>2) 个股选择</p> <p>本基金根据股票库中可选投资标的期望收益率、流动性和市场风险偏好等要素选择风险收益比最具吸引力的个股，并根据投资标的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。</p> <p>A、股票池的建立</p>

	<p>考虑到 Alpha 选股模型的强度理论上正比于投资广度的平方根（选股的范围），本基金在策略选股的覆盖面上尽量保留符合风控和流动性等要求的所有股票。基于这样的理念，模型训练和投资组合管理模型覆盖的股票较广，基本上能覆盖市场上六成以上的股票，但是根据可交易性、个股的历史长度以及风控要求，一般情况下会剔除如下股票：上市时间较短的次新股；在过去一段时间流动性和规模综合排名市场排名相对靠后；被交易所标注 ST、即将退市、业绩有连续亏损风险或者被证监会立案调查或者出具警示函等高风险的股票；根据市场政策变化，主要基于流动性考虑需要额外剔除的股票等。</p> <p>B、选股策略</p> <p>本基金通过具有前瞻性、差异性和时效性的研究，致力于通过智能化的模型和全方位覆盖的股票因子特征来捕捉市场短期失效带来的盈利空间。本基金通过对股票库中可选投资标的公司中短期的期望收益率、股票有效流动性、市场风险偏好等核心要素的综合比较，选择风险收益比最具吸引力的个股，并根据投资标的公司股价的中短期主要驱动因素的变化动态调整投资组合构成。本基金的选股策略以低中高等不同调仓频率的多因子选股策略为主，多因子策略投资的详细过程需要分成因子库的维护、股票池的选择、模型的训练和个股信号预测、投资组合生成、策略库的维护和策略配置等环节。因子库全方位覆盖股票的日频交易数据相关因子、股票定期报告衍生因子、分析师报告衍生因子、事件驱动合成因子、股票高频交易数据相关因子以及互联网和舆情数据因子等。在多因子模型算法层面，以人工智能选股模型为核心，并基于股票市场的高噪音和时序性的特征，构建多维度阿尔法预测模型。在投资组合层面，均严格控制其相对于基准指数在市场主要风险因子的风险暴露程度，通过配套的风险模型和组合优化模型得到不同调仓频率的投资组合，并在基金中进行相对均衡的配置。</p> <p>本基金的投资策略还包括：债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略和可转换债券、可交换债券的投资策略。</p>
业绩比较基准	<p>中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%</p>
风险收益特征	<p>本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。</p>

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
	联系电话	021-38676022
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com
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	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路 168 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 27 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 500 指数增 强 A	国泰君安中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	-29,034,365.76	-23,683,605.72
本期利润	-69,747,328.49	-26,395,131.21
加权平均基金份额本期利润	-0.0506	-0.0294
本期加权平均净值利润率	-5.91%	-3.48%
本期基金份额净值增长率	-5.00%	-5.19%

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	-227,879,133.71	-107,168,051.78
期末可供分配基金份额利润	-0.1674	-0.1758
期末基金资产净值	1,133,762,053.00	502,388,512.24
期末基金份额净值	0.8326	0.8242
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	-16.74%	-17.58%

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

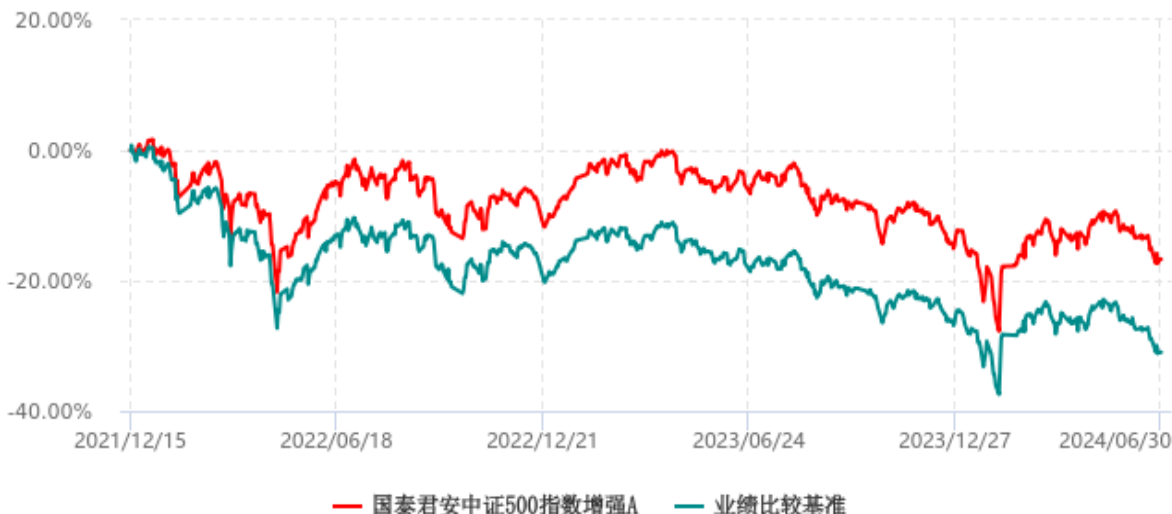
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-5.35%	0.97%	-6.55%	0.91%	1.20%	0.06%
过去三个月	-3.32%	1.10%	-6.16%	1.09%	2.84%	0.01%
过去六个月	-5.00%	1.53%	-8.46%	1.53%	3.46%	0.00%
过去一年	-13.04%	1.21%	-16.71%	1.21%	3.67%	0.00%
自基金合同生效起至今	-16.74%	1.17%	-30.99%	1.17%	14.25%	0.00%

国泰君安中证 500 指数增强 C 净值表现

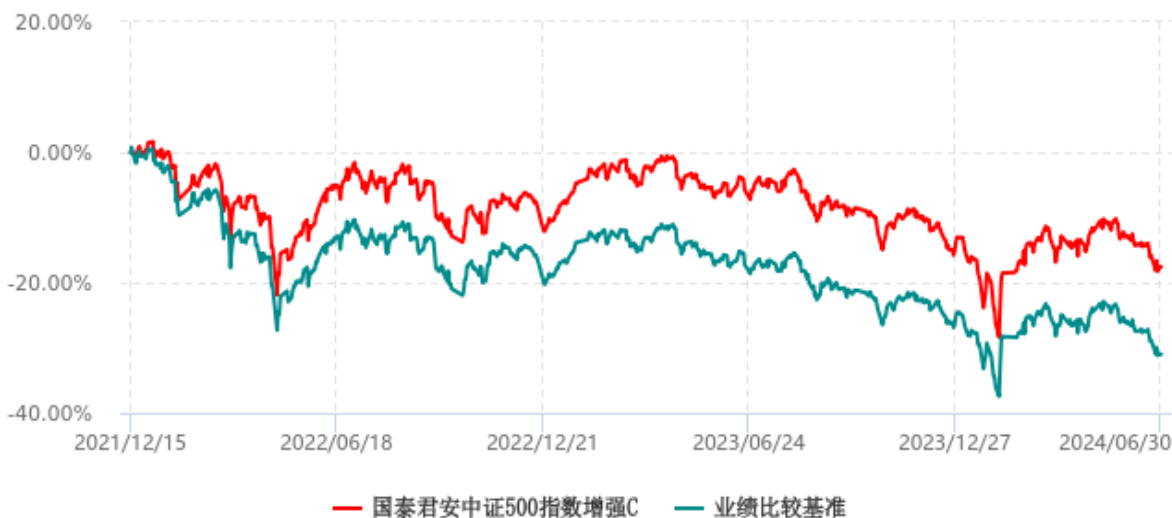
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-5.37%	0.97%	-6.55%	0.91%	1.18%	0.06%
过去三个月	-3.41%	1.09%	-6.16%	1.09%	2.75%	0.00%
过去六个月	-5.19%	1.53%	-8.46%	1.53%	3.27%	0.00%
过去一年	-13.38%	1.22%	-16.71%	1.21%	3.33%	0.01%
自基金合同生效起至今	-17.58%	1.17%	-30.99%	1.17%	13.41%	0.00%

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06月30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	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。

	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。				
邓雅琨	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。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 500 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 20 倍和 21 倍左右，依然处于历史较为低估的水平，在历史上的分位数为 11% 左右，而用 PB 估值的话，则历史分位数更低，在市场主要宽基指数当中是历史相对估值最低的指数之一，在历史上的分位数为 5% 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 历史分位数也仍处极端低位，从业绩的可持续角度来看，估值进一步向下的空间要显著小于向上的空间。未来随着经济的逐步企稳向好，作为市场中优质中盘股的代表，中证 500 指数有望迎来估值和盈利的双击。我们认为做为一个价值股和成长股、周期股和非周期股、新兴行业和传统行业均相对均衡的中盘宽基指数，中证 500 指数依然是当前市场环境下进可攻、退可守的选择。

随着我国积极的财政政策适度加力，高水平对外开放政策不断延续，以及消费需求仍处于充分释放阶段，未来市场具备回升条件，我们预计，未来市场板块轮动速度仍然较快。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，力求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 500 指数增强 A 基金份额净值为 0.8326 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.00%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%；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 0.8242 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.19%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

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

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 托管人对本中期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 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 500 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	108,768,711.96	288,213,888.11
结算备付金		11,977,591.88	19,607,250.57
存出保证金		4,009,708.80	1,435,315.20
交易性金融资产	6.4.7.2	1,512,194,325.16	2,132,056,415.86
其中：股票投资		1,512,194,325.16	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	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		2,237,437.15	1,780,876.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,639,187,774.95	2,443,093,746.66
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		1,049,054.91	173,072,051.18
应付管理人报酬		1,399,743.38	1,964,989.84
应付托管费		209,961.50	294,748.47
应付销售服务费		173,330.64	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	6.4.7.6	205,119.28	171,205.92
负债合计		3,037,209.71	175,863,932.24
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,971,197,750.73	2,595,692,397.40
未分配利润	6.4.7.8	-335,047,185.49	-328,462,582.98
净资产合计		1,636,150,565.24	2,267,229,814.42
负债和净资产总计		1,639,187,774.95	2,443,093,746.66

注 报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,971,197,750.73 份。其中国泰君安中证 500 指数增强 A 基金份额净值 0.8326 元，基金份额总额 1,361,641,186.71 份；国泰君安中证 500 指数增强 C 基金份额净值 0.8242 元，基金份额总额 609,556,564.02 份。

6.2 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 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	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023
----	-----	-------------------------------------	--------------------------------

		日	年 06 月 30 日
一、营业总收入		-83,418,051.92	89,160,093.04
1. 利息收入		487,351.31	368,891.67
其中：存款利息收入	6.4.7.9	487,351.31	368,891.67
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）		-40,955,782.49	78,697,035.69
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-60,540,181.55	62,637,871.64
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	6.4.7.11	1,267,573.97	965,089.34
股利收益	6.4.7.12	18,316,825.09	15,094,074.71
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	-43,424,488.22	9,202,417.74
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	474,867.48	891,747.94
减：二、营业总支出		12,724,407.78	9,660,787.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,659,113.25	7,360,068.50
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,448,867.02	1,104,010.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,518,746.44	1,107,475.15
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	4,855.84
8. 其他费用	6.4.7.15	84,641.36	84,377.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-96,142,459.70	79,499,305.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-96,142,459.70	79,499,305.68
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-96,142,459.70	79,499,305.68

6.3 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 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	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）	-624,494,646.67	-6,584,602.51	-631,079,249.18
（一）、综合收益总额	-	-96,142,459.70	-96,142,459.70
（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）	-624,494,646.67	89,557,857.19	-534,936,789.48
其中：1. 基金申购款	556,197,910.07	-84,611,247.71	471,586,662.36
2. 基金赎回款	-	174,169,104.90	-
	1,180,692,556.74		1,006,523,451.84
（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	1,971,197,750.73	-335,047,185.49	1,636,150,565.24

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	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）	327,252,301.73	64,694,037.52	391,946,339.25
（一）、综合收益总额	-	79,499,305.68	79,499,305.68
（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）	327,252,301.73	-14,805,268.16	312,447,033.57
其中：1. 基金申购款	980,919,980.83	-36,352,558.30	944,567,422.53
2. 基金赎回款	-653,667,679.10	21,547,290.14	-632,120,388.96
（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	1,719,506,577.08	-76,888,040.48	1,642,618,536.60

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 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 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 \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 500 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	47,757,180.18
等于：本金	47,747,878.54
加：应计利息	9,301.64
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	61,011,531.78
等于：本金	61,008,165.24
加：应计利息	3,366.54
减：坏账准备	-
合计	108,768,711.96

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	1,593,226,673.79	-	1,512,194,325.16	-81,032,348.63
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,593,226,673.79	-	1,512,194,325.16	-81,032,348.63

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	34,932,105.48	0.00	-	-
股指期货	34,932,105.48	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	34,932,105.48	-	-	-

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
IC2407	IC2407	31	30,489,120.00	-1,227,288.66
IC2409	IC2409	3	2,925,120.00	-290,576.82
合计				-1,517,865.48
减：可抵销期货暂收款				-1,517,865.48
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	507.54
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	179,672.34
预提审计费	24,863.02
其他应付	76.38
合计	205,119.28

6.4.7.7 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 06 月 30 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	182,950,406.13	182,950,406.13
本期赎回（以“-”号填列）	-334,424,327.71	-334,424,327.71
本期末	1,361,641,186.71	1,361,641,186.71

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 06 月 30 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	373,247,503.94	373,247,503.94
本期赎回（以“-”号填列）	-846,268,229.03	-846,268,229.03
本期末	609,556,564.02	609,556,564.02

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 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	-29,034,365.76	-40,712,962.73	-69,747,328.49
本期基金份额交易产生的变动数	17,886,840.19	10,931,405.11	28,818,245.30
其中：基金申购款	-21,319,051.98	-4,082,577.82	-25,401,629.80
基金赎回款	39,205,892.17	15,013,982.93	54,219,875.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-154,304,734.05	-73,574,399.66	- 227,879,133.71

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	-23,683,605.72	-2,711,525.49	-26,395,131.21
本期基金份额交易产生的变动数	59,528,154.36	1,211,457.53	60,739,611.89
其中：基金申购款	-49,934,860.30	-9,274,757.61	-59,209,617.91
基金赎回款	109,463,014.66	10,486,215.14	119,949,229.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-74,466,484.53	-32,701,567.25	- 107,168,051.78

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	249,329.76
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	65,613.53
结算备付金利息收入	172,408.02
其他	-
合计	487,351.31

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	10,275,668,822.82
减：卖出股票成本总额	10,328,336,730.17
减：交易费用	7,872,274.20
买卖股票差价收入	-60,540,181.55

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	1,424,551.36
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	108,664.28
减：交易费用	48,313.11
合计	1,267,573.97

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	18,316,825.09
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	18,316,825.09

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	-41,820,576.86
——股票投资	-41,820,576.86
——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	-1,603,911.36
——权证投资	-
————期货投资	-1,603,911.36
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	-43,424,488.22

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	474,867.48
合计	474,867.48

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	106.00
合计	84,641.36

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
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。

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	20,024,653,849.17	100.00%	38,829,083,621.74	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	1,450,111.35	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	2,768,255.86	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	9,659,113.25	7,360,068.50
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,475,495.24	2,171,617.23
应支付基金管理人的净管理费	6,183,618.01	5,188,451.27

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：

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

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	1,448,867.02	1,104,010.31

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：

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

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	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

名称	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
国泰君安证券	-	445,515.95	445,515.95
国泰君安资管	-	762,512.64	762,512.64
上海银行	-	811.23	811.23
合计	-	1,208,839.82	1,208,839.82
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 500 指数增强 A	国泰君安中证 500 指数增强 C	合计
国泰君安证券	-	580,897.02	580,897.02
国泰君安资管	-	243,685.23	243,685.23
上海银行	-	592.24	592.24
合计	-	825,174.49	825,174.49

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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

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自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 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（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	9,999,450.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	0.00	9,999,450.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.90%

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。

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
上海银行	47,757,180.18	249,329.76	52,851,627.92	169,702.06
国泰君安证券	61,011,531.78	65,613.53	46,614,212.36	108,061.29

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人上海银行保管，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

本基金本报告期末进行利润分配。

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	受限期	流通	认购价格	期末估值	数量(单)	期末成本总额	期末估值总额	备注

		日		受限类型		单价	位： 股)			
688717	艾罗能源	2023年12月26日	1-6个月(含)	网下新股限售	55.66	47.02	11,303	629,124.98	531,467.06	-
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	5个交易日	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	星辰科技	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	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-

				售						
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	-
301502	华阳智能	2024年01月26日	1-6个月(含)	网下新股限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
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	1-6个月	网下	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-

		月 11 日	(含)	新股限售						
603375	盛景微	2024 年 01 月 17 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-

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。

6.4.12.2 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。

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 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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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	108,768,711.96	-	-	-	108,768,711.96
结算备付金	11,977,591.88	-	-	-	11,977,591.88

存出保证金	4,009,708.80	-	-	-	4,009,708.80
交易性金融资产	-	-	-	1,512,194,325.16	1,512,194,325.16
应收申购款	-	-	-	2,237,437.15	2,237,437.15
资产总计	124,756,012.64	-	-	1,514,431,762.31	1,639,187,774.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,049,054.91	1,049,054.91
应付管理人报酬	-	-	-	1,399,743.38	1,399,743.38
应付托管费	-	-	-	209,961.50	209,961.50
应付销售服务费	-	-	-	173,330.64	173,330.64
其他负债	-	-	-	205,119.28	205,119.28
负债总计	-	-	-	3,037,209.71	3,037,209.71
利率敏感度缺口	124,756,012.64	-	-	1,511,394,552.60	1,636,150,565.24
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	309,256,453.8	-	-	1,957,973,360.5	2,267,229,814.4

缺口	8		4	2
----	---	--	---	---

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币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	1,512,194,325.16	92.42	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	1,512,194,325.16	92.42	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 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%	81,000,653.50	111,458,169.05
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-81,000,653.50	-111,458,169.05

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	1,511,251,105.30	2,130,673,151.99
第二层次	21,608.56	898,742.02
第三层次	921,611.30	484,521.85
合计	1,512,194,325.16	2,132,056,415.86

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	1,512,194,325.16	92.25
	其中：股票	1,512,194,325.16	92.25
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	120,746,303.84	7.37
8	其他各项资产	6,247,145.95	0.38
9	合计	1,639,187,774.95	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	5,826,365.00	0.36
B	采矿业	83,354,160.60	5.09
C	制造业	782,974,192.20	47.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	84,478,060.16	5.16
E	建筑业	8,841,148.00	0.54
F	批发和零售业	23,959,590.36	1.46
G	交通运输、仓储和邮政业	25,509,312.10	1.56
H	住宿和餐饮业	2,789,136.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	64,069,378.33	3.92
J	金融业	111,220,500.39	6.80
K	房地产业	8,446,612.48	0.52
L	租赁和商务服务业	3,609,984.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	7,423,152.90	0.45
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	4,425,207.00	0.27
R	文化、体育和娱乐业	2,614,944.40	0.16
S	综合	2,040,896.00	0.12
	合计	1,221,582,639.9	74.66
		2	

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	3,465,244.00	0.21
C	制造业	215,026,109.18	13.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,754,517.00	0.41
E	建筑业	4,919,637.00	0.30
F	批发和零售业	3,937,911.14	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	13,916,554.00	0.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,095,206.41	1.78
J	金融业	1,298,035.75	0.08
K	房地产业	3,667,797.00	0.22

L	租赁和商务服务业	8,436,405.00	0.52
M	科学研究和技术服务业	50,863.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	43,405.76	0.00
	合计	290,611,685.24	17.76

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	002340	格林美	3,464,600	22,069,502.00	1.35
2	600096	云天化	1,092,400	21,214,408.00	1.30
3	300017	网宿科技	2,339,300	18,480,470.00	1.13
4	000630	铜陵有色	5,076,750	18,327,067.50	1.12
5	000830	鲁西化工	1,580,800	18,321,472.00	1.12
6	002120	韵达股份	2,291,400	17,735,436.00	1.08
7	000066	中国长城	1,986,200	17,379,250.00	1.06
8	600141	兴发集团	903,700	17,242,596.00	1.05
9	300136	信维通信	869,700	17,028,726.00	1.04
10	601991	大唐发电	5,426,200	16,332,862.00	1.00
11	600497	驰宏锌锗	3,047,400	16,273,116.00	0.99

				0	
12	002558	巨人网络	1,715,500	16,194,320.00	0.99
13	601168	西部矿业	884,400	15,874,980.00	0.97
14	601231	环旭电子	973,600	15,626,280.00	0.96
15	600578	京能电力	4,581,700	14,844,708.00	0.91
16	000960	锡业股份	954,200	14,780,558.00	0.90
17	600062	华润双鹤	750,300	14,690,874.00	0.90
18	000060	中金岭南	3,178,577	13,477,166.48	0.82
19	603317	天味食品	1,172,024	13,372,793.84	0.82
20	600863	内蒙华电	2,877,900	13,353,456.00	0.82
21	601577	长沙银行	1,629,600	13,330,128.00	0.81
22	601666	平煤股份	1,189,500	13,322,400.00	0.81
23	300502	新易盛	122,200	12,898,210.00	0.79
24	601108	财通证券	1,873,470	12,383,636.70	0.76
25	002128	电投能源	581,786	12,275,684.60	0.75
26	000636	风华高科	907,500	11,851,950.00	0.72
27	603517	绝味食品	764,600	11,774,840.00	0.72
28	601198	东兴证券	1,466,900	11,676,524.00	0.71
29	000738	航发控制	568,100	11,401,767.00	0.70
30	600699	均胜电子	759,100	11,249,862.00	0.69
31	600517	国网英大	2,584,400	11,190,452.00	0.68
32	002185	华天科技	1,349,400	10,997,610.00	0.67

33	002563	森马服饰	1,882,600	10,937,906.00	0.67
34	000728	国元证券	1,773,200	10,745,592.00	0.66
35	300357	我武生物	526,700	10,649,874.00	0.65
36	600985	淮北矿业	621,100	10,397,214.00	0.64
37	300724	捷佳伟创	192,100	10,375,321.00	0.63
38	002423	中粮资本	1,357,500	10,167,675.00	0.62
39	600315	上海家化	563,475	10,018,585.50	0.61
40	000050	深天马 A	1,373,200	9,996,896.00	0.61
41	603883	老百姓	543,780	9,983,800.80	0.61
42	300207	欣旺达	637,000	9,663,290.00	0.59
43	600038	中直股份	233,800	9,611,518.00	0.59
44	600380	健康元	838,700	9,368,279.00	0.57
45	300383	光环新网	1,108,000	9,362,600.00	0.57
46	601216	君正集团	2,528,900	9,331,641.00	0.57
47	601615	明阳智能	974,000	9,194,560.00	0.56
48	600566	济川药业	286,700	9,091,257.00	0.56
49	002294	信立泰	339,600	9,043,548.00	0.55
50	600879	航天电子	1,157,100	8,990,667.00	0.55
51	002008	大族激光	430,100	8,946,080.00	0.55
52	002078	太阳纸业	631,800	8,813,610.00	0.54
53	600021	上海电力	886,500	8,767,485.00	0.54
54	000987	越秀资本	1,731,981	8,590,625.76	0.53
55	601399	国机重装	3,288,620	8,484,639.60	0.52
56	301029	怡合达	415,900	8,176,594.00	0.50
57	688819	天能股份	334,268	7,975,634.48	0.49
58	000683	远兴能源	1,153,500	7,970,685.00	0.49
59	601717	郑煤机	535,100	7,919,480.00	0.48
60	000739	普洛药业	582,842	7,909,165.94	0.48
61	603345	安井食品	106,200	7,891,722.00	0.48
62	002500	山西证券	1,645,100	7,731,970.00	0.47
63	600862	中航高科	410,500	7,709,190.00	0.47
64	002202	金风科技	1,079,100	7,251,552.00	0.44
65	300595	欧普康视	451,243	7,075,490.24	0.43
66	600098	广州发展	1,091,241	6,983,942.40	0.43
67	300009	安科生物	813,754	6,949,459.16	0.42
68	600348	华阳股份	697,700	6,949,092.00	0.42

69	002056	横店东磁	547,200	6,823,584.00	0.42
70	601016	节能风电	2,268,700	6,783,413.00	0.41
71	300003	乐普医疗	443,200	6,577,088.00	0.40
72	300088	长信科技	1,395,000	6,556,500.00	0.40
73	000958	电投产融	1,777,100	6,504,186.00	0.40
74	600549	厦门钨业	367,300	6,335,925.00	0.39
75	603939	益丰药房	256,400	6,294,620.00	0.38
76	600582	天地科技	903,600	6,225,804.00	0.38
77	002966	苏州银行	811,300	6,084,750.00	0.37
78	603160	汇顶科技	87,900	6,043,125.00	0.37
79	600339	中油工程	1,930,100	6,021,912.00	0.37
80	300390	天华新能	339,500	5,832,610.00	0.36
81	000921	海信家电	175,500	5,658,120.00	0.35
82	688029	南微医学	90,881	5,594,634.36	0.34
83	000513	丽珠集团	150,217	5,589,574.57	0.34
84	688099	晶晨股份	93,489	5,545,767.48	0.34
85	600642	申能股份	624,672	5,515,853.76	0.34
86	688475	萤石网络	159,154	5,428,742.94	0.33
87	603658	安图生物	117,700	5,422,439.00	0.33
88	000559	万向钱潮	1,154,742	5,150,149.32	0.31
89	002152	广电运通	481,423	5,035,684.58	0.31
90	688032	禾迈股份	43,517	4,994,881.26	0.31
91	601636	旗滨集团	756,300	4,878,135.00	0.30
92	600765	中航重机	235,700	4,808,280.00	0.29
93	000878	云南铜业	379,600	4,729,816.00	0.29
94	300002	神州泰岳	550,600	4,470,872.00	0.27
95	603486	科沃斯	94,600	4,463,228.00	0.27
96	002472	双环传动	201,100	4,428,222.00	0.27
97	600737	中粮糖业	452,800	4,342,352.00	0.27
98	002557	洽洽食品	150,863	4,252,827.97	0.26
99	600282	南钢股份	832,800	4,147,344.00	0.25
100	688002	睿创微纳	146,495	4,097,465.15	0.25
101	603056	德邦股份	312,111	4,088,654.10	0.25
102	600535	天士力	316,900	3,986,602.00	0.24
103	600418	江淮汽车	251,600	3,985,344.00	0.24
104	003035	南网能源	905,581	3,984,556.40	0.24
105	601997	贵阳银行	747,759	3,940,689.93	0.24
106	000703	恒逸石化	552,300	3,915,807.00	0.24
107	600707	彩虹股份	549,400	3,741,414.00	0.23
108	002797	第一创业	734,000	3,736,060.00	0.23
109	002465	海格通信	359,400	3,723,384.00	0.23
110	300438	鹏辉能源	202,900	3,721,186.00	0.23
111	603786	科博达	57,100	3,662,965.00	0.22

112	601958	金钼股份	349,700	3,640,377.00	0.22
113	002429	兆驰股份	755,500	3,633,955.00	0.22
114	300058	蓝色光标	663,600	3,609,984.00	0.22
115	688516	奥特维	84,783	3,544,777.23	0.22
116	600325	华发股份	541,400	3,519,100.00	0.22
117	002414	高德红外	588,524	3,466,406.36	0.21
118	002019	亿帆医药	279,900	3,459,564.00	0.21
119	601965	中国汽研	203,500	3,437,115.00	0.21
120	300296	利亚德	753,100	3,388,950.00	0.21
121	600612	老凤祥	58,100	3,380,839.00	0.21
122	600763	通策医疗	61,900	3,345,695.00	0.20
123	002244	滨江集团	450,200	3,268,452.00	0.20
124	300776	帝尔激光	68,600	3,152,856.00	0.19
125	688778	厦钨新能	99,392	3,105,006.08	0.19
126	603298	杭叉集团	158,040	3,103,905.60	0.19
127	002064	华峰化学	424,100	3,040,797.00	0.19
128	601118	海南橡胶	667,000	3,034,850.00	0.19
129	688276	百克生物	106,305	3,015,872.85	0.18
130	002203	海亮股份	377,639	3,013,559.22	0.18
131	603529	爱玛科技	109,210	2,984,709.30	0.18
132	600959	江苏有线	1,092,690	2,884,701.60	0.18
133	000032	深桑达 A	188,200	2,819,236.00	0.17
134	601966	玲珑轮胎	153,300	2,816,121.00	0.17
135	600598	北大荒	223,500	2,791,515.00	0.17
136	688107	安路科技	108,641	2,761,654.22	0.17
137	600095	湘财股份	462,500	2,756,500.00	0.17
138	603233	大参林	186,720	2,670,096.00	0.16
139	601990	南京证券	339,400	2,606,592.00	0.16
140	600399	抚顺特钢	449,500	2,530,685.00	0.15
141	600580	卧龙电驱	206,500	2,508,975.00	0.15
142	002372	伟星新材	160,000	2,467,200.00	0.15
143	002984	森麒麟	101,200	2,437,908.00	0.15
144	000818	航锦科技	110,200	2,433,216.00	0.15
145	002945	华林证券	242,400	2,419,152.00	0.15
146	600329	达仁堂	74,000	2,396,860.00	0.15
147	002385	大北农	605,700	2,331,945.00	0.14
148	300373	扬杰科技	59,600	2,318,440.00	0.14
149	300558	贝达药业	71,100	2,314,305.00	0.14
150	000997	新大陆	162,400	2,258,984.00	0.14
151	601866	中远海发	873,200	2,252,856.00	0.14
152	300529	健帆生物	82,700	2,250,267.00	0.14
153	603305	旭升集团	211,362	2,231,982.72	0.14
154	002487	大金重工	97,200	2,223,936.00	0.14

155	688281	华秦科技	26,038	2,169,486.16	0.13
156	600499	科达制造	256,100	2,158,923.00	0.13
157	600299	安迪苏	221,900	2,152,430.00	0.13
158	600704	物产中大	473,200	2,053,688.00	0.13
159	600673	东阳光	289,900	2,040,896.00	0.12
160	688779	长远锂科	437,238	2,024,411.94	0.12
161	600764	中国海防	101,200	1,986,556.00	0.12
162	002532	天山铝业	241,000	1,954,510.00	0.12
163	600546	山煤国际	128,200	1,874,284.00	0.11
164	688772	珠海冠宇	125,504	1,870,009.60	0.11
165	300803	指南针	51,100	1,860,551.00	0.11
166	002608	江苏国信	235,400	1,824,350.00	0.11
167	600827	百联股份	243,762	1,798,963.56	0.11
168	000932	华菱钢铁	400,100	1,772,443.00	0.11
169	000887	中鼎股份	141,672	1,734,065.28	0.11
170	600516	方大炭素	393,600	1,696,416.00	0.10
171	688153	唯捷创芯	45,068	1,667,516.00	0.10
172	600663	陆家嘴	188,100	1,659,042.00	0.10
173	002531	天顺风能	185,500	1,658,370.00	0.10
174	002384	东山精密	77,600	1,606,320.00	0.10
175	300212	易华录	95,000	1,598,850.00	0.10
176	600583	海油工程	265,500	1,569,105.00	0.10
177	600500	中化国际	446,400	1,557,936.00	0.10
178	600754	锦江酒店	67,200	1,544,256.00	0.09
179	600967	内蒙一机	203,200	1,463,040.00	0.09
180	603712	七一二	79,800	1,451,562.00	0.09
181	002223	鱼跃医疗	38,500	1,447,600.00	0.09
182	603228	景旺电子	44,000	1,399,200.00	0.09
183	000783	长江证券	277,000	1,337,910.00	0.08
184	601098	中南传媒	105,620	1,311,800.40	0.08
185	603456	九洲药业	95,600	1,311,632.00	0.08
186	001286	陕西能源	113,100	1,304,043.00	0.08
187	601928	凤凰传媒	118,900	1,303,144.00	0.08
188	688213	思特威	26,700	1,294,950.00	0.08
189	600258	首旅酒店	100,800	1,244,880.00	0.08
190	002625	光启技术	68,800	1,193,680.00	0.07
191	600968	海油发展	285,900	1,177,908.00	0.07
192	002867	周大生	88,700	1,158,422.00	0.07
193	601608	中信重工	295,800	1,126,998.00	0.07
194	301267	华夏眼科	52,100	1,079,512.00	0.07
195	600004	白云机场	111,700	1,058,916.00	0.06
196	600885	宏发股份	33,400	924,512.00	0.06
197	688017	绿的谐波	11,200	919,520.00	0.06

198	002273	水晶光电	53,766	912,946.68	0.06
199	600032	浙江新能	114,300	832,104.00	0.05
200	600839	四川长虹	179,800	807,302.00	0.05
201	000027	深圳能源	109,300	797,890.00	0.05
202	600398	海澜之家	85,351	788,643.24	0.05
203	603893	瑞芯微	12,900	763,293.00	0.05
204	600521	华海药业	44,600	760,430.00	0.05
205	300699	光威复材	30,400	754,832.00	0.05
206	688777	中控技术	18,100	682,370.00	0.04
207	002436	兴森科技	65,600	676,992.00	0.04
208	002624	完美世界	88,500	672,600.00	0.04
209	002958	青农商行	246,900	661,692.00	0.04
210	688169	石头科技	1,638	643,078.80	0.04
211	000598	兴蓉环境	84,200	633,184.00	0.04
212	002518	科士达	35,100	621,270.00	0.04
213	002368	太极股份	27,500	620,125.00	0.04
214	300866	安克创新	8,700	619,527.00	0.04
215	603379	三美股份	15,100	591,014.00	0.04
216	003022	联泓新科	40,150	550,456.50	0.03
217	603728	鸣志电器	11,900	478,737.00	0.03
218	603606	东方电缆	8,400	410,004.00	0.03
219	002025	航天电器	8,100	375,678.00	0.02
220	001872	招商港口	19,400	373,450.00	0.02
221	600126	杭钢股份	88,197	362,489.67	0.02
222	000988	华工科技	10,700	320,251.00	0.02
223	600066	宇通客车	10,700	276,060.00	0.02
224	600528	中铁工业	36,200	264,984.00	0.02
225	002572	索菲亚	12,400	190,092.00	0.01
226	688065	凯赛生物	4,126	187,279.14	0.01
227	600316	洪都航空	10,260	170,623.80	0.01
228	601058	赛轮轮胎	11,400	159,600.00	0.01
229	002595	豪迈科技	3,200	122,144.00	0.01
230	000959	首钢股份	38,300	104,176.00	0.01
231	600498	烽火通信	4,700	74,730.00	0.00
232	002444	巨星科技	2,000	49,400.00	0.00
233	002138	顺络电子	1,600	43,936.00	0.00
234	000933	神火股份	1,600	32,368.00	0.00
235	603589	口子窖	800	31,352.00	0.00
236	300394	天孚通信	300	26,526.00	0.00
237	600143	金发科技	3,600	23,796.00	0.00
238	688348	昱能科技	129	7,611.00	0.00
239	600079	人福医药	200	3,434.00	0.00
240	688188	柏楚电子	15	2,768.25	0.00

241	300474	景嘉微	34	2,149.82	0.00
242	688248	南网科技	50	1,481.50	0.00
243	600483	福能股份	50	583.00	0.00
244	000400	许继电气	10	344.10	0.00
245	600895	张江高科	1	18.48	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	002241	歌尔股份	644,900	12,581,999.00	0.77
2	601877	正泰电器	588,600	11,218,716.00	0.69
3	688088	虹软科技	376,587	10,868,300.82	0.66
4	688586	江航装备	986,463	9,174,105.90	0.56
5	601633	长城汽车	332,400	8,409,720.00	0.51
6	000930	中粮科技	1,550,884	7,800,946.52	0.48
7	002292	奥飞娱乐	1,282,300	7,668,154.00	0.47
8	001213	中铁特货	1,882,400	7,435,480.00	0.45
9	601888	中国中免	104,900	6,555,201.00	0.40
10	002468	申通快递	754,200	6,335,280.00	0.39
11	301260	格力博	431,200	5,872,944.00	0.36
12	002519	银河电子	1,186,500	5,825,715.00	0.36
13	000568	泸州老窖	37,300	5,352,177.00	0.33
14	003816	中国广核	1,061,300	4,913,819.00	0.30
15	600019	宝钢股份	660,900	4,394,985.00	0.27
16	000725	京东方 A	1,000,400	4,091,636.00	0.25
17	002537	海联金汇	752,150	3,888,615.50	0.24
18	002897	意华股份	101,100	3,807,426.00	0.23
19	688249	晶合集成	253,829	3,723,671.43	0.23
20	002422	科伦药业	115,823	3,512,911.59	0.21
21	002907	华森制药	270,300	3,411,186.00	0.21
22	688380	中微半导	200,385	3,350,437.20	0.20
23	301301	川宁生物	260,900	3,334,302.00	0.20
24	605099	共创草坪	167,300	3,163,643.00	0.19
25	002106	莱宝高科	287,200	3,130,480.00	0.19
26	300229	拓尔思	232,600	3,123,818.00	0.19
27	002046	国机精工	297,500	3,025,575.00	0.18
28	002601	龙佰集团	156,900	2,913,633.00	0.18
29	300408	三环集团	98,500	2,875,215.00	0.18

30	000538	云南白药	53,900	2,756,985.00	0.17
31	600468	百利电气	638,700	2,752,797.00	0.17
32	600006	东风股份	411,600	2,630,124.00	0.16
33	688363	华熙生物	45,977	2,600,918.89	0.16
34	300047	天源迪科	390,900	2,556,486.00	0.16
35	603823	百合花	258,652	2,501,164.84	0.15
36	600682	南京新百	487,900	2,434,621.00	0.15
37	600789	鲁抗医药	346,300	2,424,100.00	0.15
38	601311	骆驼股份	299,300	2,400,386.00	0.15
39	688138	清溢光电	111,535	2,398,002.50	0.15
40	688208	道通科技	98,552	2,379,045.28	0.15
41	601001	晋控煤业	128,100	2,116,212.00	0.13
42	600736	苏州高新	505,800	2,104,128.00	0.13
43	600362	江西铜业	87,537	2,072,876.16	0.13
44	688313	仕佳光子	216,932	2,065,192.64	0.13
45	300735	光弘科技	94,100	2,032,560.00	0.12
46	601669	中国电建	345,100	1,929,109.00	0.12
47	600335	国机汽车	332,900	1,920,833.00	0.12
48	000524	岭南控股	233,400	1,881,204.00	0.11
49	688055	龙腾光电	591,456	1,874,915.52	0.11
50	000913	钱江摩托	116,900	1,842,344.00	0.11
51	688472	阿特斯	178,960	1,821,812.80	0.11
52	603055	台华新材	170,000	1,722,100.00	0.11
53	300403	汉宇集团	251,700	1,719,111.00	0.11
54	600183	生益科技	81,445	1,715,231.70	0.10
55	000034	神州数码	74,400	1,703,016.00	0.10
56	301262	海看股份	75,400	1,700,270.00	0.10
57	002990	盛视科技	82,500	1,660,725.00	0.10
58	605369	拱东医疗	41,300	1,647,870.00	0.10
59	601668	中国建筑	309,800	1,645,038.00	0.10
60	688150	莱特光电	84,183	1,633,150.20	0.10
61	300660	江苏雷利	62,100	1,584,792.00	0.10
62	600048	保利发展	178,200	1,561,032.00	0.10
63	600602	云赛智联	137,500	1,518,000.00	0.09
64	600619	海立股份	273,600	1,414,512.00	0.09
65	003021	兆威机电	29,740	1,372,501.00	0.08
66	300233	金城医药	91,800	1,369,656.00	0.08
67	002642	荣联科技	262,800	1,356,048.00	0.08
68	601186	中国铁建	157,000	1,345,490.00	0.08
69	603025	大豪科技	90,400	1,249,328.00	0.08
70	600819	耀皮玻璃	294,500	1,242,790.00	0.08
71	000786	北新建材	41,900	1,242,754.00	0.08
72	600308	华泰股份	391,082	1,227,997.48	0.08

73	688128	中国电研	70,029	1,205,199.09	0.07
74	601857	中国石油	115,700	1,194,024.00	0.07
75	688036	传音控股	15,400	1,178,716.00	0.07
76	603296	华勤技术	21,200	1,170,876.00	0.07
77	300034	钢研高纳	72,400	1,150,436.00	0.07
78	601038	一拖股份	71,300	1,127,253.00	0.07
79	601500	通用股份	206,300	1,101,642.00	0.07
80	688378	奥来德	46,408	1,088,731.68	0.07
81	603501	韦尔股份	10,900	1,083,133.00	0.07
82	002876	三利谱	44,200	1,066,104.00	0.07
83	600027	华电国际	151,200	1,049,328.00	0.06
84	300821	东岳硅材	149,900	1,025,316.00	0.06
85	000063	中兴通讯	36,600	1,023,702.00	0.06
86	300442	润泽科技	42,600	1,020,270.00	0.06
87	300634	彩讯股份	59,800	1,006,434.00	0.06
88	300624	万兴科技	18,900	1,003,023.00	0.06
89	300768	迪普科技	81,200	962,220.00	0.06
90	603195	公牛集团	12,445	959,758.40	0.06
91	603203	快克智能	40,100	945,558.00	0.06
92	600963	岳阳林纸	257,100	943,557.00	0.06
93	002825	纳尔股份	149,114	928,980.22	0.06
94	002054	德美化工	176,900	868,579.00	0.05
95	605228	神通科技	100,000	858,000.00	0.05
96	600809	山西汾酒	4,000	843,520.00	0.05
97	600933	爱柯迪	56,500	835,635.00	0.05
98	002399	海普瑞	94,300	817,581.00	0.05
99	002536	飞龙股份	82,700	787,304.00	0.05
100	002378	章源钨业	133,900	768,586.00	0.05
101	600718	东软集团	91,400	755,878.00	0.05
102	688146	中船特气	23,777	709,743.45	0.04
103	688601	力芯微	15,788	689,777.72	0.04
104	002550	千红制药	127,800	688,842.00	0.04
105	601600	中国铝业	82,300	627,949.00	0.04
106	002757	南兴股份	51,600	621,780.00	0.04
107	603367	辰欣药业	43,300	603,602.00	0.04
108	002035	华帝股份	96,300	599,949.00	0.04
109	300684	中石科技	34,400	596,496.00	0.04
110	603496	恒为科技	24,000	586,800.00	0.04
111	600406	国电南瑞	23,300	581,568.00	0.04
112	688717	艾罗能源	11,303	531,467.06	0.03
113	002979	雷赛智能	27,900	507,780.00	0.03
114	601319	中国人保	96,900	499,035.00	0.03
115	600030	中信证券	23,800	433,874.00	0.03

116	002539	云图控股	58,400	416,392.00	0.03
117	002543	万和电气	40,800	406,368.00	0.02
118	600023	浙能电力	55,800	396,738.00	0.02
119	002267	陕天然气	52,200	394,632.00	0.02
120	002970	锐明技术	10,800	389,124.00	0.02
121	603229	奥翔药业	38,700	388,935.00	0.02
122	002284	亚太股份	56,000	378,560.00	0.02
123	002242	九阳股份	33,600	352,128.00	0.02
124	688728	格科微	28,402	343,948.22	0.02
125	600015	华夏银行	53,200	340,480.00	0.02
126	603321	梅轮电梯	49,000	334,670.00	0.02
127	688127	蓝特光学	17,859	328,427.01	0.02
128	601698	中国卫通	23,200	326,888.00	0.02
129	601968	宝钢包装	67,100	314,028.00	0.02
130	002303	美盈森	129,700	312,577.00	0.02
131	603013	亚普股份	21,400	288,258.00	0.02
132	000969	安泰科技	36,200	287,066.00	0.02
133	002032	苏泊尔	5,700	285,570.00	0.02
134	300351	永贵电器	17,900	264,920.00	0.02
135	600694	大商股份	15,500	260,555.00	0.02
136	002612	朗姿股份	18,700	258,434.00	0.02
137	002534	西子洁能	24,800	248,248.00	0.02
138	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.01
139	002191	劲嘉股份	54,600	197,106.00	0.01
140	002001	新和成	9,700	186,240.00	0.01
141	600433	冠豪高新	68,200	180,730.00	0.01
142	002351	漫步者	13,300	174,895.00	0.01
143	600210	紫江企业	31,900	169,708.00	0.01
144	002066	瑞泰科技	20,235	160,868.25	0.01
145	300303	聚飞光电	31,600	153,576.00	0.01
146	600690	海尔智家	5,300	150,414.00	0.01
147	600269	赣粤高速	28,200	145,794.00	0.01
148	002446	盛路通信	25,300	142,945.00	0.01
149	000333	美的集团	2,100	135,450.00	0.01
150	601898	中煤能源	10,800	134,784.00	0.01
151	300674	宇信科技	12,100	134,068.00	0.01
152	002264	新华都	22,700	115,997.00	0.01
153	002779	中坚科技	3,600	102,024.00	0.01
154	002026	山东威达	11,400	94,620.00	0.01
155	600223	福瑞达	12,800	90,496.00	0.01
156	002206	海利得	19,300	73,726.00	0.00
157	300725	药石科技	1,900	50,863.00	0.00
158	000501	武商集团	7,300	48,691.00	0.00

159	600805	悦达投资	10,744	43,405.76	0.00
160	002957	科瑞技术	3,100	42,036.00	0.00
161	002790	瑞尔特	4,000	36,120.00	0.00
162	002245	蔚蓝锂芯	4,300	33,325.00	0.00
163	300737	科顺股份	6,800	29,240.00	0.00
164	688389	普门科技	1,699	27,625.74	0.00
165	000001	平安银行	2,400	24,360.00	0.00
166	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
167	600028	中国石化	3,200	20,224.00	0.00
168	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
169	600295	鄂尔多斯	1,600	15,872.00	0.00
170	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
171	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
172	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
173	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
174	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
175	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
176	002020	京新药业	800	8,376.00	0.00
177	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
178	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
179	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
180	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
181	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
182	688657	浩辰软件	147	5,433.12	0.00
183	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
184	600031	三一重工	300	4,950.00	0.00
185	600814	杭州解百	800	4,720.00	0.00
186	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
187	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
188	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
189	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
190	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
191	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
192	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
193	001979	招商蛇口	300	2,637.00	0.00
194	688513	苑东生物	36	1,810.44	0.00
195	688550	瑞联新材	36	834.84	0.00
196	688531	日联科技	18	830.88	0.00
197	688566	吉贝尔	29	652.50	0.00
198	688800	瑞可达	17	477.36	0.00
199	688183	生益电子	24	465.12	0.00
200	688093	世华科技	22	399.74	0.00
201	601963	重庆银行	37	286.75	0.00

202	300409	道氏技术	23	196.88	0.00
203	002405	四维图新	25	155.50	0.00
204	603355	莱克电气	6	129.60	0.00
205	301078	孩子王	19	96.14	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	002422	科伦药业	57,134,676.69	2.52
2	601168	西部矿业	55,904,437.00	2.47
3	601118	海南橡胶	53,450,959.74	2.36
4	002185	华天科技	46,123,125.05	2.03
5	600482	中国动力	45,694,167.00	2.02
6	603650	彤程新材	45,253,132.44	2.00
7	688099	晶晨股份	43,092,952.11	1.90
8	300502	新易盛	42,399,388.03	1.87
9	000630	铜陵有色	41,880,418.00	1.85
10	600879	航天电子	41,769,639.00	1.84
11	002156	通富微电	41,748,532.00	1.84
12	601991	大唐发电	41,493,244.00	1.83
13	601666	平煤股份	41,373,770.14	1.82
14	600096	云天化	41,284,635.00	1.82
15	300394	天孚通信	41,267,488.46	1.82
16	600038	中直股份	41,124,433.00	1.81

17	000039	中集集团	39,643,009.4 0	1.75
18	601857	中国石油	39,162,790.0 0	1.73
19	300724	捷佳伟创	39,157,087.0 0	1.73
20	600985	淮北矿业	38,788,190.1 0	1.71

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	603228	景旺电子	59,024,265.2 8	2.60
2	002422	科伦药业	57,066,823.5 8	2.52
3	002423	中粮资本	55,006,580.0 9	2.43
4	601118	海南橡胶	51,760,417.6 6	2.28
5	600096	云天化	50,744,989.0 0	2.24
6	603650	彤程新材	50,132,263.1 9	2.21
7	000039	中集集团	49,335,628.4 0	2.18
8	600482	中国动力	48,512,890.0 0	2.14
9	600582	天地科技	47,991,953.8 2	2.12
10	688099	晶晨股份	46,957,955.3 4	2.07
11	601000	唐山港	46,922,039.6 2	2.07
12	002532	天山铝业	45,275,361.0 0	2.00
13	600498	烽火通信	45,150,832.5 4	1.99
14	601168	西部矿业	44,018,140.4 7	1.94

15	300724	捷佳伟创	43,500,535.0 0	1.92
16	002156	通富微电	43,441,772.0 0	1.92
17	600390	五矿资本	42,681,067.7 0	1.88
18	300394	天孚通信	42,451,480.7 6	1.87
19	600062	华润双鹤	42,281,946.0 0	1.86
20	300558	贝达药业	42,224,882.3 2	1.86

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	9,750,295,216.33
卖出股票收入（成交）总额	10,275,668,822.82

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。

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。

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	4,009,708.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	2,237,437.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,247,145.95

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	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国泰君安中证 500 指数增强 A	522,020	2,608.41	246,609,625.74	18.11%	1,115,031,560.97	81.89%
国泰君安中证 500 指数增强 C	11,966	50,940.71	302,852,730.04	49.68%	306,703,833.98	50.32%
合计	533,986	3,691.48	549,462,355.78	27.87%	1,421,735,394.95	72.13%

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 500 指数增强 A	2,867,799.89	0.2106%
	国泰君安中证 500 指数增强 C	1,621,441.83	0.2660%
	合计	4,489,241.72	0.2277%

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 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 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	182,950,406.13	373,247,503.94
减：本报告期基金总赎回份额	334,424,327.71	846,268,229.03
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-

本报告期末基金份额总额	1,361,641,186.71	609,556,564.02
-------------	------------------	----------------

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、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。

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

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。

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	20,024,653,849.17	100.00%	1,450,111.35	100.00%	-

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 500 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 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

§ 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

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。

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、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。

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