

# 国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 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

送出日期:2022 年 08 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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约定，于2022年8月19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2022年1月1日起至2022年6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	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	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
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合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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	16
§6 中期财务会计报告(未经审计)	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产(基金净值)变动表	20
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	53
7.1 期末基金资产组合情况	53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	56
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	79
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	79
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	79
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	79
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	79
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	79
7.12 投资组合报告附注	79
§8 基金份额持有人信息	80
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	80
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	81

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.....	81
§9 开放式基金份额变动.....	82
§10 重大事件揭示.....	82
10.1 基金份额持有人大会决议.....	82
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.....	82
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	83
10.4 基金投资策略的改变.....	83
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	83
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.....	83
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	83
10.8 其他重大事件.....	84
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	84
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.....	85
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	85
§12 备查文件目录.....	85
12.1 备查文件目录.....	85
12.2 存放地点.....	85
12.3 查阅方式.....	85

## § 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	1,341,451,216.32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	878,840,183.55份	462,611,032.77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</p>

暴露带来的风险损失。

## 2) 个股选择

本基金根据股票库中可选投资标的期望收益率、流动性和市场风险偏好等要素选择风险收益比最具吸引力的个股，并根据投资标的公司股价主要驱动因素的变化动态调整投资组合，而在投资组合管理层面需要充分考虑其相对于中证500指数的风险偏离度。

### A、股票池的建立

考虑到Alpha选股模型的强度理论上正比于投资广度的平方根（选股的范围），本基金在策略选股的覆盖面上尽量保留符合风控和流动性等要求的所有股票。基于这样的理念，模型训练和投资组合管理模型覆盖的股票较广，基本上能覆盖市场上六成以上的股票，但是根据可交易性、个股的历史长度以及风控要求，一般情况下会剔除如下股票：上市时间较短的次新股；在过去一段时间流动性和规模综合排名市场排名相对靠后；被交易所标注ST、即将退市、业绩有连续亏损风险或者被证监会立案调查或者出具警示函等高风险的股票；根据市场政策变化，主要基于流动性考虑需要额外剔除的股票等。

### B、选股策略

本基金通过具有前瞻性、差异性和时效性的研究，致力于通过智能化的模型和全方位覆盖的股票因子特征来捕捉市场短期失效带来的盈利空间。本基金通过对股票库中可选投资标的公司中短期的期望收益率、股票有效流动性、市场风险偏好等核心要素的综合比较，选择风险收益比最具吸引力的个股，并根据投资标的公司股价的中短期主要驱动因素的变化动态调整投资组合构成。本基金的选股策略以低中高等不同调仓频率的多因子选股策略为主，多因子策略投资的详细过程需要分成因子库的维护、股票池的选择、模型的训练和个股信号预测、投资组合生成、策略库的维护和策略配置等几个环节。因子库全方位覆盖股票的日频交易数据相关因子、股票定期报告衍生因子、分析师报告衍生因子、事件驱动合成因子、股票高频交

	<p>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	中证500指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上海国泰君安证券资产管理有限公司	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍
	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	021-68476936
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	谢乐斌	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 (2022年01月01日-2022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	-36,158,453.33	-24,085,715.11
本期利润	-29,188,009.56	-20,931,787.87
加权平均基金份额本期利润	-0.0396	-0.0473
本期加权平均净值利润率	-4.27%	-5.10%
本期基金份额净值增长率	-4.44%	-4.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	-42,247,289.34	-23,183,980.94
期末可供分配基金份额利润	-0.0481	-0.0501
期末基金资产净值	852,283,570.47	447,662,850.31
期末基金份额净值	0.9698	0.9677

3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
	基金份额累计净值增长率	-3.02%

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

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	7.09%	1.07%	6.74%	1.05%	0.35%	0.02%
过去三个月	4.58%	1.68%	1.99%	1.66%	2.59%	0.02%
过去六个月	-4.44%	1.55%	-11.65%	1.55%	7.21%	0.00%
自基金合同生效起至今	-3.02%	1.48%	-11.24%	1.49%	8.22%	-0.01%

国泰君安中证500指数增强C

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	7.06%	1.07%	6.74%	1.05%	0.32%	0.02%
过去三个月	4.48%	1.68%	1.99%	1.66%	2.49%	0.02%
过去六个月	-4.63%	1.55%	-11.65%	1.55%	7.02%	0.00%
自基金合同生效起至今	-3.23%	1.48%	-11.24%	1.49%	8.01%	-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



注：1、本基金于 2021 年 12 月 15 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。  
2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。



注：1、本基金于 2021 年 12 月 15 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。  
2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

## § 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2022年6月30日，本基金管理人共管理了17只公开募集证券投资基金：国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安现金管家货币市场基金、国泰君安君得盛债券型证券投资基金、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1年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰君安创新医药混合型发起式证券投资基金、国泰君安信息行业混合型发起式证券投资基金、国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金(FOF)、国泰君安君得盈债券型证券投资基金、国泰君安君得诚混合型证券投资基金、国泰君安君得明混合型证券投资基金、国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、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60天滚动持有中短债债券型证券投资基

金、国泰君安君得利短债债券型证券投资基金、国泰君安君添利中短债债券型发起式证券投资基金。

#### 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	本基金基金经理，现任上海国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部（公募）部门总经理。	2021-12-15	-	11年	胡崇海先生，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士，11年证券从业经验，具备基金从业资格。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（公募）部门总经理。自2021年12月15日起担任“国泰君安中证500指数增强型证券投资基金”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。

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

## **4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明**

本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规、相关规定以及基金合同、招募说明书约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法违规行为及违反基金合同、招募说明书约定的行为，无侵害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，本基金与本管理人管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况。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。

## **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**

A股上半年走势波动较大，4月之前从外部因素的角度来看主要有以下几个方面：美联储加息，美债收益率跳升冲击风险资产；俄乌冲突导致多个不同市场剧烈波动，催化大宗商品价格上行；局部新冠疫情，市场避险情绪迅速升温；中概股政策风险影响国际资金对A股的配置。4月底开始，随着疫情防控形势总体向好，复工复产稳步推进，稳增长政策落地逐见成效，A股迎来了一波深V反弹，经济运行积极向好。

从市场风格的角度来看，二季度从市场见底以来，风格从价值转向成长，中大市值公司表现良好。并且行业间分化较大，消费者服务、汽车和食品饮料涨幅居前；房地产、计算机和银行等行业表现较差。从Alpha大类因子的表现来看，市场在年报、一季报和二季度业绩预告等密集基本面增量信息的引导下，估值因子一二季度均有强势表现，而成长、盈利质量和分析师情绪因子在反弹行情中不断走强，相对于一季度有显著改善。大类基本面因子在二季度没有短板的均衡水平带动了基本面量化选股模型的上乘表现。另一方面，从4月底开始高频量价因子得益于市场活跃度提升也开始复苏，到6月中旬的年内表现几乎和基本面量化模型不相上下，而两者策略表现的相关性较低，体现出较好的互补特征。

在量化增强层面，我们尽量结合以财务数据为基础的基本面信号和以高频量价为主的技术面信号，通过机器学习模型来进行有效因子的选择和因子之间的轮动，并通过投资组合管理模型严格控制投资组合在主要市场风险和行业上相对于基准指数的暴露程度。今年以来由于估值等大类因子较为显著的改善，使得基本面量化等低频策略相对于高频量价等高换手策略并无劣势，本基金在两者上进行了均衡配置，力求以较为稳定的方式对中证500指数进行增强。考虑到中证500指数在行业配置上较为均衡，公司之间业务的差异度较大，以及个股波动性和流动性适中等特点，在市场轮动较快、投资热点较为分散的市场环境中量化模型的发挥较为稳定。

本基金今年来保持高仓位稳定运作，在市场风格和行业走势出现较大的变化下，依然维持一贯的投资组合管理体系。今年来的超额收益几乎完全来自于模型的选股能力，即纯正Alpha部分，在主要市场风险因子和行业上的暴露导致的整体额外收益几乎为零，这主要基于基金管理人在投资组合端相对于基准指数进行了较严格的风险敞口控制。投资经理在投资组合的配置和交易方面严格遵循量化模型的建议，从挖掘有投资逻辑的Alpha因子、随着市场演变不断改进底层量化模型以及模型的日常跟踪和分析等层面不断增强策略的表现。

#### 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0.9698元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.44%，同期业绩比较基准收益率为-11.65%；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0.9677元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.63%，同期业绩比较基准收益率为-11.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从中长期的角度来看，在当前时间点我们依然坚定地看好中证500指数未来的走势，主要有以下几个理由：1). 从历史相对估值（加权PE）的角度来看，中证500指数依然是几个主要宽基指数中最低估的指数之一，历史上只有约7%的时间比当前的估值更低，也

为后续估值和盈利的双击创造了较好的基本面条件；2). 中证500成分股涵盖了二线蓝筹或细分行业的龙头公司，优质的基本面对机构具有较好的配置价值，相对于大盘股也具有更大的市值空间；3). 中证500指数在周期和非周期、价值和成长、新兴行业和传统行业等方面的分布均较为平衡，在各种不同市场环境进可攻退可守；4). 六月中旬的成分股调整进一步优化了指数的成长性和行业分布。

今年以来基准指数虽然波动较大，但随着经济的发展从中长期来看是震荡向上的，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持乐观态度。随着7月份中证1000中小盘股股指期货的上市，进一步引导机构资金中长线布局中下盘股，大大增强了中小盘股的配置价值。另一方面，以新能源、半导体和国防军工为代表的新兴产业更符合中国未来经济发展的方向，在政策和业绩的共振下依然是机构资金配置的重点，这几个行业在中证500指数当中的占比均不低。展望2021年下半年，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，价值和成长依然会有阶段性的表现，中小盘股阶段性依然优于大盘股。我们希望通过选择基本面和技术面共振的股票来博取较为稳定的超额收益，在中证500指数的基础上不断提升业绩表现，坚持长期主义，为客户获取优异稳定的超额回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会对公司依法管理的资管产品的估值政策、估值方法和估值模型进行研究、决策、评估，确定资管产品估值业务的操作流程和风险控制，确保资管产品估值的公允、合理，切实维护持有人利益。估值委员会由营运管理部分管领导、协管领导（若有）、投资部门负责人、投资研究院负责人、营运管理部负责人、法务监察部负责人、风险管理部负责人及市场部门负责人组成。具体参会的投资部门负责人依据待决议事项对应的资管产品确定。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同的约定进行收益分配。

#### 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，本基金未实施利润分配。

### 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 中期财务会计报告(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：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	86,227,464.57	71,844,463.20
结算备付金		12,943,814.57	10,000,000.00
存出保证金		5,217,368.80	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,193,492,513.35	1,097,949,326.76
其中：股票投资		1,193,492,513.35	1,097,949,326.76
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	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		9,882,300.94	54,318.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	18,751.70
资产总计		1,307,763,462.23	1,179,866,859.99
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		6,497,521.47	-
应付管理人报酬		921,848.26	509,326.78
应付托管费		138,277.23	76,399.00
应付销售服务费		135,577.26	77,251.30
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	123,817.23	3,337.78
负债合计		7,817,041.45	666,314.86
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	1,341,451,216.32	1,161,946,276.66
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-41,504,795.54	17,254,268.47
净资产合计		1,299,946,420.78	1,179,200,545.13
负债和净资产总计		1,307,763,462.23	1,179,866,859.99

注：1、报告截止日2022年6月30日，基金份额总额1,341,451,216.32份，其中A类基金份额净值0.9698元，A类基金份额878,840,183.55份；C类基金份额净值0.9677元，C类基金份额462,611,032.77份。

2、比较数据已根据本年《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〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 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：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2022年0 6月30日
一、营业总收入		-43,002,479.50
1. 利息收入		226,299.47
其中：存款利息收入	6.4.7.9	226,299.47
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）		-53,778,364.39
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-60,734,121.81
基金投资收益	6.4.7.11	-
债券投资收益	6.4.7.12	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-951,823.53
股利收益	6.4.7.16	7,907,580.95
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	10,124,371.01
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	425,214.41
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>7,117,317.93</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,425,741.46
2. 托管费	6.4.10.2.2	813,861.18
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	814,456.67
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		-
8. 其他费用	6.4.7.19	63,258.62
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-50,119,797.43</b>
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-50,119,797.43
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-50,119,797.43

注：本基金合同于2021年12月15日生效，无上年度可比区间数据。

### 6.3 净资产（基金净值）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：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,161,946,27 6.66	-	17,254,268.4 7	1,179,200,54 5.13
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,161,946,27 6.66	-	17,254,268.4 7	1,179,200,54 5.13
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	179,504,939. 66	-	-58,759,064. 01	120,745,875. 65
（一）、综合收益总额	-	-	-50,119,797. 43	-50,119,797. 43
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	179,504,939. 66	-	-8,639,266.5 8	170,865,673. 08
其中：1. 基金申购款	445,855,881. 43	-	-33,108,680. 59	412,747,200. 84

2. 基金赎回款	-266,350,941.77	-	24,469,414.01	-241,881,527.76
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,341,451,216.32	-	-41,504,795.54	1,299,946,420.78

注：本基金合同于2021年12月15日生效，无上年度可比区间数据。

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：

谢乐斌

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 2021 年 10 月 27 日证监许可【2021】3391 号文注册募集，基金合同于2021年12月15日生效，首次设立募集规模为1,160,704,146.74份基金份额。本基金为契约开放式基金，存续期限不定。本基金的管理人和注册登记机构为上海国泰君安证券资产管理有限公司，托管人为上海银行股份有限公司。

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×95%+同期银行活期存款利率（税后）×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》、各项具体会计准则及相关规定(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本报告期末的财务状况以及本报告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

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间自2022年1月1日起至2022年6月30日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产

#### 债务工具

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

#### 以摊余成本计量：

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

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的、股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增

值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、A类基金份额和C类基金份额之间由于A类基金份额不收取而C类基金份额收取销售服务费将导致在可供分配利润上有所不同；本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 外币交易

无。

#### 6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限

公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》及《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外,中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

#### (a) 金融工具

于2022年1月1日,本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、应收利息和应收申购款,金额分别为71,844,463.20元、10,000,000.00元、18,751.70元和54,318.33元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、其他资产-应收利息和应收申购款,金额分别为71,858,009.40元、10,005,205.50元、0.00元和54,318.33元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为1,097,949,326.76元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为1,097,949,326.76元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款,金额分别为509,326.78元、76,399.00元、77,251.30元和3,337.78元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费和其他负债-其他应付款,金额分别为509,326.78元、76,399.00元、77,251.30元和3,337.78元。

#### (b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于2022年颁布的修订后的《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>》,本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露,这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

### 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

本基金本报告期无会计差错。

#### 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利, H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请, 由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册, H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利, 由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票, 按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	48,414,073.44
等于: 本金	48,406,884.75
加: 应计利息	7,188.69
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	37,813,391.13
等于: 本金	37,809,269.81

加：应计利息	4,121.32
减：坏账准备	-
合计	86,227,464.57

注：其他存款为存放于券商保证金账户的资金余额。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,169,503,379.80	-	1,193,492,513.35	23,989,133.55
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	1,169,503,379.80	-	1,193,492,513.35	23,989,133.55

#### 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 2022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	37,211,491.34	-	-	-
--股指期货	37,211,491.34	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	37,211,491.34	-	-	-

#### 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
IC2207	IC2207	22.00	28,312,240.00	56,828.66
IC2208	IC2208	7.00	8,954,680.00	-1,400.00
合计				55,428.66
减：可抵销 期货暂收 款				55,428.66
净额				-

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

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

##### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无余额。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,462.18
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	66,148.40
其他应付	53,206.65
合计	123,817.23

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 国泰君安中证500指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (国泰君安中证500指数增强 A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	721,060,040.05	721,060,040.05
本期申购	275,389,475.92	275,389,475.92
本期赎回(以“-”号填列)	-117,609,332.42	-117,609,332.42
本期末	878,840,183.55	878,840,183.55

##### 6.4.7.7.2 国泰君安中证500指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (国泰君安中证500指数增强 C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	440,886,236.61	440,886,236.61
本期申购	170,466,405.51	170,466,405.51

本期赎回（以“-”号填列）	-148,741,609.35	-148,741,609.35
本期末	462,611,032.77	462,611,032.77

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

##### 6.4.7.8.1 国泰君安中证500指数增强A

单位：人民币元

项目 (国泰君安中证500指 数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,117,788.83	8,638,173.89	10,755,962.72
本期利润	-36,158,453.33	6,970,443.77	-29,188,009.56
本期基金份额交易产 生的变动数	-8,206,624.84	82,058.60	-8,124,566.24
其中：基金申购款	-18,317,296.53	-722,775.22	-19,040,071.75
基金赎回款	10,110,671.69	804,833.82	10,915,505.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-42,247,289.34	15,690,676.26	-26,556,613.08

##### 6.4.7.8.2 国泰君安中证500指数增强C

单位：人民币元

项目 (国泰君安中证500指 数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,217,397.57	5,280,908.18	6,498,305.75
本期利润	-24,085,715.11	3,153,927.24	-20,931,787.87
本期基金份额交易产 生的变动数	-315,663.40	-199,036.94	-514,700.34
其中：基金申购款	-13,100,311.66	-968,297.18	-14,068,608.84
基金赎回款	12,784,648.26	769,260.24	13,553,908.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-23,183,980.94	8,235,798.48	-14,948,182.46

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	79,788.20
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	94,138.53
结算备付金利息收入	52,372.74
其他	-
合计	226,299.47

#### 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
	2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	12,957,367,653.12
减：卖出股票成本总额	13,001,219,798.69
减：交易费用	16,881,976.24
买卖股票差价收入	-60,734,121.81

#### 6.4.7.11 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

无。

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2022年01月01日至2022年06月30日
期货投资	-951,823.53

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	7,907,580.95
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,907,580.95

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	10,068,942.35
——股票投资	10,068,942.35
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	55,428.66
——权证投资	-
——期货投资	55,428.66
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	10,124,371.01

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	425,214.41
合计	425,214.41

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	35,537.54
汇划手续费	448.00
合计	63,258.62

#### 6.4.7.20 分部报告

无。

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 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“国泰君安证券资管”）	基金管理人
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
上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）	基金托管人

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 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券	26,031,832,783.30	100.00%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

##### 6.4.10.1.4 基金交易

无。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总

		量的比例		额的比例
国泰君安 证券	1,683,804.49	100.00%	-	-

#### 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
	2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,425,741.46
其中：支付销售机构的客户维护费	2,579,717.01

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	813,861.18

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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 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		
	2022年01月01日至2022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	国泰君安中证500指数增强	合计

	A	C	
国泰君安 证券	0.00	729,083.52	729,083.52
国泰君安 证券资管	0.00	430.25	430.25
上海银行	0.00	33,377.18	33,377.18
合计	0.00	762,890.95	762,890.95
合计	0.00	1,525,781.90	1,525,781.90

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（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500指数增强A

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至2022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	9,999,450.00
报告期初持有的基金份额	9,999,450.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	9,999,450.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.14%

国泰君安中证500指数增强C

份额单位：份

项目	本期
	2022年01月01日至2022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	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
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：本基金合同生效日为2021年12月15日，无上年度同期对比数据。

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

本基金本报告期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	
	2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
上海银行股份有限公司	48,414,073.44	79,788.20

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

无。

#### 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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2022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
600938	中国海油	2022-04-14	6个月以上	非公开发行限售	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688400	凌云光	2022-06-27	1个月内（含）	新股未上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-
301139	元道通信	2022-06-30	1个月内（含）	新股未上市	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
301236	软通动力	2022-03-08	6个月以上	创业板打新限售	72.88	31.38	1,401	68,069.92	43,963.38	-
301200	大族数控	2022-02-18	6个月以上	创业板打新限售	76.56	51.92	691	52,902.96	35,876.72	-
301206	三元生物	2022-01-26	6个月以上	创业板打新限售	109.30	45.69	742	54,103.50	33,901.98	-
3012	华兰	2022	6个月以	创业	56.8	56.4	569	32,3	32,1	-

07	疫苗	-02-10	上	板打 新限售	8	2		64.7 2	02.9 8	
3012 15	中汽 股份	2022 -02- 28	6个月以 上	创业 板打 新限售	3.80	6.39	4,743	18,0 23.4 0	30,3 07.7 7	-
3012 19	腾远 钴业	2022 -03- 10	6个月以 上	创业 板打 新限售	173. 98	87.8 2	309	29,9 24.5 6	27,1 36.3 8	-
3013 02	华如 科技	2022 -06- 16	6个月以 上	创业 板打 新限售	52.0 3	56.4 2	466	24,2 45.9 8	26,2 91.7 2	-
3011 39	元道 通信	2022 -06- 30	6个月以 上	创业 板打 新限售	38.4 6	38.4 6	566	21,7 68.3 6	21,7 68.3 6	-
3011 22	采纳 股份	2022 -01- 19	6个月以 上	创业 板打 新限售	50.3 1	70.3 7	301	15,1 43.3 1	21,1 81.3 7	-
3011 02	兆讯 传媒	2022 -03- 15	6个月以 上	创业 板打 新限售	39.8 8	31.0 9	642	25,6 02.9 6	19,9 59.7 8	-
3012 56	华融 化学	2022 -03- 14	6个月以 上	创业 板打 新限售	8.05	10.0 8	1,831	14,7 39.5 5	18,4 56.4 8	-
3011 53	中科 江南	2022 -05- 10	6个月以 上	创业 板打 新限售	33.6 8	43.9 8	398	13,4 04.6 4	17,5 04.0 4	-

				售						
3011 03	何氏 眼科	2022 -03- 14	6个月以 上	创业 板打 新限 售	42.5 0	32.0 2	507	16,5 75.0 0	16,2 34.1 4	-
3012 35	华康 医疗	2022 -01- 21	6个月以 上	创业 板打 新限 售	39.3 0	37.9 3	418	16,4 27.4 0	15,8 54.7 4	-
3012 20	亚香 股份	2022 -06- 15	6个月以 上	创业 板打 新限 售	35.9 8	39.1 5	285	10,2 54.3 0	11,1 57.7 5	-
3012 37	和顺 科技	2022 -03- 16	6个月以 上	创业 板打 新限 售	56.6 9	41.8 6	261	14,7 96.0 9	10,9 25.4 6	-
3011 37	哈焊 华通	2022 -03- 14	6个月以 上	创业 板打 新限 售	15.3 7	15.9 9	644	9,89 8.28	10,2 97.5 6	-
3012 22	浙江 恒威	2022 -03- 02	6个月以 上	创业 板打 新限 售	33.9 8	28.9 6	332	11,2 81.3 6	9,61 4.72	-
3011 30	西点 药业	2022 -02- 16	6个月以 上	创业 板打 新限 售	22.5 5	37.7 0	237	5,34 4.35	8,93 4.90	-
3011 10	青木 股份	2022 -03- 04	6个月以 上	创业 板打 新限 售	63.1 0	39.8 5	202	12,7 46.2 0	8,04 9.70	-
3011	标榜	2022	6个月以	创业	40.2	30.5	257	10,3	7,86	-

81	股份	-02-11	上	板打 新限 售	5	9		44.2 5	1.63	
----	----	--------	---	---------------	---	---	--	-----------	------	--

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。

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。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 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
000957	中通客车	2022-06-22	重大事项或临时停牌	21.32	2022-07-06	19.19	3,700	15,048.52	78,884.00	-
002411	*ST 必	2022-02-0	重大	6.55	2022-02-0	6.22	367,200	2,242,111.00	2,405,160.00	-

	康	5-0 5	事 项 或 临 时 停 牌		7-0 1					
--	---	----------	---------------------------------	--	----------	--	--	--	--	--

注：本基金截至 2022年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 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

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

### 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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	86,227,464.57	-	-	-	-	-	86,227,464.57
结算备付金	-	-	-	-	-	12,943,814.57	12,943,814.57
存出保证金	5,217,368.80	-	-	-	-	-	5,217,368.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,193,492,513.35	1,193,492,513.35
应收申	-	-	-	-	-	9,882,300.94	9,882,300.94

## 国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年中期报告

购款							
资产总计	91,444,833.37	-	-	-	-	1,216,318,628.86	1,307,763,462.23
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,497,521.47	6,497,521.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	921,848.26	921,848.26
应付托管费	-	-	-	-	-	138,277.23	138,277.23
应付销售服务费	-	-	-	-	-	135,577.26	135,577.26
其他负债	-	-	-	-	-	123,817.23	123,817.23
负债总计	-	-	-	-	-	7,817,041.45	7,817,041.45
利率敏感度缺口	91,444,833.37	-	-	-	-	1,208,501,587.41	1,299,946,420.78
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	71,844,463.20	-	-	-	-	-	71,844,463.20
结算备付金	-	-	-	-	-	10,000,000.00	10,000,000.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,097,949,326.76	1,097,949,326.76
应收利息	-	-	-	-	-	18,751.70	18,751.70
应收申购款	-	-	-	-	-	54,318.33	54,318.33
资产总计	71,844,463.20	-	-	-	-	1,108,022,396.79	1,179,866,859.99
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	509,326.78	509,326.78
应付托管费	-	-	-	-	-	76,399.00	76,399.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	77,251.30	77,251.30
其他负债	-	-	-	-	-	3,337.78	3,337.78

负债总计	-	-	-	-	-	666,314.86	666,314.86
利率敏感度缺口	71,844,463.20	-	-	-	-	1,107,356,081.93	1,179,200,545.13

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孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的基金、股票、债券，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。

##### 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 2022年06月30日		上年度末 2021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	1,193,492,513.35	91.81	1,097,949,326.76	93.11
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-

产—贵金属投资				
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,193,492,513.35	91.81	1,097,949,326.76	93.11

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型(CAPM)描述的规律进行变动		
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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	54,303,909.36	23,605,910.53
	业绩比较基准下降5%	-54,303,909.36	-23,605,910.53

注:上表为市场价格风险的敏感性分析,反映了在其他变量不变的假设下,证券投资价格发生合理、可能的变动时,将对基金净值产生的影响。

#### 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

金额单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	1,188,765,691.02	1,097,949,326.76

第二层次	2,988,905.69	-
第三层次	1,737,916.64	-
合计	1,193,492,513.35	1,097,949,326.76

#### 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

无。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

无。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 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	1,193,492,513.35	91.26
	其中：股票	1,193,492,513.35	91.26
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	99,171,279.14	7.58
8	其他各项资产	15,099,669.74	1.15
9	合计	1,307,763,462.23	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	3,947,324.00	0.30
B	采矿业	54,826,897.84	4.22
C	制造业	525,235,791.71	40.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,450,877.32	3.50
E	建筑业	15,822,713.00	1.22
F	批发和零售业	19,554,648.00	1.50
G	交通运输、仓储和邮政业	34,021,685.00	2.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	105,590,080.28	8.12
J	金融业	81,354,312.85	6.26
K	房地产业	21,532,956.00	1.66
L	租赁和商务服务业	17,185,808.00	1.32
M	科学研究和技术服务业	10,235,475.00	0.79
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	5,983,640.00	0.46
R	文化、体育和娱乐业	20,271,357.00	1.56
S	综合	3,355,967.00	0.26
	合计	964,369,533.00	74.19

### 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	3,227,286.44	0.25
C	制造业	156,600,789.72	12.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,314,405.00	1.56
E	建筑业	3,255,368.00	0.25
F	批发和零售业	6,940,292.00	0.53
G	交通运输、仓储和邮政业	9,217,693.00	0.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,412,002.30	0.65
J	金融业	5,535,298.00	0.43
K	房地产业	13,178,769.46	1.01
L	租赁和商务服务业	35,370.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	2,389,471.51	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,234.14	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

合计	229,122,980.35	17.63
----	----------------	-------

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 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(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	002240	盛新锂能	308,100	18,596,916.00	1.43
2	000983	山西焦煤	1,329,100	17,796,649.00	1.37
3	000629	攀钢钒钛	4,656,100	17,693,180.00	1.36
4	300363	博腾股份	224,000	17,469,760.00	1.34
5	300182	捷成股份	3,147,000	17,308,500.00	1.33
6	600497	驰宏锌锗	3,327,700	17,270,763.00	1.33
7	603198	迎驾贡酒	257,300	16,760,522.00	1.29
8	601872	招商轮船	2,872,000	16,542,720.00	1.27
9	300009	安科生物	1,608,500	16,261,935.00	1.25
10	600392	盛和资源	715,400	16,168,040.00	1.24
11	601456	国联证券	1,316,293	16,150,915.11	1.24
12	600597	光明乳业	1,269,000	16,027,470.00	1.23
13	300037	新宙邦	302,000	15,873,120.00	1.22
14	600166	福田汽车	5,381,900	15,230,777.00	1.17
15	600863	内蒙华电	4,146,700	15,135,455.00	1.16
16	600787	中储股份	2,582,900	14,696,701.00	1.13
17	002081	金螳螂	2,877,500	14,617,700.00	1.12
18	002497	雅化集团	442,800	14,457,420.00	1.11
19	600728	佳都科技	2,234,400	14,434,224.00	1.11
20	600160	巨化股份	1,050,100	13,808,815.00	1.06

21	300308	中际旭创	438,200	13,606,110.00	1.05
22	000563	陕国投A	4,343,800	13,552,656.00	1.04
23	600079	人福医药	840,400	13,446,400.00	1.03
24	600037	歌华有线	1,394,500	13,094,355.00	1.01
25	000778	新兴铸管	2,708,270	13,053,861.40	1.00
26	603379	三美股份	571,300	12,711,425.00	0.98
27	600867	通化东宝	1,182,500	12,227,050.00	0.94
28	688099	晶晨股份	118,592	11,977,792.00	0.92
29	601991	大唐发电	4,918,653	11,952,326.79	0.92
30	600582	天地科技	2,487,700	11,891,206.00	0.91
31	688521	芯原股份	238,350	11,774,490.00	0.91
32	300017	网宿科技	2,144,500	11,494,520.00	0.88
33	002505	鹏都农牧	3,389,100	11,489,049.00	0.88
34	000559	万向钱潮	1,833,141	10,888,857.54	0.84
35	000402	金融街	1,820,700	10,833,165.00	0.83
36	002815	崇达技术	816,600	10,460,646.00	0.80
37	601615	明阳智能	307,600	10,396,880.00	0.80
38	002756	永兴材料	65,563	9,979,344.23	0.77
39	688006	杭可科技	140,920	9,872,855.20	0.76
40	688777	中控技术	135,023	9,824,273.48	0.76
41	601828	美凯龙	1,596,500	9,674,790.00	0.74
42	603127	昭衍新药	84,000	9,559,200.00	0.74
43	600315	上海家化	218,400	9,336,600.00	0.72
44	601016	节能风电	1,931,622	9,271,785.60	0.71
45	600256	广汇能源	850,200	8,961,108.00	0.69
46	600839	四川长虹	3,091,300	8,902,944.00	0.68
47	600909	华安证券	1,874,100	8,527,155.00	0.66
48	600435	北方导航	983,000	8,473,460.00	0.65
49	601992	金隅集团	3,052,500	8,455,425.00	0.65
50	600325	华发股份	1,047,500	7,929,575.00	0.61
51	600967	内蒙一机	868,600	7,921,632.00	0.61

52	600027	华电国际	1,958,601	7,697,301.93	0.59
53	601077	渝农商行	2,036,200	7,533,940.00	0.58
54	600415	小商品城	1,347,900	7,507,803.00	0.58
55	000513	丽珠集团	200,300	7,252,863.00	0.56
56	000930	中粮科技	798,300	7,216,632.00	0.56
57	002511	中顺洁柔	568,600	7,118,872.00	0.55
58	601555	东吴证券	1,022,400	7,085,232.00	0.55
59	601179	中国西电	1,498,000	7,010,640.00	0.54
60	002294	信立泰	244,800	6,878,880.00	0.53
61	600879	航天电子	1,056,400	6,856,036.00	0.53
62	600177	雅戈尔	1,030,352	6,831,233.76	0.53
63	002191	劲嘉股份	636,400	6,822,208.00	0.52
64	300482	万孚生物	166,400	6,774,144.00	0.52
65	600486	扬农化工	50,000	6,664,000.00	0.51
66	601958	金钼股份	734,326	6,491,441.84	0.50
67	601860	紫金银行	2,206,900	6,333,803.00	0.49
68	600718	东软集团	549,500	6,324,745.00	0.49
69	000738	航发控制	222,400	6,249,440.00	0.48
70	600765	中航重机	192,040	6,179,847.20	0.48
71	300244	迪安诊断	192,400	5,983,640.00	0.46
72	300630	普利制药	166,681	5,858,837.15	0.45
73	300212	易华录	333,300	5,799,420.00	0.45
74	000988	华工科技	247,900	5,743,843.00	0.44
75	600704	物产中大	1,039,100	5,330,583.00	0.41
76	600572	康恩贝	1,183,082	5,241,053.26	0.40
77	600959	江苏有线	1,566,600	5,107,116.00	0.39
78	600580	卧龙电驱	346,654	4,998,750.68	0.38
79	600390	五矿资本	1,000,600	4,892,934.00	0.38
80	002212	天融信	477,200	4,843,580.00	0.37
81	603613	国联股份	52,913	4,688,091.80	0.36
82	002507	涪陵榨菜	132,300	4,566,996.00	0.35

83	300390	天华超净	51,100	4,466,140.00	0.34
84	002019	亿帆医药	315,700	4,413,486.00	0.34
85	002268	卫士通	101,600	4,359,656.00	0.34
86	002936	郑州银行	1,599,400	4,302,386.00	0.33
87	002249	大洋电机	700,000	4,298,000.00	0.33
88	000021	深科技	367,800	4,281,192.00	0.33
89	601118	海南橡胶	825,800	3,947,324.00	0.30
90	002985	北摩高科	63,810	3,737,989.80	0.29
91	600673	东阳光	373,300	3,355,967.00	0.26
92	600522	中天科技	136,300	3,148,530.00	0.24
93	600380	健康元	238,700	2,947,945.00	0.23
94	300769	德方纳米	7,100	2,901,628.00	0.22
95	688208	道通科技	83,748	2,756,984.16	0.21
96	600699	均胜电子	174,400	2,739,824.00	0.21
97	000750	国海证券	747,300	2,712,699.00	0.21
98	600782	新钢股份	528,300	2,662,632.00	0.20
99	600022	山东钢铁	1,492,500	2,596,950.00	0.20
100	600968	海油发展	992,600	2,560,908.00	0.20
101	002500	山西证券	439,831	2,524,629.94	0.19
102	600705	中航产融	718,300	2,485,318.00	0.19
103	600201	生物股份	269,900	2,472,284.00	0.19
104	000961	中南建设	767,400	2,340,570.00	0.18
105	002739	万达电影	170,000	2,320,500.00	0.18
106	603077	和邦生物	525,100	2,236,926.00	0.17
107	601298	青岛港	404,900	2,214,803.00	0.17
108	300296	利亚德	302,500	2,208,250.00	0.17
109	688122	西部超导	20,400	1,880,880.00	0.14
110	000709	河钢股份	750,300	1,695,678.00	0.13
111	002948	青岛银行	458,690	1,660,457.80	0.13
112	688009	中国通号	364,242	1,650,016.26	0.13
113	600648	外高桥	110,700	1,505,520.00	0.12

114	002624	完美世界	102,500	1,472,925.00	0.11
115	600120	浙江东方	354,500	1,421,545.00	0.11
116	000598	兴蓉环境	272,800	1,394,008.00	0.11
117	603456	九洲药业	26,552	1,372,738.40	0.11
118	300001	特锐德	73,300	1,268,823.00	0.10
119	688321	微芯生物	49,232	1,240,154.08	0.10
120	002128	电投能源	84,900	1,215,768.00	0.09
121	601162	天风证券	373,200	1,186,776.00	0.09
122	000060	中金岭南	253,900	1,132,394.00	0.09
123	600297	广汇汽车	425,000	1,109,250.00	0.09
124	000960	锡业股份	65,700	1,101,789.00	0.08
125	600398	海澜之家	205,600	976,600.00	0.08
126	688185	康希诺	4,535	902,827.80	0.07
127	601611	中国核建	88,800	745,032.00	0.06
128	000050	深天马A	69,800	695,906.00	0.05
129	003035	南网能源	106,500	676,275.00	0.05
130	000898	鞍钢股份	209,800	675,556.00	0.05
131	600373	中文传媒	64,300	642,357.00	0.05
132	002701	奥瑞金	122,900	639,080.00	0.05
133	002625	光启技术	33,800	583,726.00	0.04
134	600901	江苏租赁	113,700	583,281.00	0.04
135	601699	潞安环能	35,300	516,086.00	0.04
136	600566	济川药业	17,500	475,300.00	0.04
137	689009	九号公司	10,000	445,000.00	0.03
138	601598	中国外运	111,200	431,456.00	0.03
139	600039	四川路桥	39,100	411,723.00	0.03
140	002152	广电运通	44,100	408,807.00	0.03
141	300253	卫宁健康	43,900	385,442.00	0.03
142	600487	亨通光电	23,500	341,690.00	0.03
143	600811	东方集团	106,600	301,678.00	0.02
144	600737	中粮糖业	37,200	279,744.00	0.02

145	002409	雅克科技	4,579	254,180.29	0.02
146	000031	大悦城	59,700	238,800.00	0.02
147	300357	我武生物	4,000	208,120.00	0.02
148	600155	华创阳安	23,700	200,976.00	0.02
149	300724	捷佳伟创	1,600	142,960.00	0.01
150	603605	珀莱雅	800	132,144.00	0.01
151	603719	良品铺子	4,200	120,246.00	0.01
152	000728	国元证券	17,000	105,740.00	0.01
153	600208	新湖中宝	32,000	88,320.00	0.01
154	002244	滨江集团	9,700	83,905.00	0.01
155	600350	山东高速	15,700	82,425.00	0.01
156	002399	海普瑞	4,600	80,868.00	0.01
157	002180	纳思达	1,300	65,806.00	0.01
158	000686	东北证券	9,100	63,609.00	0.00
159	001872	招商港口	2,800	43,680.00	0.00
160	600528	中铁工业	4,800	38,640.00	0.00
161	000519	中兵红箭	1,100	32,065.00	0.00
162	002048	宁波华翔	2,000	32,040.00	0.00
163	601198	东兴证券	3,400	30,260.00	0.00
164	600970	中材国际	3,000	29,070.00	0.00
165	600667	太极实业	2,600	19,188.00	0.00
166	600066	宇通客车	2,200	19,030.00	0.00
167	600064	南京高科	1,500	16,500.00	0.00
168	300146	汤臣倍健	700	15,155.00	0.00
169	000937	冀中能源	1,900	14,174.00	0.00
170	000831	五矿稀土	400	12,500.00	0.00
171	601156	东航物流	500	9,900.00	0.00
172	000553	安道麦A	800	9,688.00	0.00
173	002195	二三四五	4,200	9,450.00	0.00
174	600623	华谊集团	700	5,810.00	0.00
175	601003	柳钢股份	1,400	5,670.00	0.00

176	600499	科达制造	200	4,128.00	0.00
177	002010	传化智联	500	3,215.00	0.00
178	600409	三友化工	300	2,457.00	0.00
179	002146	荣盛发展	700	2,121.00	0.00
180	603868	飞科电器	6	454.50	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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002805	丰元股份	205,150	12,698,785.00	0.98
2	603392	万泰生物	61,600	9,566,480.00	0.74
3	600649	城投控股	2,127,501	9,105,704.28	0.70
4	688518	联赢激光	267,022	9,076,077.78	0.70
5	688313	仕佳光子	769,638	8,773,873.20	0.67
6	002545	东方铁塔	767,504	8,734,195.52	0.67
7	600428	中远海特	1,689,600	8,042,496.00	0.62
8	300118	东方日升	272,600	7,995,358.00	0.62
9	300170	汉得信息	856,400	7,716,164.00	0.59
10	000543	皖能电力	1,815,600	7,244,244.00	0.56
11	600780	通宝能源	1,276,100	6,712,286.00	0.52
12	688050	爱博医疗	27,363	6,134,784.60	0.47
13	300409	道氏技术	218,600	5,679,228.00	0.44
14	002460	赣锋锂业	37,500	5,576,250.00	0.43
15	603067	振华股份	429,600	5,382,888.00	0.41
16	300657	弘信电子	452,700	5,260,374.00	0.40
17	300160	秀强股份	618,700	5,030,031.00	0.39
18	688278	特宝生物	164,771	4,857,449.08	0.37
19	002562	兄弟科技	746,700	4,838,616.00	0.37
20	600617	国新能源	1,016,300	4,685,143.00	0.36

21	603766	隆鑫通用	936,400	4,316,804.00	0.33
22	300382	斯莱克	273,200	4,281,044.00	0.33
23	300217	东方电热	668,300	4,089,996.00	0.31
24	000517	荣安地产	1,254,101	3,988,041.18	0.31
25	300661	圣邦股份	20,900	3,804,218.00	0.29
26	600643	爱建集团	636,600	3,775,038.00	0.29
27	300317	珈伟新能	589,500	3,725,640.00	0.29
28	300647	超频三	325,800	3,661,992.00	0.28
29	300681	英搏尔	56,030	3,236,853.10	0.25
30	688123	聚辰股份	29,238	3,114,431.76	0.24
31	688578	艾力斯	138,866	2,930,072.60	0.23
32	601933	永辉超市	619,700	2,652,316.00	0.20
33	002375	亚厦股份	510,800	2,559,108.00	0.20
34	002411	*ST必康	367,200	2,405,160.00	0.19
35	688202	美迪西	6,900	2,343,309.00	0.18
36	300346	南大光电	60,050	2,160,599.00	0.17
37	603777	来伊份	145,800	2,055,780.00	0.16
38	002419	天虹股份	277,100	1,975,723.00	0.15
39	688200	华峰测控	5,454	1,943,805.60	0.15
40	688516	奥特维	7,135	1,904,688.25	0.15
41	002049	紫光国微	9,400	1,783,368.00	0.14
42	600758	辽宁能源	393,900	1,733,160.00	0.13
43	601939	建设银行	283,600	1,718,616.00	0.13
44	300101	振芯科技	78,000	1,609,920.00	0.12
45	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.10
46	600578	京能电力	381,500	1,194,095.00	0.09
47	600370	三房巷	300,000	1,053,000.00	0.08
48	600438	通威股份	16,400	981,704.00	0.08
49	688155	先惠技术	8,886	925,921.20	0.07
50	600269	赣粤高速	245,300	851,191.00	0.07
51	002466	天齐锂业	6,400	798,720.00	0.06

52	300179	四方达	48,200	755,776.00	0.06
53	688008	澜起科技	12,245	741,802.10	0.06
54	600251	冠农股份	65,300	696,098.00	0.05
55	600481	双良节能	32,500	547,625.00	0.04
56	600284	浦东建设	69,200	512,772.00	0.04
57	000731	四川美丰	52,900	481,390.00	0.04
58	002301	齐心集团	68,700	453,420.00	0.03
59	603659	璞泰来	5,200	438,880.00	0.03
60	300477	合纵科技	53,400	411,180.00	0.03
61	300953	震裕科技	2,900	397,271.00	0.03
62	000600	建投能源	84,200	355,324.00	0.03
63	688556	高测股份	4,244	342,490.80	0.03
64	688536	思瑞浦	600	336,954.00	0.03
65	603290	斯达半导	805	310,649.50	0.02
66	002821	凯莱英	1,000	289,000.00	0.02
67	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.02
68	601339	百隆东方	52,100	264,668.00	0.02
69	600738	丽尚国潮	33,700	245,673.00	0.02
70	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.02
71	688550	瑞联新材	2,969	203,643.71	0.02
72	601008	连云港	44,100	185,661.00	0.01
73	300712	永福股份	3,200	183,488.00	0.01
74	601238	广汽集团	12,000	182,880.00	0.01
75	300480	光力科技	7,899	141,708.06	0.01
76	688037	芯源微	900	130,473.00	0.01
77	600163	中闽能源	13,700	115,765.00	0.01
78	603993	洛阳钼业	15,800	90,534.00	0.01
79	300568	星源材质	2,900	84,216.00	0.01
80	000957	中通客车	3,700	78,884.00	0.01
81	600035	楚天高速	23,900	78,153.00	0.01
82	688077	大地熊	900	75,879.00	0.01

83	002570	贝因美	14,700	72,765.00	0.01
84	600067	冠城大通	19,300	69,480.00	0.01
85	300224	正海磁材	4,100	62,730.00	0.00
86	603818	曲美家居	6,500	61,750.00	0.00
87	600017	日照港	19,800	60,192.00	0.00
88	600063	皖维高新	7,900	59,882.00	0.00
89	000552	靖远煤电	12,500	53,875.00	0.00
90	688690	纳微科技	600	48,486.00	0.00
91	300352	北信源	9,900	45,738.00	0.00
92	301236	软通动力	1,401	43,963.38	0.00
93	605123	派克新材	300	42,216.00	0.00
94	000016	深康佳A	6,700	40,535.00	0.00
95	002085	万丰奥威	7,100	38,127.00	0.00
96	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
97	301200	大族数控	691	35,876.72	0.00
98	301206	三元生物	742	33,901.98	0.00
99	688617	惠泰医疗	150	32,862.00	0.00
100	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
101	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
102	601689	拓普集团	400	27,372.00	0.00
103	301219	腾远钴业	309	27,136.38	0.00
104	603688	石英股份	200	26,522.00	0.00
105	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
106	601658	邮储银行	4,400	23,716.00	0.00

10 7	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
10 8	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
10 9	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
11 0	601328	交通银行	3,600	17,928.00	0.00
11 1	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
11 2	601038	一拖股份	1,500	16,890.00	0.00
11 3	600888	新疆众和	1,800	16,560.00	0.00
11 4	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
11 5	603348	文灿股份	300	16,080.00	0.00
11 6	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
11 7	300048	合康新能	2,300	15,571.00	0.00
11 8	002344	海宁皮城	3,300	15,411.00	0.00
11 9	000935	四川双马	600	14,532.00	0.00
12 0	603313	梦百合	1,100	13,200.00	0.00
12 1	000408	藏格矿业	400	13,176.00	0.00
12 2	600496	精工钢构	2,500	11,550.00	0.00
12	000762	西藏矿业	200	11,186.00	0.00

3					
12 4	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
12 5	300130	新国都	900	11,034.00	0.00
12 6	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
12 7	688330	宏力达	127	10,920.73	0.00
12 8	600639	浦东金桥	800	10,872.00	0.00
12 9	000652	泰达股份	2,700	10,800.00	0.00
13 0	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
13 1	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
13 2	300861	美畅股份	100	9,269.00	0.00
13 3	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
13 4	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
13 5	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
13 6	600905	三峡能源	1,200	7,548.00	0.00
13 7	300057	万顺新材	700	6,629.00	0.00
13 8	601898	中煤能源	600	6,228.00	0.00
13 9	300666	江丰电子	100	6,100.00	0.00

140	300890	翔丰华	100	5,532.00	0.00
141	688363	华熙生物	34	4,834.12	0.00
142	600604	市北高新	800	4,672.00	0.00
143	300601	康泰生物	80	3,614.40	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	300363	博腾股份	78,614,513.88	6.67
2	603290	斯达半导	67,094,830.18	5.69
3	002497	雅化集团	63,399,262.00	5.38
4	300769	德方纳米	63,040,383.20	5.35
5	601872	招商轮船	61,973,212.26	5.26
6	600256	广汇能源	61,384,339.60	5.21
7	600155	华创阳安	59,449,836.02	5.04
8	601615	明阳智能	58,035,465.52	4.92
9	002815	崇达技术	55,782,656.45	4.73
10	603127	昭衍新药	54,474,572.63	4.62
11	600582	天地科技	53,996,182.00	4.58
12	600497	驰宏锌锗	51,588,594.24	4.37
13	603456	九洲药业	50,619,805.85	4.29
14	600141	兴发集团	50,208,778.03	4.26
15	300170	汉得信息	50,204,244.58	4.26
16	300037	新宙邦	49,595,702.76	4.21
17	600160	巨化股份	48,520,644.72	4.11
18	688005	容百科技	48,408,199.36	4.11

19	600037	歌华有线	47,866,997.37	4.06
20	600233	圆通速递	46,777,528.22	3.97
21	688099	晶晨股份	45,369,132.16	3.85
22	300308	中际旭创	45,274,991.43	3.84
23	600718	东软集团	44,239,227.95	3.75
24	600705	中航产融	44,088,812.00	3.74
25	600438	通威股份	43,955,651.70	3.73
26	600546	山煤国际	43,937,704.88	3.73
27	600704	物产中大	42,597,047.91	3.61
28	600325	华发股份	42,449,509.72	3.60
29	000733	振华科技	42,164,032.00	3.58
30	600839	四川长虹	42,035,494.00	3.56
31	600415	小商品城	41,523,101.00	3.52
32	000960	锡业股份	41,132,651.00	3.49
33	300182	捷成股份	40,796,237.52	3.46
34	000988	华工科技	40,063,573.58	3.40
35	300775	三角防务	40,028,233.39	3.39
36	688559	海目星	39,957,804.46	3.39
37	601128	常熟银行	39,880,716.96	3.38
38	603198	迎驾贡酒	39,823,417.94	3.38
39	002460	赣锋锂业	39,809,569.59	3.38
40	000983	山西焦煤	39,523,756.98	3.35
41	300223	北京君正	39,234,907.92	3.33
42	603379	三美股份	39,142,051.60	3.32
43	300772	运达股份	38,933,964.00	3.30
44	600572	康恩贝	38,514,000.02	3.27
45	000629	攀钢钒钛	38,494,957.28	3.26
46	603613	国联股份	38,333,660.65	3.25
47	002507	涪陵榨菜	38,323,330.58	3.25
48	600765	中航重机	38,309,537.37	3.25
49	600862	中航高科	38,111,908.22	3.23

50	600066	宇通客车	38,103,321.48	3.23
51	002756	永兴材料	37,987,477.72	3.22
52	002384	东山精密	37,654,090.48	3.19
53	603259	药明康德	37,402,848.92	3.17
54	601958	金钼股份	37,350,473.28	3.17
55	600737	中粮糖业	37,257,068.40	3.16
56	605358	立昂微	37,057,901.75	3.14
57	600392	盛和资源	36,854,046.41	3.13
58	600909	华安证券	36,787,421.94	3.12
59	002920	德赛西威	36,425,009.20	3.09
60	002505	鹏都农牧	36,405,447.00	3.09
61	300009	安科生物	36,061,128.95	3.06
62	300332	天壕环境	35,869,356.00	3.04
63	600787	中储股份	35,684,219.08	3.03
64	002985	北摩高科	35,638,392.69	3.02
65	601077	渝农商行	35,400,227.79	3.00
66	000975	银泰黄金	34,707,440.00	2.94
67	600597	光明乳业	34,502,295.60	2.93
68	603392	万泰生物	34,019,280.79	2.88
69	688202	美迪西	34,003,237.67	2.88
70	601992	金隅集团	33,762,752.54	2.86
71	300661	圣邦股份	33,762,226.98	2.86
72	300347	泰格医药	33,747,012.91	2.86
73	300751	迈为股份	33,735,440.66	2.86
74	300017	网宿科技	33,697,259.88	2.86
75	002042	华孚时尚	33,545,505.34	2.84
76	600649	城投控股	33,493,491.02	2.84
77	688518	联赢激光	33,401,028.13	2.83
78	300759	康龙化成	33,205,455.22	2.82
79	000630	铜陵有色	33,171,021.72	2.81
80	600380	健康元	32,894,078.02	2.79

81	000709	河钢股份	32,841,938.90	2.79
82	000402	金融街	32,641,348.96	2.77
83	300750	宁德时代	32,609,533.93	2.77
84	600673	东阳光	32,554,878.16	2.76
85	000559	万向钱潮	32,524,914.59	2.76
86	600968	海油发展	32,462,754.98	2.75
87	600867	通化东宝	32,283,786.41	2.74
88	002049	紫光国微	32,248,920.64	2.73
89	603236	移远通信	32,019,031.44	2.72
90	002439	启明星辰	31,394,753.00	2.66
91	600435	北方导航	31,225,530.37	2.65
92	601456	国联证券	31,203,936.88	2.65
93	601339	百隆东方	31,062,045.44	2.63
94	600428	中远海特	30,924,945.81	2.62
95	600967	内蒙一机	30,821,451.54	2.61
96	000060	中金岭南	30,803,207.20	2.61
97	601866	中远海发	30,654,900.30	2.60
98	600639	浦东金桥	30,642,481.12	2.60
99	603659	璞泰来	30,362,607.37	2.57
100	600487	亨通光电	30,336,163.70	2.57
101	600166	福田汽车	30,228,946.47	2.56
102	601928	凤凰传媒	30,167,889.44	2.56
103	688777	中控技术	30,062,990.81	2.55
104	000937	冀中能源	30,048,295.34	2.55
105	002850	科达利	29,833,114.00	2.53
106	002375	亚厦股份	29,496,717.08	2.50
107	300825	阿尔特	29,487,466.20	2.50
108	603317	天味食品	29,376,318.53	2.49
109	600201	生物股份	29,350,805.70	2.49
110	300896	爱美客	29,122,226.75	2.47
111	300217	东方电热	29,118,586.26	2.47

112	688050	爱博医疗	29,110,639.92	2.47
113	000750	国海证券	28,915,071.21	2.45
114	000997	新大陆	28,901,663.15	2.45
115	601179	中国西电	28,773,738.42	2.44
116	002597	金禾实业	28,753,754.22	2.44
117	688516	奥特维	28,688,391.20	2.43
118	688536	思瑞浦	28,490,785.34	2.42
119	300450	先导智能	28,424,232.87	2.41
120	688508	芯朋微	28,423,526.33	2.41
121	002240	盛新锂能	28,408,861.60	2.41
122	002191	劲嘉股份	28,355,630.28	2.40
123	002821	凯莱英	28,249,487.88	2.40
124	600039	四川路桥	28,167,881.26	2.39
125	600643	爱建集团	28,127,022.76	2.39
126	300244	迪安诊断	28,013,779.00	2.38
127	000970	中科三环	27,907,194.45	2.37
128	002557	洽洽食品	27,855,380.28	2.36
129	300179	四方达	27,834,610.00	2.36
130	600728	佳都科技	27,723,593.42	2.35
131	601598	中国外运	27,672,831.10	2.35
132	600315	上海家化	27,480,756.08	2.33
133	601162	天风证券	26,987,984.25	2.29
134	002124	天邦食品	26,912,810.00	2.28
135	000543	皖能电力	26,759,140.97	2.27
136	300073	当升科技	26,649,003.00	2.26
137	688298	东方生物	26,516,906.50	2.25
138	688012	中微公司	26,293,682.90	2.23
139	601717	郑煤机	26,055,465.00	2.21
140	000728	国元证券	25,915,628.20	2.20
141	601001	晋控煤业	25,854,349.10	2.19
142	600863	内蒙华电	25,832,994.12	2.19

143	002301	齐心集团	25,720,699.00	2.18
144	300001	特锐德	25,666,774.00	2.18
145	002081	金螳螂	25,655,977.00	2.18
146	000738	航发控制	25,637,689.18	2.17
147	000513	丽珠集团	25,632,599.22	2.17
148	000656	金科股份	25,625,847.00	2.17
149	600875	东方电气	25,569,880.62	2.17
150	300409	道氏技术	25,445,902.00	2.16
151	000567	海德股份	25,266,079.89	2.14
152	688122	西部超导	25,255,030.34	2.14
153	000301	东方盛虹	25,029,620.00	2.12
154	000930	中粮科技	24,972,467.00	2.12
155	601778	晶科科技	24,871,244.28	2.11
156	600782	新钢股份	24,745,051.00	2.10
157	000031	大悦城	24,604,440.42	2.09
158	002410	广联达	24,363,903.67	2.07
159	600038	中直股份	24,235,670.00	2.06
160	002466	天齐锂业	23,987,274.04	2.03
161	600872	中炬高新	23,970,065.63	2.03
162	002268	卫士通	23,941,552.55	2.03
163	300088	长信科技	23,837,512.00	2.02
164	601860	紫金银行	23,669,896.36	2.01
165	688008	澜起科技	23,653,341.53	2.01

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	603290	斯达半导	68,882,351.41	5.84

2	300363	博腾股份	65,803,740.57	5.58
3	300769	德方纳米	61,701,386.08	5.23
4	600256	广汇能源	61,486,874.12	5.21
5	601615	明阳智能	60,531,359.17	5.13
6	688005	容百科技	59,886,217.67	5.08
7	600155	华创阳安	58,772,031.02	4.98
8	600546	山煤国际	53,416,061.70	4.53
9	603456	九洲药业	53,401,542.84	4.53
10	600141	兴发集团	52,985,463.60	4.49
11	002815	崇达技术	50,743,104.43	4.30
12	601872	招商轮船	49,787,773.96	4.22
13	000960	锡业股份	49,564,223.20	4.20
14	600497	驰宏锌锗	48,305,354.52	4.10
15	601128	常熟银行	48,267,514.78	4.09
16	002497	雅化集团	47,971,467.00	4.07
17	600233	圆通速递	46,687,959.33	3.96
18	000733	振华科技	45,790,925.30	3.88
19	002384	东山精密	45,760,568.63	3.88
20	603127	昭衍新药	45,709,190.81	3.88
21	300775	三角防务	44,669,226.54	3.79
22	603613	国联股份	44,400,359.16	3.77
23	600438	通威股份	43,709,412.70	3.71
24	600862	中航高科	43,529,491.56	3.69
25	600705	中航产融	43,257,990.00	3.67
26	600582	天地科技	42,417,309.03	3.60
27	300170	汉得信息	42,417,225.64	3.60
28	601339	百隆东方	41,000,295.27	3.48
29	300751	迈为股份	40,350,249.74	3.42
30	688559	海目星	40,172,752.35	3.41
31	300772	运达股份	39,678,947.01	3.36
32	002042	华孚时尚	39,644,944.83	3.36

33	600737	中粮糖业	39,122,385.87	3.32
34	000630	铜陵有色	38,518,533.00	3.27
35	300037	新宙邦	38,144,607.10	3.23
36	603259	药明康德	37,649,523.41	3.19
37	600325	华发股份	37,558,628.60	3.19
38	600066	宇通客车	37,379,969.56	3.17
39	300223	北京君正	37,321,667.63	3.16
40	603659	璞泰来	37,112,854.90	3.15
41	600037	歌华有线	36,791,896.66	3.12
42	002920	德赛西威	36,644,449.90	3.11
43	600765	中航重机	36,529,074.93	3.10
44	000988	华工科技	36,472,539.39	3.09
45	600704	物产中大	36,185,397.94	3.07
46	300073	当升科技	36,165,110.55	3.07
47	605358	立昂微	35,583,047.43	3.02
48	000975	银泰黄金	35,582,827.20	3.02
49	002821	凯莱英	35,142,831.71	2.98
50	600160	巨化股份	35,100,681.72	2.98
51	600380	健康元	35,087,628.89	2.98
52	600487	亨通光电	34,765,483.27	2.95
53	300332	天壕环境	34,685,596.00	2.94
54	002049	紫光国微	34,308,630.95	2.91
55	688508	芯朋微	34,115,063.23	2.89
56	600415	小商品城	34,103,070.00	2.89
57	688099	晶晨股份	33,666,984.56	2.86
58	002460	赣锋锂业	33,666,215.76	2.86
59	600718	东软集团	33,539,323.04	2.84
60	002507	涪陵榨菜	33,511,458.00	2.84
61	601928	凤凰传媒	33,065,313.90	2.80
62	601958	金钼股份	33,037,137.33	2.80
63	603236	移远通信	33,014,752.14	2.80

64	601077	渝农商行	32,907,793.14	2.79
65	300759	康龙化成	32,855,690.87	2.79
66	600572	康恩贝	32,785,949.00	2.78
67	000937	冀中能源	32,762,144.49	2.78
68	300750	宁德时代	32,757,871.30	2.78
69	688202	美迪西	32,599,213.57	2.76
70	300347	泰格医药	32,517,823.60	2.76
71	601598	中国外运	31,938,998.78	2.71
72	600839	四川长虹	31,887,209.13	2.70
73	688516	奥特维	31,787,698.79	2.70
74	600201	生物股份	31,694,942.82	2.69
75	000060	中金岭南	31,558,494.67	2.68
76	002439	启明星辰	31,556,774.96	2.68
77	600639	浦东金桥	31,504,576.24	2.67
78	000656	金科股份	31,409,190.27	2.66
79	000709	河钢股份	31,231,452.94	2.65
80	600673	东阳光	31,129,851.91	2.64
81	002985	北摩高科	31,076,692.03	2.64
82	300308	中际旭创	30,989,354.04	2.63
83	002597	金禾实业	30,769,650.18	2.61
84	300661	圣邦股份	30,627,587.10	2.60
85	600968	海油发展	30,559,522.92	2.59
86	300896	爱美客	30,411,777.27	2.58
87	002850	科达利	30,315,975.40	2.57
88	601866	中远海发	30,261,029.38	2.57
89	300088	长信科技	30,099,034.02	2.55
90	603317	天味食品	29,884,536.49	2.53
91	601717	郑煤机	29,873,630.22	2.53
92	002410	广联达	29,621,569.15	2.51
93	300450	先导智能	29,359,860.12	2.49
94	002557	洽洽食品	29,324,873.46	2.49

95	002124	天邦食品	29,308,512.00	2.49
96	601689	拓普集团	29,277,222.43	2.48
97	688536	思瑞浦	29,221,091.61	2.48
98	603198	迎驾贡酒	28,843,431.73	2.45
99	000997	新大陆	28,822,593.27	2.44
100	600909	华安证券	28,450,842.30	2.41
101	688550	瑞联新材	28,185,471.90	2.39
102	000970	中科三环	28,077,945.15	2.38
103	300179	四方达	28,025,192.00	2.38
104	002756	永兴材料	28,008,657.33	2.38
105	000031	大悦城	27,925,506.56	2.37
106	300474	景嘉微	27,892,194.00	2.37
107	002375	亚厦股份	27,719,088.61	2.35
108	300825	阿尔特	27,681,630.73	2.35
109	601001	晋控煤业	27,507,486.24	2.33
110	600782	新钢股份	27,165,758.43	2.30
111	688122	西部超导	27,126,366.95	2.30
112	300217	东方电热	26,982,154.60	2.29
113	300244	迪安诊断	26,930,839.00	2.28
114	000750	国海证券	26,783,082.83	2.27
115	000567	海德股份	26,546,141.93	2.25
116	600039	四川路桥	26,480,628.00	2.25
117	600282	南钢股份	26,341,589.00	2.23
118	000598	兴蓉环境	26,134,696.54	2.22
119	601778	晶科科技	26,102,794.72	2.21
120	600875	东方电气	26,067,321.00	2.21
121	688012	中微公司	25,927,918.63	2.20
122	002624	完美世界	25,924,991.70	2.20
123	600188	兖矿能源	25,863,662.54	2.19
124	000728	国元证券	25,799,244.20	2.19
125	300136	信维通信	25,703,981.00	2.18

126	600867	通化东宝	25,583,343.76	2.17
127	688518	联赢激光	25,445,940.65	2.16
128	603379	三美股份	25,421,517.04	2.16
129	600967	内蒙一机	25,421,467.90	2.16
130	603392	万泰生物	25,249,358.62	2.14
131	002301	齐心集团	25,244,933.50	2.14
132	601992	金隅集团	25,156,349.45	2.13
133	002505	鹏都农牧	25,053,323.00	2.12
134	000729	燕京啤酒	24,933,394.00	2.11
135	300696	爱乐达	24,810,700.26	2.10
136	600649	城投控股	24,766,433.01	2.10
137	601098	中南传媒	24,724,372.47	2.10
138	300418	昆仑万维	24,674,608.84	2.09
139	300182	捷成股份	24,673,943.20	2.09
140	600170	上海建工	24,631,907.29	2.09
141	601162	天风证券	24,617,726.66	2.09
142	600643	爱建集团	24,469,527.12	2.08
143	002191	劲嘉股份	24,388,065.16	2.07
144	000301	东方盛虹	24,357,243.48	2.07
145	600529	山东药玻	24,327,089.71	2.06
146	688050	爱博医疗	24,100,485.30	2.04
147	000887	中鼎股份	24,099,779.56	2.04
148	600392	盛和资源	24,078,492.00	2.04
149	600623	华谊集团	23,984,170.96	2.03
150	300001	特锐德	23,909,598.96	2.03
151	601668	中国建筑	23,860,501.00	2.02
152	600873	梅花生物	23,721,406.00	2.01
153	600348	华阳股份	23,701,438.26	2.01

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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	13,086,694,042.93
卖出股票收入（成交）总额	12,957,367,653.12

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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

在股指期货投资上，本基金以套期保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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	5,217,368.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,882,300.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,099,669.74

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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	数 (户)		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	9,067	96,927.34	211,838,197.17	24.10%	667,001,986.38	75.90%
国泰君安中证500指数增强C	6,829	67,742.13	80,837,843.14	17.47%	381,773,189.63	82.53%
合计	15,896	84,389.23	292,676,040.31	21.82%	1,048,775,176.01	78.18%

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	2,404,673.36	0.27%
	国泰君安中证500指数增强C	8,422,832.79	1.82%
	合计	10,827,506.15	0.81%

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	0
	国泰君安中证500指数增强C	>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

## § 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	721,060,040.05	440,886,236.61
本报告期基金总申购份额	275,389,475.92	170,466,405.51
减：本报告期基金总赎回份额	117,609,332.42	148,741,609.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	878,840,183.55	462,611,032.77

## § 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：

2022年1月17日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告》，谢乐斌同志担任公司董事长，江伟同志不再担任公司董事长。

2022年3月12日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于董事会成员变更事宜的公告》，谢乐斌同志担任公司董事和董事长，江伟同志不再担任公司董事和董事长职务。陶耿同志担任公司董事和副董事长；王吉学、刘敬东、韩志达、王新宇同志担任公司董事，蒋忆明、喻健同志不再兼任公司董事职务。经过上述变更，公司现任董事会成员为谢乐斌、陶耿、王吉学、刘敬东、韩志达、王新宇。

2022年3月30日，本基金管理人发布了《关于上海国泰君安证券资产管理有限公司监事变更的公告》，董博阳同志担任公司监事，傅南平同志不再担任公司监事职务；王红莲同志担任公司职工监事。

2022年4月8日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告》，吕巍同志担任公司合规总监、督察长，叶明同志不再担任公司合规总监。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：  
无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

### 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

本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚情况。

### 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	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	佣金	占当期佣金总	

	元数量		交总额的 比例		量的比 例	
国泰君安	2	26,031,832,783.30	100.0 0%	1,683,804.49	100.0 0%	-

### 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	关于调整旗下基金对账单服务规则的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2022-01-19
2	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	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	2022-01-19
3	国泰君安中证500指数增强型证券投资基金开放日常赎回业务的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2022-03-11
4	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于董事会成员变更事宜的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2022-03-12
5	关于上海国泰君安证券资产管理有限公司监事变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2022-03-30
6	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	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	2022-04-08
7	国泰君安中证500指数增强型证券投资基金2022年第一季度报告	证监会指定网站、公司官网	2022-04-22
8	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分公募基金季度报告提示性公告	上海证券报	2022-04-22

### § 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  
二〇二二年八月三十一日