

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

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2023 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月18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2023年01月01日起至2023年06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	7
2.1 基金基本情况	7
2.2 基金产品说明	7
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	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14

§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66
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	66
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	66
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	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	67

§ 8 基金份额持有人信息	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68
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	68
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	69
§ 9 开放式基金份额变动	69
§ 10 重大事件揭示	70
10.1 基金份额持有人大会决议	70
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	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
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	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
10.8 其他重大事件	71
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	
基金简称	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起	
基金主代码	017209	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 11 月 16 日	
基金管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	70,315,734.53 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C
下属分级基金的交易代码	017209	017210
报告期末下属分级基金的份额总额	24,551,253.38 份	45,764,481.15 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于科技创新相关主题的股票，把握中国创新驱动发展的投资机遇，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将综合考虑宏观与微观经济、市场与政策等因素，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。 本基金的投资策略还包括股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、融资策略。
业绩比较基准	中国战略新兴产业综合指数收益率*90%+中债新综合财富(总值)指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责 姓名	吕巍	王小飞

人	联系电话	021-38676022	021-60637103
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95521	021-60637228
传真		021-38871190	021-60635778
注册地址		上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市静安区新闻路 669 号博华 广场 22-23 层及 25 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		陶耿	田国立

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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

§ 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（2023 年 01 月 01 日-2023 年 06 月 30 日）	
	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C
本期已实现收益	1,673,209.58	1,536,183.60
本期利润	1,486,391.34	1,099,919.00
加权平均基金份额本期利润	0.0652	0.0314
本期加权平均净值利润率	6.24%	3.00%
本期基金份额净值增长率	9.74%	9.48%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	1,364,518.09	2,399,690.37
期末可供分配基金份额利润	0.0556	0.0524
期末基金资产净值	25,915,771.47	48,164,171.52
期末基金份额净值	1.0556	1.0524
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	5.56%	5.24%

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

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.82%	1.23%	1.19%	1.03%	0.63%	0.20%
过去三个月	-0.67%	1.20%	-3.21%	0.93%	2.54%	0.27%
过去六个月	9.74%	1.10%	5.76%	0.89%	3.98%	0.21%
自基金合同生效起至今	5.56%	1.08%	-0.48%	0.87%	6.04%	0.21%

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.77%	1.23%	1.19%	1.03%	0.58%	0.20%
过去三个月	-0.80%	1.20%	-3.21%	0.93%	2.41%	0.27%
过去六个月	9.48%	1.10%	5.76%	0.89%	3.72%	0.21%
自基金合同生效起至今	5.24%	1.08%	-0.48%	0.87%	5.72%	0.21%

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

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年11月16日-2023年06月30日)



注：本基金合同生效日为 2022 年 11 月 16 日，截至本报告期末基金合同生效不满一年。

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年11月16日-2023年06月30日)



注：本基金合同生效日为 2022 年 11 月 16 日，截至本报告期末基金合同生效不满一年。

§ 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 2023 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 39 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。现任量化投资部总经理。	2022-11-17	-	12 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士，12 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总经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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 5 次。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

2023 上半年 A 股整体呈现震荡收涨的局面，其中，受益于 AIGC 技术驱动的 TMT 板块显著领涨。风格上来看，小盘风格优于大盘风格，价值风格优于成长风格。上半年受到经济和政策预期不断反复的影响，市场由年初的显著回暖，逐渐演变为对经济复苏强度预期分歧导致的行情震荡。在市场的增量资金没有显著流入的情况下，市场存量博弈特征明显，板块和风格的轮动强度和轮动频率维持在历史高位。

从主要风险因子的走势来看，今年一季度延续了去年的小市值风格，中小盘股表现占优，二季度大小盘股表现较均衡。动量因子在去年四季度开始显著失效，期间股票的反转效应得到强化，然而今年开始动量因子表现有所回升，二季度动量因子持续走强，接近历史平均水平。估值因子在一季度“中国特色估值体系”提出后，表现强势，且走势延续到了二季度。除数字经济等热门主题外，低估值一直是市场的主线，相对而言成长因子和分析师情绪因子持续表现弱势。从 Alpha 大类因子的表现来看，今年高频因子和基本面因子表现都达到了历史平均水平。其中，基本面因子在年报、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，在上半年表现强势。此外，今年一季度市场交投活跃度逐渐提升，二季度市场主题逐渐分散，市场波动率提升，高频因子的拥挤度开始有所缓解，高频因子的有效性有提升。基本面和高频两种策略表现的相关性较低，体现出较好的互补

特征。

本基金聚焦科创板,投资于成长潜力较大的科技新兴产业,挖掘 A 股未来最有潜力的结构性 Beta。以量化的方式,从各个数据维度对科技产业上市公司进行全覆盖,有效挖掘“专精特新”、“小而美”的科技创新企业,发挥量化选股及模型的优势,获取大幅超越科创板主流指数(如科创 50)的收益。同时,本基金参考中证科创信息、中证科创生物、中证科创芯片、中证科创高装、中证科创材料、中证科创新能等指数的行业分布,在高端装备、新材料、新能源以及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业的科技创新企业上进行均衡配置,充分发挥量化投资分散化的优势,降低基金的整体波动。

在选股层面,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。得益于基本面量化和高频量价在信号层面较低的相关性,使得我们有信心在兼顾两者的情况下追求稳健的 Alpha。随着今年在大幅度扩充有效因子库和有针对性改进模型底层逻辑之后,我们坚信模型能以更有效地方式输出稳定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A 基金份额净值为 1.0556 元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为 9.74%,同期业绩比较基准收益率为 5.76%;截至报告期末国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C 基金份额净值为 1.0524 元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为 9.48%,同期业绩比较基准收益率为 5.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计 A 股市场在上半年的冲高回落后,在下半年将有一段缓慢的磨底期,但是整体是呈现震荡向上的态势。政策层面,积极宽松的货币政策和财政政策,以及定向倾斜的产业政策,将稳固房地产市场,修复制造业的企业利润率,带动数字经济、硬科技新兴产业的投资改善,最终提高 A 股市场的盈利水平。宏观层面,美联储的加息周期即将走向尾声,美元指数和美债利率走弱将有利于外资流入 A 股。预期方面,虽然上半年的经济修复不及预期,整体的市场预期较弱估值水平较低,但是在下半年稳就业,扩内需的定调下, A 股整体的信心有望提升。

虽然今年以来,在地缘政治和人民币贬值等因素的影响下, A 股市场的活跃度和投资情绪一般,但是从中长期的角度来看,我们依然坚定地看好科技创新主题未来的走势。首先是最近发售的科创板主题 ETF,使得科创板系列指数产品的持续丰富和扩容,将带给科创板和科技创新相关主题行业带来大量的增量资金,提高相关主题的投资活跃度。其次,在新一轮科技周期之中,科技创新被列入国家战略性地位,已成为驱动经济高质量发展的重要引擎。人工智能、5G、物联网、新材料等新

一代信息技术和相关产业将迎来新一轮的发展机遇。

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约定，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过利润分配。

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

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，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，本基金利润分配情况符合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真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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：国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,987,621.93	1,855,944.19
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	68,320,354.93	17,648,322.41
其中：股票投资		68,320,354.93	17,648,322.41
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		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.3	-	-
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		39.95	9,852.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.4	-	-
资产总计		74,308,016.81	19,514,118.82
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		50,449.73	-
应付管理人报酬		89,497.30	22,844.29
应付托管费		14,916.21	3,807.39
应付销售服务费		19,571.69	2,493.52
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	6.4.7.5	53,638.89	-
负债合计		228,073.82	29,145.20
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	70,315,734.53	20,261,654.91
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	3,764,208.46	-776,681.29
净资产合计		74,079,942.99	19,484,973.62
负债和净资产总计		74,308,016.81	19,514,118.82

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 70,315,734.53 份。其中国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A 基金份额净值 1.0556 元，基金份额总额 24,551,253.38 份；国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C 基金份额净值 1.0524 元，基金份额总额 45,764,481.15 份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
一、营业总收入		3,248,000.36
1. 利息收入		9,171.71
其中：存款利息收入	6.4.7.8	9,171.71
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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,843,815.21
其中：股票投资收益	6.4.7.9	3,526,512.17

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		-
股利收益	6.4.7.10	317,303.04
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）	6.4.7.11	-623,082.84
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	18,096.28
减：二、营业总支出		661,690.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	445,288.44
2. 托管费	6.4.10.2.2	74,214.71
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	89,738.60
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	6.4.7.13	52,448.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,586,310.34
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,586,310.34
五、其他综合收益的税后净额		-

六、综合收益总额		2,586,310.34
----------	--	--------------

注：本基金合同生效日为 2022 年 11 月 16 日，无上年度可比期间。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 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）	20,261,654.91	-	-776,681.29	19,484,973.62
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）	20,261,654.91	-	-776,681.29	19,484,973.62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	50,054,079.62	-	4,540,889.75	54,594,969.37
（一）、综合收益总额	-	-	2,586,310.34	2,586,310.34
（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）	50,054,079.62	-	1,954,579.41	52,008,659.03
其中：1. 基金申购款	54,873,326.06	-	2,207,890.87	57,081,216.93
2. 基金赎回款	-4,819,246.44	-	-253,311.46	-5,072,557.90
（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）	70,315,734.53	-	3,764,208.46	74,079,942.99

注：本基金合同生效日为 2022 年 11 月 16 日，无上年度可比期间。

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

国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人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》、《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合同》及其他有关法律法规的规定,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【2022】2626 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金根据是否收取认购费、申购费和销售服务费,将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 15,009,000.00 份,经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证。《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合同》(以下简称“基金合同”)于 2022 年 11 月 16 日正式生效。本基金的基金管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定,本基金的投资范围包括内地依法发行上市的股票(含主板、创业板及其他依法发行、上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、可转换债券、可交换债券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。

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,本基金可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:

本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%;每个交易日日终,扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券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、存出保证金及应收申购款等;本基金投资于科技创新主题的股票不低于非现金基金资产的 80%。

本基金参与股指期货、国债期货、股票期权交易,应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

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》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 2023 年 01 月 01 日至 2023 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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主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为 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(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业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，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。

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

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利

率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。

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

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《关于固定收益品种的估值处理标准》(中基协字[2022]566号)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

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[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[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。

对基金通过港股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。基金通过港股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。基金通过港股通买卖、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 2023 年 06 月 30 日
活期存款	1,600,649.22
等于: 本金	1,600,482.41
加: 应计利息	166.81
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	4,386,972.71
等于: 本金	4,386,455.00
加: 应计利息	517.71
减: 坏账准备	-
合计	5,987,621.93

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 2023 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	69,089,911.00	-	68,320,354.93	-769,556.07
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	69,089,911.00	-	68,320,354.93	-769,556.07

6.4.7.3 买入返售金融资产

6.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	190.62
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	39,671.58
预提审计费	12,396.69
其他应付	1,380.00
合计	53,638.89

6.4.7.6 实收基金

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	13,793,631.08	13,793,631.08
本期申购	14,808,605.64	14,808,605.64
本期赎回（以“-”号填列）	-4,050,983.34	-4,050,983.34
本期末	24,551,253.38	24,551,253.38

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,468,023.83	6,468,023.83
本期申购	40,064,720.42	40,064,720.42
本期赎回（以“-”号填列）	-768,263.10	-768,263.10
本期末	45,764,481.15	45,764,481.15

注：申购含红利再投、份额转换入、份额升降级等原因导致的份额调增，赎回含份额转换出、份额升降级等原因导致的份额调减。

6.4.7.7 未分配利润

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-375,263.22	-150,889.79	-526,153.01
本期利润	1,673,209.58	-186,818.24	1,486,391.34
本期基金份额交易产生的变动数	139,131.27	265,148.49	404,279.76
其中：基金申购款	420,105.21	201,405.09	621,510.30
基金赎回款	-280,973.94	63,743.40	-217,230.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,437,077.63	-72,559.54	1,364,518.09

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-179,742.17	-70,786.11	-250,528.28
本期利润	1,536,183.60	-436,264.60	1,099,919.00
本期基金份额交易产生的变动数	1,178,744.84	371,554.81	1,550,299.65
其中：基金申购款	1,214,062.27	372,318.30	1,586,380.57
基金赎回款	-35,317.43	-763.49	-36,080.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,535,186.27	-135,495.90	2,399,690.37

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	2,260.63
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	6,911.08
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	9,171.71

6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	687,219,605.72
减：卖出股票成本总额	682,792,646.10
减：交易费用	900,447.45
买卖股票差价收入	3,526,512.17

6.4.7.10 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	317,303.04
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	317,303.04

6.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-623,082.84
——股票投资	-623,082.84
——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	-

——权证投资	-
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	-623,082.84

6.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	18,096.28
合计	18,096.28

6.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	12,396.69
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费	380.00
合计	52,448.27

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	基金管理人

(以下简称“国泰君安资管”)	
中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君安证券”)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 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
国泰君安证券股份有限公司	1,421,307,367.18	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 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
国泰君安证券股份有限公司	101,357.12	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 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	445,288.44

其中：支付销售机构的客户维护费	29,063.34
-----------------	-----------

注：1. 支付基金管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

2. 本基金于 2022 年 11 月 16 日基金合同生效，无上年度同期可比数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	74,214.71

注：1. 支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

2. 本基金于 2022 年 11 月 16 日基金合同生效，无上年度同期可比数据。

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 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		
	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	23,140.36	23,140.36
上海国泰君安证券资产管理有限公司	-	63,804.72	63,804.72
合计	-	86,945.08	86,945.08

注：1. 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%。

C 类基金的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.50% 年费率计提。

计算公式为：C 类基金日销售服务费=C 类基金份额前一日资产净值×0.50%/当年天数。

2. 本基金于 2022 年 11 月 16 日基金合同生效，无上年度同期可比数据。

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A

份额单位：份

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2022 年 11 月 16 日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	10,009,000.00
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	10,009,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	40.77%

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C

份额单位：份

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2022 年 11 月 16 日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	5,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.93%

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,600,649.22	2,260.63
国泰君安证券	4,386,972.71	6,911.08

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

本基金本报告期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

无

6.4.12 期末（2023 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

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

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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中国建设银行股份有限公司，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 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2022 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 2023 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期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等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,987,621.93	-	-	-	5,987,621.93
交易性金融资产	-	-	-	68,320,354.93	68,320,354.93
应收申购款	-	-	-	39.95	39.95
资产总计	5,987,621.93	-	-	68,320,394.88	74,308,016.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	50,449.73	50,449.73
应付管理人报酬	-	-	-	89,497.30	89,497.30

应付托管费	-	-	-	14,916.21	14,916.21
应付销售服务费	-	-	-	19,571.69	19,571.69
其他负债	-	-	-	53,638.89	53,638.89
负债总计	-	-	-	228,073.82	228,073.82
利率敏感度缺口	5,987,621.93	-	-	68,092,321.06	74,079,942.99
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,855,944.19	-	-	-	1,855,944.19
交易性金融资产	-	-	-	17,648,322.41	17,648,322.41
应收申购款	-	-	-	9,852.22	9,852.22
资产总计	1,855,944.19	-	-	17,658,174.63	19,514,118.82
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	22,844.29	22,844.29
应付托管费	-	-	-	3,807.39	3,807.39
应付销售服务费	-	-	-	2,493.52	2,493.52
负债总计	-	-	-	29,145.20	29,145.20
利率敏感度缺口	1,855,944.19	-	-	17,629,029.43	19,484,973.62

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 2023 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% (2022 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 (2022 年 12 月 31 日：同)

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 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	68,320,354.93	92.23	17,648,322.41	90.57
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—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	68,320,354.93	92.23	17,648,322.41	90.57

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2023 年 06 月 30 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	68,320,354.93	17,648,322.41
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	68,320,354.93	17,648,322.41

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	68,320,354.93	91.94
	其中：股票	68,320,354.93	91.94
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	5,987,621.93	8.06
8	其他各项资产	39.95	0.00
9	合计	74,308,016.81	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	666,090.00	0.90
C	制造业	55,261,383.72	74.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	40,495.00	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,099,712.33	13.63
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,464,459.88	1.98
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	788,214.00	1.06
S	综合	-	-
	合计	68,320,354.93	92.23

7.2.2 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	688012	中微公司	21,883	3,423,595.35	4.62
2	688981	中芯国际	46,946	2,371,711.92	3.20
3	688126	沪硅产业	107,233	2,241,169.70	3.03
4	688111	金山办公	3,680	1,737,769.60	2.35
5	688208	道通科技	46,722	1,416,143.82	1.91
6	688002	睿创微纳	31,449	1,408,915.20	1.90
7	688006	杭可科技	44,200	1,346,774.00	1.82
8	688029	南微医学	16,087	1,312,055.72	1.77
9	688173	希荻微	55,235	1,263,776.80	1.71
10	688008	澜起科技	19,730	1,132,896.60	1.53
11	600050	中国联通	226,500	1,087,200.00	1.47
12	688599	天合光能	24,400	1,039,684.00	1.40
13	000997	新大陆	54,200	1,024,380.00	1.38
14	300759	康龙化成	26,700	1,022,076.00	1.38
15	688425	铁建重工	211,600	1,017,796.00	1.37
16	600031	三一重工	61,100	1,016,093.00	1.37
17	603567	珍宝岛	67,800	1,014,288.00	1.37
18	688082	盛美上海	9,100	1,004,640.00	1.36
19	688019	安集科技	5,882	969,530.06	1.31
20	688138	清溢光电	45,542	961,391.62	1.30
21	688150	莱特光电	42,318	947,923.20	1.28
22	688234	天岳先进	12,381	915,451.14	1.24
23	600329	达仁堂	18,300	821,487.00	1.11
24	300014	亿纬锂能	13,400	810,700.00	1.09
25	688009	中国通号	139,100	806,780.00	1.09
26	688711	宏微科技	13,808	805,558.72	1.09
27	688357	建龙微纳	12,416	803,191.04	1.08
28	688223	晶科能源	55,600	781,736.00	1.06
29	003022	联泓新科	30,700	764,430.00	1.03
30	688318	财富趋势	7,433	743,077.01	1.00
31	688063	派能科技	3,659	725,396.75	0.98
32	688187	时代电气	17,014	712,206.04	0.96
33	688088	虹软科技	16,508	705,717.00	0.95
34	603218	日月股份	36,000	683,640.00	0.92
35	300232	洲明科技	74,600	681,844.00	0.92
36	688533	上声电子	14,467	676,042.91	0.91
37	300319	麦捷科技	75,600	647,136.00	0.87
38	600583	海油工程	107,000	625,950.00	0.84

39	002179	中航光电	13,600	616,760.00	0.83
40	688072	拓荆科技	1,439	612,970.83	0.83
41	002384	东山精密	23,500	608,650.00	0.82
42	688510	航亚科技	30,514	606,923.46	0.82
43	603328	依顿电子	71,800	594,504.00	0.80
44	002531	天顺风能	39,000	593,970.00	0.80
45	688139	海尔生物	11,350	584,184.50	0.79
46	600373	中文传媒	42,700	568,764.00	0.77
47	300638	广和通	25,000	567,000.00	0.77
48	688037	芯源微	3,313	566,357.35	0.76
49	688468	科美诊断	58,400	554,800.00	0.75
50	603228	景旺电子	20,900	536,085.00	0.72
51	688390	固德威	3,139	523,773.54	0.71
52	003029	吉大正元	14,800	480,260.00	0.65
53	688639	华恒生物	5,200	470,496.00	0.64
54	600862	中航高科	18,500	468,235.00	0.63
55	688676	金盘科技	15,405	466,617.45	0.63
56	002913	奥士康	12,100	461,978.00	0.62
57	600418	江淮汽车	35,200	443,168.00	0.60
58	000738	航发控制	17,800	434,320.00	0.59
59	688032	禾迈股份	1,200	426,180.00	0.58
60	601600	中国铝业	76,300	418,887.00	0.57
61	000999	华润三九	6,700	406,422.00	0.55
62	002600	领益智造	58,200	402,162.00	0.54
63	600728	佳都科技	56,800	393,624.00	0.53
64	002632	道明光学	54,000	393,120.00	0.53
65	688018	乐鑫科技	3,000	389,460.00	0.53
66	002273	水晶光电	32,200	384,468.00	0.52
67	300672	国科微	4,600	383,410.00	0.52
68	688368	晶丰明源	3,012	383,156.52	0.52
69	000045	深纺织 A	34,700	381,700.00	0.52
70	300872	天阳科技	24,200	376,068.00	0.51
71	688036	传音控股	2,542	373,674.00	0.50
72	688389	普门科技	15,583	366,044.67	0.49
73	600760	中航沈飞	8,000	360,000.00	0.49
74	300433	蓝思科技	30,000	352,800.00	0.48
75	603508	思维列控	20,500	349,525.00	0.47
76	688383	新益昌	2,500	348,050.00	0.47
77	603309	维力医疗	21,500	332,605.00	0.45
78	002056	横店东磁	17,500	318,675.00	0.43
79	000625	长安汽车	24,500	316,785.00	0.43
80	688188	柏楚电子	1,654	311,878.24	0.42
81	688722	同益中	15,941	295,546.14	0.40

82	000739	普洛药业	16,600	294,484.00	0.40
83	603283	赛腾股份	6,300	280,350.00	0.38
84	002335	科华数据	7,700	276,815.00	0.37
85	002745	木林森	29,700	273,240.00	0.37
86	688112	鼎阳科技	5,100	269,178.00	0.36
87	002559	亚威股份	29,700	263,736.00	0.36
88	688248	南网科技	6,464	248,152.96	0.33
89	688378	奥来德	5,000	247,000.00	0.33
90	688408	中信博	2,919	246,159.27	0.33
91	002739	万达电影	17,500	219,450.00	0.30
92	002915	中欣氟材	12,900	215,559.00	0.29
93	600535	天士力	14,700	213,297.00	0.29
94	688526	科前生物	8,837	210,232.23	0.28
95	600183	生益科技	13,600	193,120.00	0.26
96	300775	三角防务	5,600	189,168.00	0.26
97	600498	烽火通信	9,100	185,367.00	0.25
98	688588	凌志软件	11,700	181,935.00	0.25
99	600570	恒生电子	4,100	181,589.00	0.25
100	300316	晶盛机电	2,500	177,250.00	0.24
101	300735	光弘科技	16,300	174,410.00	0.24
102	688207	格灵深瞳	6,945	172,930.50	0.23
103	300383	光环新网	14,600	156,950.00	0.21
104	603989	艾华集团	7,400	155,844.00	0.21
105	688608	恒玄科技	1,237	149,714.11	0.20
106	600271	航天信息	10,600	145,114.00	0.20
107	002108	沧州明珠	31,906	144,534.18	0.20
108	002025	航天电器	2,200	140,360.00	0.19
109	002449	国星光电	15,600	138,684.00	0.19
110	000919	金陵药业	16,800	131,376.00	0.18
111	002649	博彦科技	8,500	120,105.00	0.16
112	002351	漫步者	5,500	113,740.00	0.15
113	301257	普蕊斯	1,800	101,160.00	0.14
114	002236	大华股份	5,000	98,750.00	0.13
115	601766	中国中车	14,600	94,900.00	0.13
116	300194	福安药业	23,900	92,732.00	0.13
117	002967	广电计量	4,600	92,414.00	0.12
118	688052	纳芯微	580	91,854.60	0.12
119	688569	铁科轨道	2,100	88,347.00	0.12
120	002912	中新赛克	1,900	83,619.00	0.11
121	300443	金雷股份	2,300	81,535.00	0.11
122	688185	康希诺	1,000	81,500.00	0.11
123	688358	祥生医疗	1,500	76,500.00	0.10
124	603383	顶点软件	1,200	66,504.00	0.09

125	688777	中控技术	1,000	62,780.00	0.08
126	600267	海正药业	4,900	55,762.00	0.08
127	688183	生益电子	4,498	54,425.80	0.07
128	688521	芯原股份	700	50,344.00	0.07
129	688518	联赢激光	1,800	50,148.00	0.07
130	601619	嘉泽新能	8,900	40,495.00	0.05
131	601958	金钼股份	3,600	40,140.00	0.05
132	688083	中望软件	143	20,719.27	0.03
133	688048	长光华芯	144	13,610.88	0.02
134	688332	中科蓝讯	135	11,296.80	0.02
135	688359	三孚新科	112	8,288.00	0.01
136	688107	安路科技	149	8,253.11	0.01
137	688551	科威尔	123	8,066.34	0.01
138	688508	芯朋微	128	7,422.72	0.01
139	688261	东微半导	48	6,713.76	0.01
140	688786	悦安新材	102	4,731.78	0.01
141	688305	科德数控	47	4,712.22	0.01
142	688167	炬光科技	28	3,011.40	0.00
143	688331	荣昌生物	50	2,787.50	0.00
144	688561	奇安信	41	2,124.21	0.00
145	000538	云南白药	40	2,099.20	0.00
146	688579	山大地纬	107	1,763.36	0.00
147	300768	迪普科技	100	1,657.00	0.00
148	688225	亚信安全	50	1,047.50	0.00
149	688337	普源精电	12	723.12	0.00
150	688320	禾川科技	14	675.08	0.00
151	688179	阿拉丁	22	656.92	0.00
152	688626	翔宇医疗	14	637.14	0.00
153	300246	宝莱特	50	622.50	0.00
154	688020	方邦股份	10	499.70	0.00
155	688586	江航装备	17	236.47	0.00
156	600562	国睿科技	2	32.40	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	688981	中芯国际	12,261,965.07	62.93
2	688111	金山办公	10,864,751.37	55.76
3	688012	中微公司	9,066,239.76	46.53

4	688126	沪硅产业	8,501,529.27	43.63
5	688599	天合光能	7,361,607.83	37.78
6	688072	拓荆科技	6,207,503.54	31.86
7	688396	华润微	6,059,033.44	31.10
8	688223	晶科能源	5,841,414.48	29.98
9	688390	固德威	5,781,724.58	29.67
10	688120	华海清科	5,522,988.33	28.34
11	688107	安路科技	5,408,176.69	27.76
12	688009	中国通号	4,951,029.75	25.41
13	688578	艾力斯	4,887,752.30	25.08
14	688008	澜起科技	4,866,505.47	24.98
15	688318	财富趋势	4,825,190.93	24.76
16	688036	传音控股	4,749,773.94	24.38
17	688029	南微医学	4,698,055.41	24.11
18	688063	派能科技	4,634,879.11	23.79
19	688819	天能股份	4,538,941.18	23.29
20	688002	睿创微纳	4,417,240.78	22.67
21	688082	盛美上海	4,319,696.49	22.17
22	688408	中信博	4,129,823.97	21.19
23	688123	聚辰股份	4,043,536.09	20.75
24	688187	时代电气	3,985,774.29	20.46
25	600050	中国联通	3,945,588.00	20.25
26	688559	海目星	3,915,489.67	20.09
27	688006	杭可科技	3,873,957.84	19.88
28	688037	芯源微	3,725,959.50	19.12
29	688509	正元地信	3,672,866.09	18.85
30	688676	金盘科技	3,672,077.40	18.85
31	688375	国博电子	3,655,004.32	18.76
32	000739	普洛药业	3,507,691.00	18.00
33	688208	道通科技	3,499,150.80	17.96
34	688169	石头科技	3,488,012.09	17.90
35	688596	正帆科技	3,413,438.52	17.52
36	688772	珠海冠宇	3,393,403.62	17.42
37	688295	中复神鹰	3,390,888.40	17.40
38	688138	清溢光电	3,354,091.70	17.21
39	688363	华熙生物	3,327,170.62	17.08
40	688088	虹软科技	3,300,831.53	16.94
41	688326	经纬恒润	3,295,339.34	16.91
42	688007	光峰科技	3,271,629.03	16.79
43	688425	铁建重工	3,217,729.13	16.51
44	688148	芳源股份	3,197,591.92	16.41
45	002475	立讯精密	3,185,323.00	16.35
46	600373	中文传媒	3,174,719.45	16.29

47	002600	领益智造	3,159,379.00	16.21
48	603118	共进股份	3,131,736.64	16.07
49	688122	西部超导	3,114,877.47	15.99
50	002463	沪电股份	3,111,769.00	15.97
51	688579	山大地纬	3,080,127.81	15.81
52	688630	芯碁微装	3,059,270.27	15.70
53	688439	振华风光	2,978,027.55	15.28
54	688588	凌志软件	2,977,204.15	15.28
55	002056	横店东磁	2,974,496.00	15.27
56	688468	科美诊断	2,926,735.08	15.02
57	688707	振华新材	2,916,939.25	14.97
58	000063	中兴通讯	2,889,487.00	14.83
59	688139	海尔生物	2,875,710.81	14.76
60	688566	吉贝尔	2,872,863.17	14.74
61	688032	禾迈股份	2,848,358.33	14.62
62	688195	腾景科技	2,840,512.83	14.58
63	688526	科前生物	2,781,632.94	14.28
64	688778	厦钨新能	2,755,159.62	14.14
65	603228	景旺电子	2,739,857.52	14.06
66	002916	深南电路	2,723,786.00	13.98
67	688711	宏微科技	2,721,851.53	13.97
68	600498	烽火通信	2,626,378.00	13.48
69	601567	三星医疗	2,592,761.00	13.31
70	600570	恒生电子	2,590,844.00	13.30
71	688248	南网科技	2,589,852.94	13.29
72	688162	巨一科技	2,534,023.92	13.01
73	300433	蓝思科技	2,524,621.00	12.96
74	688173	希荻微	2,517,325.98	12.92
75	002384	东山精密	2,507,447.00	12.87
76	000045	深纺织 A	2,492,094.00	12.79
77	688678	福立旺	2,482,792.50	12.74
78	601231	环旭电子	2,474,310.00	12.70
79	688777	中控技术	2,465,679.81	12.65
80	688385	复旦微电	2,407,249.40	12.35
81	002459	晶澳科技	2,398,699.80	12.31
82	002739	万达电影	2,398,217.00	12.31
83	600583	海油工程	2,376,197.00	12.20
84	002635	安洁科技	2,355,308.00	12.09
85	000100	TCL 科技	2,350,667.00	12.06
86	688722	同益中	2,348,294.94	12.05
87	600458	时代新材	2,336,608.00	11.99
88	300033	同花顺	2,333,524.00	11.98
89	002273	水晶光电	2,322,172.00	11.92

90	688106	金宏气体	2,288,491.26	11.74
91	688150	莱特光电	2,261,588.47	11.61
92	002027	分众传媒	2,255,861.00	11.58
93	688127	蓝特光学	2,182,646.67	11.20
94	688179	阿拉丁	2,177,762.12	11.18
95	688267	中触媒	2,166,719.93	11.12
96	688556	高测股份	2,151,209.97	11.04
97	300759	康龙化成	2,145,935.00	11.01
98	603613	国联股份	2,144,106.00	11.00
99	600862	中航高科	2,131,159.00	10.94
100	300319	麦捷科技	2,127,930.00	10.92
101	688349	三一重能	2,123,202.80	10.90
102	688589	力合微	2,105,475.57	10.81
103	002322	理工能科	2,095,519.00	10.75
104	688234	天岳先进	2,059,808.82	10.57
105	688225	亚信安全	2,046,751.79	10.50
106	002632	道明光学	2,045,492.00	10.50
107	002938	鹏鼎控股	2,017,997.72	10.36
108	688259	创耀科技	2,009,988.84	10.32
109	688516	奥特维	1,996,983.93	10.25
110	600267	海正药业	1,988,850.00	10.21
111	300274	阳光电源	1,977,154.00	10.15
112	603444	吉比特	1,965,408.00	10.09
113	600789	鲁抗医药	1,932,361.00	9.92
114	603328	依顿电子	1,926,459.00	9.89
115	600500	中化国际	1,926,299.00	9.89
116	601100	恒立液压	1,919,622.00	9.85
117	603218	日月股份	1,912,116.00	9.81
118	688357	建龙微纳	1,906,405.95	9.78
119	600038	中直股份	1,898,306.00	9.74
120	600183	生益科技	1,891,887.00	9.71
121	601600	中国铝业	1,871,609.00	9.61
122	600572	康恩贝	1,860,590.00	9.55
123	300454	深信服	1,857,374.00	9.53
124	688519	南亚新材	1,855,863.13	9.52
125	300782	卓胜微	1,849,954.00	9.49
126	000597	东北制药	1,844,978.76	9.47
127	688508	芯朋微	1,826,477.65	9.37
128	688348	昱能科技	1,825,172.00	9.37
129	300750	宁德时代	1,815,730.00	9.32
130	603567	珍宝岛	1,799,843.00	9.24
131	688207	格灵深瞳	1,766,396.78	9.07
132	688052	纳芯微	1,762,569.74	9.05

133	688779	长远锂科	1,759,729.64	9.03
134	688196	卓越新能	1,727,041.64	8.86
135	300408	三环集团	1,726,817.00	8.86
136	601766	中国中车	1,702,897.00	8.74
137	688019	安集科技	1,700,596.39	8.73
138	000725	京东方 A	1,695,470.00	8.70
139	600316	洪都航空	1,688,787.00	8.67
140	688739	成大生物	1,688,421.79	8.67
141	688212	澳华内镜	1,684,783.48	8.65
142	600271	航天信息	1,682,033.00	8.63
143	688569	铁科轨道	1,668,909.59	8.57
144	600211	西藏药业	1,647,092.00	8.45
145	002555	三七互娱	1,601,409.00	8.22
146	603338	浙江鼎力	1,583,237.00	8.13
147	600114	东睦股份	1,569,153.00	8.05
148	601958	金铂股份	1,560,148.00	8.01
149	688079	美迪凯	1,557,560.70	7.99
150	002421	达实智能	1,556,010.00	7.99
151	300510	金冠股份	1,528,299.20	7.84
152	002111	威海广泰	1,519,951.00	7.80
153	688023	安恒信息	1,506,201.18	7.73
154	688135	利扬芯片	1,495,609.68	7.68
155	688400	凌云光	1,492,459.54	7.66
156	688668	鼎通科技	1,488,224.95	7.64
157	688128	中国电研	1,488,066.25	7.64
158	300602	飞荣达	1,473,917.00	7.56
159	600588	用友网络	1,462,055.30	7.50
160	688561	奇安信	1,461,915.73	7.50
161	688388	嘉元科技	1,457,975.80	7.48
162	002236	大华股份	1,457,816.00	7.48
163	002266	浙富控股	1,457,363.00	7.48
164	300101	振芯科技	1,455,292.00	7.47
165	000997	新大陆	1,443,711.00	7.41
166	688366	昊海生科	1,440,643.80	7.39
167	000999	华润三九	1,429,185.00	7.33
168	688510	航亚科技	1,427,973.88	7.33
169	688686	奥普特	1,426,032.00	7.32
170	688621	阳光诺和	1,423,245.77	7.30
171	688261	东微半导	1,414,118.86	7.26
172	002410	广联达	1,412,319.00	7.25
173	688799	华纳药厂	1,409,472.22	7.23
174	300232	洲明科技	1,404,174.00	7.21
175	002129	TCL 中环	1,394,860.26	7.16

176	688271	联影医疗	1,376,962.89	7.07
177	300724	捷佳伟创	1,347,468.00	6.92
178	600797	浙大网新	1,333,866.00	6.85
179	688226	威腾电气	1,333,284.57	6.84
180	688010	福光股份	1,332,575.78	6.84
181	002130	沃尔核材	1,329,197.00	6.82
182	688020	方邦股份	1,325,097.07	6.80
183	003029	吉大正元	1,317,415.00	6.76
184	601989	中国重工	1,315,212.00	6.75
185	002252	上海莱士	1,309,518.00	6.72
186	000963	华东医药	1,308,551.00	6.72
187	600685	中船防务	1,307,978.00	6.71
188	300194	福安药业	1,306,714.00	6.71
189	601616	广电电气	1,303,002.00	6.69
190	600161	天坛生物	1,284,500.40	6.59
191	601137	博威合金	1,269,182.00	6.51
192	601126	四方股份	1,261,945.00	6.48
193	603508	思维列控	1,254,192.20	6.44
194	688399	硕世生物	1,246,986.74	6.40
195	688617	惠泰医疗	1,238,970.50	6.36
196	002007	华兰生物	1,229,923.00	6.31
197	300679	电连技术	1,226,786.00	6.30
198	688206	概伦电子	1,225,740.57	6.29
199	688168	安博通	1,224,688.84	6.29
200	688188	柏楚电子	1,222,655.68	6.27
201	600535	天士力	1,222,309.00	6.27
202	688078	龙软科技	1,221,592.95	6.27
203	002519	银河电子	1,219,739.00	6.26
204	003022	联泓新科	1,218,981.00	6.26
205	688071	华依科技	1,215,046.24	6.24
206	601985	中国核电	1,212,609.94	6.22
207	300751	迈为股份	1,205,780.00	6.19
208	300377	赢时胜	1,203,707.00	6.18
209	688068	热景生物	1,197,435.59	6.15
210	688046	药康生物	1,195,790.89	6.14
211	688041	海光信息	1,176,932.37	6.04
212	603421	鼎信通讯	1,175,522.00	6.03
213	688005	容百科技	1,175,168.72	6.03
214	000973	佛塑科技	1,174,807.00	6.03
215	600728	佳都科技	1,173,596.00	6.02
216	601908	京运通	1,151,356.00	5.91
217	688505	复旦张江	1,149,111.26	5.90
218	600756	浪潮软件	1,148,284.00	5.89

219	300241	瑞丰光电	1,146,342.00	5.88
220	688258	卓易信息	1,139,429.42	5.85
221	300207	欣旺达	1,130,634.00	5.80
222	002990	盛视科技	1,123,320.00	5.77
223	600196	复星医药	1,109,258.00	5.69
224	002841	视源股份	1,102,646.00	5.66
225	601012	隆基绿能	1,096,958.00	5.63
226	600031	三一重工	1,093,418.00	5.61
227	002389	航天彩虹	1,091,957.00	5.60
228	002351	漫步者	1,081,415.00	5.55
229	002601	龙佰集团	1,075,705.00	5.52
230	600105	永鼎股份	1,074,501.00	5.51
231	688049	炬芯科技	1,072,738.40	5.51
232	688202	美迪西	1,068,964.93	5.49
233	300248	新开普	1,060,099.00	5.44
234	688613	奥精医疗	1,053,452.10	5.41
235	688800	瑞可达	1,052,665.56	5.40
236	688639	华恒生物	1,048,434.35	5.38
237	688210	统联精密	1,047,010.14	5.37
238	600613	神奇制药	1,031,852.00	5.30
239	300768	迪普科技	1,031,211.00	5.29
240	603806	福斯特	1,030,029.00	5.29
241	688586	江航装备	1,024,574.94	5.26
242	688332	中科蓝讯	1,009,563.53	5.18
243	600745	闻泰科技	1,007,154.00	5.17
244	300014	亿纬锂能	1,005,000.00	5.16
245	000738	航发控制	1,001,222.00	5.14
246	688521	芯原股份	999,053.47	5.13
247	002544	普天科技	993,661.00	5.10
248	000920	沃顿科技	991,496.00	5.09
249	688091	上海谊众	991,113.63	5.09
250	002669	康达新材	988,815.00	5.07
251	688183	生益电子	987,098.79	5.07
252	603989	艾华集团	986,601.00	5.06
253	601369	陕鼓动力	984,994.00	5.06
254	600537	亿晶光电	982,451.00	5.04
255	688609	九联科技	975,797.00	5.01
256	002017	东信和平	974,978.00	5.00
257	688246	嘉和美康	967,150.66	4.96
258	688167	炬光科技	946,971.15	4.86
259	688256	寒武纪	941,695.00	4.83
260	300763	锦浪科技	938,856.00	4.82
261	600851	海欣股份	931,757.00	4.78

262	688166	博瑞医药	924,739.23	4.75
263	300976	达瑞电子	923,079.00	4.74
264	002073	软控股份	920,157.00	4.72
265	002324	普利特	918,813.00	4.72
266	002139	拓邦股份	909,081.00	4.67
267	603383	顶点软件	901,649.00	4.63
268	688575	亚辉龙	895,793.00	4.60
269	002036	联创电子	894,798.00	4.59
270	002912	中新赛克	883,837.00	4.54
271	688329	艾隆科技	883,040.32	4.53
272	300378	鼎捷软件	879,889.00	4.52
273	000423	东阿阿胶	879,282.00	4.51
274	688658	悦康药业	872,787.90	4.48
275	000823	超声电子	867,692.00	4.45
276	688359	三孚新科	867,500.72	4.45
277	002107	沃华医药	866,733.00	4.45
278	688677	海泰新光	865,756.85	4.44
279	688083	中望软件	849,201.48	4.36
280	600380	健康元	832,123.00	4.27
281	002915	中欣氟材	831,485.00	4.27
282	600329	达仁堂	829,588.00	4.26
283	688076	诺泰生物	823,008.00	4.22
284	688718	唯赛勃	821,283.56	4.21
285	301257	普蕊斯	820,074.00	4.21
286	300803	指南针	810,744.00	4.16
287	688626	翔宇医疗	809,862.14	4.16
288	002136	安纳达	802,207.00	4.12
289	688331	荣昌生物	801,371.20	4.11
290	688112	鼎阳科技	800,204.00	4.11
291	688299	长阳科技	799,976.00	4.11
292	688608	恒玄科技	796,786.14	4.09
293	002465	海格通信	796,335.00	4.09
294	002484	江海股份	792,018.00	4.06
295	688289	圣湘生物	791,288.97	4.06
296	300230	永利股份	790,959.00	4.06
297	688533	上声电子	789,923.07	4.05
298	603283	赛腾股份	784,708.00	4.03
299	688018	乐鑫科技	779,948.16	4.00
300	002179	中航光电	778,286.00	3.99
301	000962	东方钨业	772,735.00	3.97
302	688389	普门科技	770,675.23	3.96
303	000768	中航西飞	770,438.00	3.95
304	688093	世华科技	761,565.12	3.91

305	688200	华峰测控	760,040.00	3.90
306	688337	普源精电	759,176.56	3.90
307	000066	中国长城	753,784.00	3.87
308	600732	爱旭股份	749,979.00	3.85
309	688100	威胜信息	745,859.07	3.83
310	600237	铜峰电子	743,811.00	3.82
311	688185	康希诺	741,287.43	3.80
312	300183	东软载波	741,275.10	3.80
313	688598	金博股份	741,135.60	3.80
314	688317	之江生物	735,423.44	3.77
315	002446	盛路通信	735,257.00	3.77
316	002644	佛慈制药	729,643.00	3.74
317	300777	中简科技	714,542.00	3.67
318	688383	新益昌	710,484.00	3.65
319	688798	艾为电子	707,420.00	3.63
320	002449	国星光电	707,343.00	3.63
321	002594	比亚迪	703,641.00	3.61
322	688336	三生国健	700,583.35	3.60
323	603259	药明康德	700,175.00	3.59
324	300115	长盈精密	698,131.00	3.58
325	688369	致远互联	693,968.00	3.56
326	300316	晶盛机电	684,616.00	3.51
327	000050	深天马 A	681,633.00	3.50
328	688232	新点软件	680,310.00	3.49
329	000682	东方电子	678,245.00	3.48
330	300667	必创科技	676,864.00	3.47
331	300059	东方财富	674,293.00	3.46
332	600479	千金药业	673,531.00	3.46
333	688551	科威尔	667,618.64	3.43
334	688222	成都先导	664,198.17	3.41
335	688320	禾川科技	660,809.85	3.39
336	688198	佰仁医疗	654,745.63	3.36
337	600309	万华化学	645,451.00	3.31
338	300532	今天国际	641,798.00	3.29
339	600763	通策医疗	635,913.00	3.26
340	300638	广和通	634,613.00	3.26
341	600363	联创光电	632,744.00	3.25
342	688321	微芯生物	629,504.21	3.23
343	300842	帝科股份	623,046.00	3.20
344	600645	中源协和	622,234.00	3.19
345	600562	国睿科技	622,191.00	3.19
346	688048	长光华芯	619,069.39	3.18
347	600707	彩虹股份	618,920.00	3.18

348	688066	航天宏图	615,797.86	3.16
349	300308	中际旭创	612,395.00	3.14
350	688219	会通股份	606,551.05	3.11
351	688301	奕瑞科技	605,756.00	3.11
352	002531	天顺风能	603,009.00	3.09
353	688368	晶丰明源	598,971.00	3.07
354	688157	松井股份	592,102.12	3.04
355	300206	理邦仪器	590,496.00	3.03
356	600062	华润双鹤	582,528.00	2.99
357	688016	心脉医疗	581,309.00	2.98
358	688499	利元亨	579,581.64	2.97
359	600351	亚宝药业	579,096.00	2.97
360	300127	银河磁体	577,917.00	2.97
361	688022	瀚川智能	575,231.00	2.95
362	688189	南新制药	572,302.84	2.94
363	300098	高新兴	572,054.00	2.94
364	600085	同仁堂	570,210.00	2.93
365	603533	掌阅科技	567,810.00	2.91
366	002970	锐明技术	564,970.00	2.90
367	300017	网宿科技	563,821.00	2.89
368	000875	吉电股份	563,218.00	2.89
369	601619	嘉泽新能	554,042.00	2.84
370	300719	安达维尔	552,485.00	2.84
371	688055	龙腾光电	536,069.00	2.75
372	002913	奥士康	535,889.00	2.75
373	002038	双鹭药业	533,161.00	2.74
374	002559	亚威股份	531,291.00	2.73
375	000055	方大集团	530,157.00	2.72
376	000551	创元科技	526,131.00	2.70
377	300347	泰格医药	525,790.00	2.70
378	000661	长春高新	523,326.00	2.69
379	600775	南京熊猫	522,905.00	2.68
380	600580	卧龙电驱	520,429.00	2.67
381	300578	会畅通讯	517,091.00	2.65
382	603236	移远通信	516,829.00	2.65
383	003021	兆威机电	502,176.00	2.58
384	688003	天准科技	499,246.76	2.56
385	688300	联瑞新材	497,265.00	2.55
386	300020	银江技术	496,483.00	2.55
387	603663	三祥新材	494,333.00	2.54
388	688381	帝奥微	493,865.41	2.53
389	301123	奕东电子	493,705.00	2.53
390	300246	宝莱特	488,561.00	2.51

391	000538	云南白药	483,208.00	2.48
392	002649	博彦科技	482,821.00	2.48
393	300035	中科电气	482,041.41	2.47
394	300150	世纪瑞尔	480,186.00	2.46
395	688121	卓然股份	479,117.52	2.46
396	600850	电科数字	475,576.00	2.44
397	002376	新北洋	475,095.00	2.44
398	688025	杰普特	471,122.00	2.42
399	601208	东材科技	466,532.00	2.39
400	688238	和元生物	466,518.00	2.39
401	688190	云路股份	462,319.18	2.37
402	300735	光弘科技	461,385.00	2.37
403	300133	华策影视	458,592.00	2.35
404	688518	联赢激光	452,540.98	2.32
405	601016	节能风电	451,385.69	2.32
406	300383	光环新网	450,922.00	2.31
407	688131	皓元医药	448,251.47	2.30
408	688161	威高骨科	446,812.78	2.29
409	002335	科华数据	445,022.00	2.28
410	600973	宝胜股份	444,200.00	2.28
411	600418	江淮汽车	438,264.00	2.25
412	300413	芒果超媒	438,197.00	2.25
413	688228	开普云	438,137.80	2.25
414	688378	奥来德	437,886.52	2.25
415	688152	麒麟信安	437,702.00	2.25
416	600475	华光环能	437,597.00	2.25
417	600468	百利电气	435,965.00	2.24
418	600410	华胜天成	433,371.00	2.22
419	300448	浩云科技	432,843.00	2.22
420	688262	国芯科技	432,671.16	2.22
421	688227	品高股份	430,762.00	2.21
422	688099	晶晨股份	423,758.00	2.17
423	603920	世运电路	423,660.00	2.17
424	601218	吉鑫科技	422,652.00	2.17
425	688186	广大特材	420,784.00	2.16
426	688287	观典防务	419,674.03	2.15
427	300314	戴维医疗	419,314.00	2.15
428	002533	金杯电工	418,610.00	2.15
429	002298	中电兴发	418,199.00	2.15
430	688585	上纬新材	416,338.00	2.14
431	300259	新天科技	406,380.00	2.09
432	300872	天阳科技	398,312.17	2.04
433	300219	鸿利智汇	398,155.00	2.04

434	688305	科德数控	397,585.96	2.04
435	300078	思创医惠	396,372.00	2.03
436	688239	航宇科技	394,977.00	2.03

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	688111	金山办公	10,681,148.77	54.82
2	688981	中芯国际	10,091,396.84	51.79
3	688599	天合光能	7,342,083.23	37.68
4	688126	沪硅产业	6,429,986.91	33.00
5	688072	拓荆科技	6,302,447.19	32.35
6	688012	中微公司	6,104,981.48	31.33
7	688396	华润微	6,060,510.16	31.10
8	688390	固德威	6,057,330.02	31.09
9	688120	华海清科	5,872,271.96	30.14
10	688223	晶科能源	5,742,434.36	29.47
11	688578	艾力斯	5,186,245.16	26.62
12	688107	安路科技	5,025,778.48	25.79
13	688036	传音控股	4,828,721.61	24.78
14	688819	天能股份	4,733,714.00	24.29
15	688009	中国通号	4,467,450.60	22.93
16	688318	财富趋势	4,452,603.06	22.85
17	688063	派能科技	4,422,342.59	22.70
18	688559	海目星	4,185,761.86	21.48
19	688122	西部超导	4,022,216.95	20.64
20	688123	聚辰股份	3,992,418.33	20.49
21	688408	中信博	3,954,976.93	20.30
22	688509	正元地信	3,689,662.43	18.94
23	688008	澜起科技	3,649,204.94	18.73
24	688037	芯源微	3,633,984.95	18.65
25	688029	南微医学	3,481,075.27	17.87
26	688596	正帆科技	3,477,031.86	17.84
27	688375	国博电子	3,474,601.42	17.83
28	688295	中复神鹰	3,449,431.43	17.70
29	688169	石头科技	3,395,115.72	17.42
30	688082	盛美上海	3,359,462.67	17.24
31	688148	芳源股份	3,357,385.38	17.23
32	688676	金盘科技	3,351,639.58	17.20

33	688007	光峰科技	3,323,054.89	17.05
34	002463	沪电股份	3,321,238.80	17.05
35	002475	立讯精密	3,284,318.00	16.86
36	688326	经纬恒润	3,281,860.40	16.84
37	688187	时代电气	3,255,171.69	16.71
38	688772	珠海冠宇	3,249,014.54	16.67
39	000063	中兴通讯	3,224,606.00	16.55
40	000739	普洛药业	3,161,840.00	16.23
41	688579	山大地纬	3,158,672.54	16.21
42	688363	华熙生物	3,150,494.50	16.17
43	002600	领益智造	3,138,416.00	16.11
44	688630	芯碁微装	3,130,961.70	16.07
45	688707	振华新材	3,105,275.85	15.94
46	688566	吉贝尔	3,054,964.57	15.68
47	688439	振华风光	3,044,195.00	15.62
48	688195	腾景科技	3,012,886.09	15.46
49	688002	睿创微纳	3,012,208.27	15.46
50	688588	凌志软件	3,005,156.97	15.42
51	603118	共进股份	2,983,753.00	15.31
52	600050	中国联通	2,896,238.03	14.86
53	688468	科美诊断	2,799,643.53	14.37
54	600373	中文传媒	2,798,529.60	14.36
55	688556	高测股份	2,790,644.95	14.32
56	688778	厦钨新能	2,708,814.06	13.90
57	601567	三星医疗	2,707,527.00	13.90
58	002916	深南电路	2,667,795.00	13.69
59	002056	横店东磁	2,658,741.00	13.65
60	601231	环旭电子	2,619,754.00	13.44
61	688088	虹软科技	2,614,969.43	13.42
62	688006	杭可科技	2,603,304.46	13.36
63	600498	烽火通信	2,578,946.00	13.24
64	300033	同花顺	2,577,901.00	13.23
65	688138	清溢光电	2,566,068.44	13.17
66	688526	科前生物	2,561,421.41	13.15
67	688385	复旦微电	2,551,702.64	13.10
68	688678	福立旺	2,494,103.54	12.80
69	688032	禾迈股份	2,469,239.38	12.67
70	688777	中控技术	2,440,758.18	12.53
71	688162	巨一科技	2,432,730.98	12.49
72	600458	时代新材	2,419,228.00	12.42
73	002459	晶澳科技	2,394,427.47	12.29
74	688516	奥特维	2,385,762.87	12.24
75	600570	恒生电子	2,370,678.00	12.17

76	603228	景旺电子	2,355,778.06	12.09
77	002635	安洁科技	2,355,638.00	12.09
78	000100	TCL 科技	2,342,833.26	12.02
79	688106	金宏气体	2,329,280.51	11.95
80	688425	铁建重工	2,322,922.86	11.92
81	688248	南网科技	2,316,772.23	11.89
82	688139	海尔生物	2,244,665.88	11.52
83	002027	分众传媒	2,238,101.00	11.49
84	688589	力合微	2,227,598.07	11.43
85	688225	亚信安全	2,161,093.73	11.09
86	688259	创耀科技	2,146,784.68	11.02
87	000045	深纺织 A	2,123,261.00	10.90
88	688722	同益中	2,104,471.31	10.80
89	688349	三一重能	2,095,993.70	10.76
90	603613	国联股份	2,077,828.00	10.66
91	300433	蓝思科技	2,075,288.00	10.65
92	688127	蓝特光学	2,064,838.59	10.60
93	002322	理工能科	2,057,440.00	10.56
94	688179	阿拉丁	2,048,001.70	10.51
95	002739	万达电影	2,033,825.00	10.44
96	002938	鹏鼎控股	2,032,949.00	10.43
97	300274	阳光电源	1,961,020.00	10.06
98	002384	东山精密	1,951,722.00	10.02
99	002273	水晶光电	1,949,214.00	10.00
100	600789	鲁抗医药	1,940,527.00	9.96
101	688208	道通科技	1,933,114.73	9.92
102	600267	海正药业	1,917,758.00	9.84
103	601100	恒立液压	1,900,369.00	9.75
104	600500	中化国际	1,893,978.00	9.72
105	603444	吉比特	1,892,627.00	9.71
106	600572	康恩贝	1,887,887.00	9.69
107	600038	中直股份	1,840,279.00	9.44
108	688267	中触媒	1,834,929.81	9.42
109	688519	南亚新材	1,815,555.64	9.32
110	000597	东北制药	1,809,188.62	9.29
111	300454	深信服	1,803,634.00	9.26
112	300408	三环集团	1,798,126.00	9.23
113	300782	卓胜微	1,782,588.00	9.15
114	300750	宁德时代	1,782,306.00	9.15
115	688569	铁科轨道	1,775,134.34	9.11
116	688196	卓越新能	1,765,272.66	9.06
117	601766	中国中车	1,760,756.00	9.04
118	600862	中航高科	1,754,883.00	9.01

119	688128	中国电研	1,747,216.64	8.97
120	688711	宏微科技	1,745,131.12	8.96
121	688779	长远锂科	1,741,353.86	8.94
122	688212	澳华内镜	1,705,549.67	8.75
123	688508	芯朋微	1,691,427.10	8.68
124	688739	成大生物	1,689,543.39	8.67
125	688052	纳芯微	1,685,629.86	8.65
126	688207	格灵深瞳	1,675,606.79	8.60
127	000725	京东方 A	1,665,933.00	8.55
128	688348	昱能科技	1,658,767.56	8.51
129	600114	东睦股份	1,657,441.00	8.51
130	600316	洪都航空	1,653,665.00	8.49
131	002632	道明光学	1,646,519.00	8.45
132	002555	三七互娱	1,636,753.00	8.40
133	600583	海油工程	1,633,928.00	8.39
134	600211	西藏药业	1,630,666.00	8.37
135	688668	鼎通科技	1,621,335.91	8.32
136	002421	达实智能	1,587,070.00	8.15
137	603328	依顿电子	1,583,319.00	8.13
138	603338	浙江鼎力	1,572,229.00	8.07
139	688079	美迪凯	1,542,938.37	7.92
140	688400	凌云光	1,540,971.63	7.91
141	300602	飞荣达	1,538,520.50	7.90
142	600271	航天信息	1,536,929.00	7.89
143	601958	金钼股份	1,528,732.00	7.85
144	600183	生益科技	1,508,392.00	7.74
145	300510	金冠股份	1,505,902.24	7.73
146	300319	麦捷科技	1,503,191.00	7.71
147	688023	安恒信息	1,488,088.56	7.64
148	002236	大华股份	1,482,691.00	7.61
149	688686	奥普特	1,482,394.47	7.61
150	688046	药康生物	1,481,564.17	7.60
151	600685	中船防务	1,475,001.00	7.57
152	002266	浙富控股	1,457,420.00	7.48
153	002129	TCL 中环	1,444,095.35	7.41
154	688388	嘉元科技	1,443,393.82	7.41
155	688799	华纳药厂	1,432,730.19	7.35
156	688366	昊海生科	1,430,588.70	7.34
157	688561	奇安信	1,427,719.34	7.33
158	688135	利扬芯片	1,426,381.75	7.32
159	688621	阳光诺和	1,415,810.42	7.27
160	601985	中国核电	1,393,597.00	7.15
161	688261	东微半导	1,386,615.31	7.12

162	000963	华东医药	1,367,594.00	7.02
163	002111	威海广泰	1,366,108.00	7.01
164	600797	浙大网新	1,366,084.00	7.01
165	601600	中国铝业	1,364,927.00	7.01
166	688020	方邦股份	1,355,145.23	6.95
167	688617	惠泰医疗	1,353,058.98	6.94
168	688150	莱特光电	1,352,630.99	6.94
169	688010	福光股份	1,350,908.33	6.93
170	300724	捷佳伟创	1,343,083.00	6.89
171	002252	上海莱士	1,333,733.00	6.84
172	600588	用友网络	1,333,052.00	6.84
173	688271	联影医疗	1,332,144.62	6.84
174	601989	中国重工	1,328,217.00	6.82
175	688505	复旦张江	1,324,176.00	6.80
176	600161	天坛生物	1,302,200.80	6.68
177	300207	欣旺达	1,297,582.00	6.66
178	688173	希荻微	1,296,930.14	6.66
179	601616	广电电气	1,294,723.00	6.64
180	300101	振芯科技	1,291,597.00	6.63
181	002130	沃尔核材	1,285,729.00	6.60
182	300194	福安药业	1,281,269.00	6.58
183	601126	四方股份	1,274,966.00	6.54
184	688068	热景生物	1,259,171.44	6.46
185	688658	悦康药业	1,253,000.41	6.43
186	601137	博威合金	1,251,889.00	6.42
187	688078	龙软科技	1,248,304.35	6.41
188	300679	电连技术	1,246,678.00	6.40
189	300751	迈为股份	1,243,118.20	6.38
190	300377	赢时胜	1,240,011.00	6.36
191	002410	广联达	1,239,874.00	6.36
192	688206	概伦电子	1,239,102.92	6.36
193	688399	硕世生物	1,232,151.42	6.32
194	688258	卓易信息	1,229,185.69	6.31
195	688168	安博通	1,228,621.00	6.31
196	603421	鼎信通讯	1,215,769.40	6.24
197	002519	银河电子	1,214,079.00	6.23
198	688183	生益电子	1,209,885.57	6.21
199	002990	盛视科技	1,207,878.00	6.20
200	002007	华兰生物	1,204,494.00	6.18
201	688210	统联精密	1,200,392.36	6.16
202	688041	海光信息	1,194,576.32	6.13
203	688226	威腾电气	1,191,909.06	6.12
204	000973	佛塑科技	1,170,373.30	6.01

205	688071	华依科技	1,164,785.61	5.98
206	300241	瑞丰光电	1,157,775.00	5.94
207	601908	京运通	1,154,273.00	5.92
208	688049	炬芯科技	1,141,690.41	5.86
209	601012	隆基绿能	1,130,917.00	5.80
210	688005	容百科技	1,127,703.10	5.79
211	600756	浪潮软件	1,111,623.00	5.71
212	002601	龙佰集团	1,100,428.00	5.65
213	600105	永鼎股份	1,098,741.00	5.64
214	002351	漫步者	1,097,044.00	5.63
215	600196	复星医药	1,090,051.00	5.59
216	688586	江航装备	1,083,011.95	5.56
217	688234	天岳先进	1,078,946.45	5.54
218	603218	日月股份	1,077,818.00	5.53
219	600745	闻泰科技	1,077,029.00	5.53
220	000920	沃顿科技	1,071,668.98	5.50
221	300248	新开普	1,070,858.00	5.50
222	688613	奥精医疗	1,057,942.23	5.43
223	002389	航天彩虹	1,052,049.00	5.40
224	002841	视源股份	1,046,775.00	5.37
225	300768	迪普科技	1,046,053.00	5.37
226	688246	嘉和美康	1,039,432.01	5.33
227	688800	瑞可达	1,037,861.90	5.33
228	000999	华润三九	1,029,538.00	5.28
229	300759	康龙化成	1,019,795.77	5.23
230	600613	神奇制药	1,016,979.00	5.22
231	002017	东信和平	1,007,000.00	5.17
232	688332	中科蓝讯	1,005,068.35	5.16
233	600535	天士力	1,004,908.00	5.16
234	688202	美迪西	999,456.94	5.13
235	688609	九联科技	996,925.00	5.12
236	688091	上海谊众	986,207.12	5.06
237	002544	普天科技	981,136.00	5.04
238	002669	康达新材	970,843.00	4.98
239	688521	芯原股份	969,513.38	4.98
240	300976	达瑞电子	964,821.60	4.95
241	002139	拓邦股份	960,066.00	4.93
242	601369	陕鼓动力	953,597.00	4.89
243	688718	唯赛勃	950,123.02	4.88
244	600537	亿晶光电	949,287.00	4.87
245	688166	博瑞医药	948,795.63	4.87
246	002324	普利特	932,515.00	4.79
247	603806	福斯特	931,583.00	4.78

248	000823	超声电子	931,368.00	4.78
249	003029	吉大正元	929,523.00	4.77
250	600851	海欣股份	924,359.00	4.74
251	002036	联创电子	921,142.00	4.73
252	688256	寒武纪	915,233.00	4.70
253	688575	亚辉龙	909,990.62	4.67
254	688188	柏楚电子	909,586.06	4.67
255	300803	指南针	904,649.00	4.64
256	002073	软控股份	902,975.00	4.63
257	300378	鼎捷软件	900,442.00	4.62
258	688357	建龙微纳	898,409.34	4.61
259	600732	爱旭股份	897,145.00	4.60
260	688359	三孚新科	894,552.29	4.59
261	603508	思维列控	888,501.00	4.56
262	688677	海泰新光	884,310.21	4.54
263	688329	艾隆科技	880,635.81	4.52
264	688301	奕瑞科技	879,025.97	4.51
265	002107	沃华医药	878,189.00	4.51
266	000423	东阿阿胶	877,357.00	4.50
267	688510	航亚科技	866,972.20	4.45
268	688167	炬光科技	864,552.00	4.44
269	300763	锦浪科技	858,706.00	4.41
270	688076	诺泰生物	856,736.44	4.40
271	002912	中新赛克	856,602.00	4.40
272	600380	健康元	848,158.00	4.35
273	688083	中望软件	821,400.94	4.22
274	300230	永利股份	819,436.00	4.21
275	688626	翔宇医疗	807,680.04	4.15
276	603383	顶点软件	806,087.00	4.14
277	300232	洲明科技	803,965.00	4.13
278	688093	世华科技	803,659.06	4.12
279	603989	艾华集团	800,726.00	4.11
280	002484	江海股份	798,672.00	4.10
281	002136	安纳达	797,835.00	4.09
282	688100	威胜信息	795,564.16	4.08
283	600728	佳都科技	788,558.00	4.05
284	688331	荣昌生物	786,916.36	4.04
285	000962	东方钽业	786,193.00	4.03
286	300115	长盈精密	784,891.00	4.03
287	603533	掌阅科技	781,288.00	4.01
288	688299	长阳科技	780,886.45	4.01
289	688289	圣湘生物	779,232.52	4.00
290	000768	中航西飞	766,657.64	3.93

291	600237	铜峰电子	765,693.00	3.93
292	002446	盛路通信	757,923.00	3.89
293	688200	华峰测控	755,836.24	3.88
294	688337	普源精电	746,853.68	3.83
295	688798	艾为电子	746,205.25	3.83
296	688598	金博股份	740,501.17	3.80
297	002970	锐明技术	740,355.96	3.80
298	002465	海格通信	737,815.00	3.79
299	300183	东软载波	734,220.60	3.77
300	002644	佛慈制药	733,408.00	3.76
301	688317	之江生物	733,215.58	3.76
302	300308	中际旭创	731,833.00	3.76
303	688019	安集科技	731,725.06	3.76
304	600479	千金药业	719,818.00	3.69
305	603567	珍宝岛	718,209.00	3.69
306	000066	中国长城	718,132.00	3.69
307	300777	中简科技	713,344.00	3.66
308	000682	东方电子	710,700.00	3.65
309	002594	比亚迪	708,221.00	3.63
310	301257	普蕊斯	706,748.00	3.63
311	688320	禾川科技	706,043.05	3.62
312	688228	开普云	703,827.66	3.61
313	688336	三生国健	702,254.88	3.60
314	603259	药明康德	700,402.00	3.59
315	000050	深天马 A	694,348.00	3.56
316	688066	航天宏图	692,330.25	3.55
317	300059	东方财富	686,509.00	3.52
318	300842	帝科股份	683,113.00	3.51
319	600707	彩虹股份	676,456.00	3.47
320	688232	新点软件	661,801.21	3.40
321	688222	成都先导	657,398.27	3.37
322	600363	联创光电	657,120.00	3.37
323	300667	必创科技	655,056.75	3.36
324	688551	科威尔	653,450.70	3.35
325	688198	佰仁医疗	651,009.94	3.34
326	688048	长光华芯	645,886.68	3.31
327	688185	康希诺	644,259.78	3.31
328	600309	万华化学	643,062.00	3.30
329	600763	通策医疗	639,426.00	3.28
330	300532	今天国际	636,607.00	3.27
331	688608	恒玄科技	629,990.00	3.23
332	600645	中源协和	621,190.00	3.19
333	688321	微芯生物	614,963.20	3.16

334	688499	利元亨	613,924.80	3.15
335	688639	华恒生物	611,704.75	3.14
336	688369	致远互联	609,932.26	3.13
337	600562	国睿科技	608,875.32	3.12
338	688022	瀚川智能	606,627.00	3.11
339	688219	会通股份	605,330.60	3.11
340	300316	晶盛机电	598,979.00	3.07
341	000738	航发控制	598,846.00	3.07
342	300098	高新兴	598,214.00	3.07
343	300206	理邦仪器	596,687.00	3.06
344	600351	亚宝药业	592,425.00	3.04
345	688189	南新制药	591,364.93	3.03
346	000551	创元科技	588,669.00	3.02
347	300017	网宿科技	584,823.00	3.00
348	300231	银信科技	580,973.00	2.98
349	002915	中欣氟材	576,768.00	2.96
350	600062	华润双鹤	574,031.00	2.95
351	600085	同仁堂	566,513.00	2.91
352	688055	龙腾光电	561,061.24	2.88
353	688157	松井股份	556,846.67	2.86
354	300127	银河磁体	556,595.00	2.86
355	688518	联赢激光	555,658.28	2.85
356	300719	安达维尔	554,923.00	2.85
357	603283	赛腾股份	553,402.00	2.84
358	002449	国星光电	552,261.00	2.83
359	688016	心脉医疗	549,740.00	2.82
360	688112	鼎阳科技	546,560.10	2.81
361	603920	世运电路	545,892.00	2.80
362	000875	吉电股份	545,653.00	2.80
363	002038	双鹭药业	543,855.00	2.79
364	688585	上纬新材	542,162.86	2.78
365	600580	卧龙电驱	533,725.00	2.74
366	688350	富淼科技	520,010.34	2.67
367	000661	长春高新	508,798.00	2.61
368	000055	方大集团	508,396.00	2.61
369	600775	南京熊猫	508,355.00	2.61
370	601619	嘉泽新能	507,402.00	2.60
371	688003	天准科技	507,177.61	2.60
372	603663	三祥新材	503,367.00	2.58
373	300020	银江技术	500,656.00	2.57
374	688121	卓然股份	497,593.20	2.55
375	300578	会畅通讯	497,591.00	2.55
376	003022	联泓新科	497,237.00	2.55

377	300347	泰格医药	496,855.00	2.55
378	300150	世纪瑞尔	490,477.00	2.52
379	688381	帝奥微	490,026.38	2.51
380	003021	兆威机电	488,924.00	2.51
381	300246	宝莱特	488,459.00	2.51
382	600850	电科数字	487,008.00	2.50
383	300035	中科电气	486,724.00	2.50
384	603236	移远通信	483,261.00	2.48
385	688025	杰普特	482,980.55	2.48
386	301123	奕东电子	482,387.00	2.48
387	002376	新北洋	475,592.00	2.44
388	688099	晶晨股份	470,072.18	2.41
389	000538	云南白药	467,108.00	2.40
390	688190	云路股份	462,707.00	2.37
391	600410	华胜天成	458,843.00	2.35
392	688152	麒麟信安	456,544.11	2.34
393	688117	圣诺生物	456,287.76	2.34
394	688227	品高股份	455,951.50	2.34
395	688300	联瑞新材	452,008.15	2.32
396	300078	思创医惠	451,449.00	2.32
397	002298	中电兴发	449,044.00	2.30
398	300133	华策影视	448,308.80	2.30
399	600973	宝胜股份	447,342.00	2.30
400	688131	皓元医药	446,136.00	2.29
401	300413	芒果超媒	443,875.00	2.28
402	601016	节能风电	443,726.49	2.28
403	688262	国芯科技	439,951.00	2.26
404	601208	东材科技	439,616.00	2.26
405	603876	鼎胜新材	439,598.00	2.26
406	688287	观典防务	438,285.12	2.25
407	688050	爱博医疗	435,341.60	2.23
408	300314	戴维医疗	435,173.00	2.23
409	300448	浩云科技	434,260.00	2.23
410	600468	百利电气	430,836.00	2.21
411	688186	广大特材	429,115.07	2.20
412	688238	和元生物	428,894.92	2.20
413	688161	威高骨科	424,951.05	2.18
414	601218	吉鑫科技	424,633.00	2.18
415	002533	金杯电工	423,730.00	2.17
416	600475	华光环能	423,172.00	2.17
417	688389	普门科技	418,755.53	2.15
418	688305	科德数控	415,860.00	2.13
419	300259	新天科技	414,073.00	2.13

420	300219	鸿利智汇	410,738.00	2.11
421	000997	新大陆	404,331.00	2.08
422	688313	仕佳光子	403,175.40	2.07
423	688018	乐鑫科技	401,743.04	2.06
424	688239	航宇科技	400,488.55	2.06

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	734,087,761.46
卖出股票收入（成交）总额	687,219,605.72

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货。若本基金投资股指期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，综合考虑流动性、基差水平、与股票组合相关度等因素，以对冲投资组合的风险、有效管理

现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可投资国债期货。若本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，综合考虑流动性、基差水平、与债券组合相关度等因素，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金持有的前十名证券发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	39.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39.95

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

本基金本报告期末前十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
国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	198	123,996.23	10,009,000.00	40.77%	14,542,253.38	59.23%
国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C	111	412,292.62	41,879,959.23	91.51%	3,884,521.92	8.49%
合计	309	227,559.01	51,888,959.23	73.79%	18,426,775.30	26.21%

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	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	5,228,902.56	21.2979%
	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C	1,763,122.79	3.8526%
	合计	6,992,025.35	9.9438%

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	国泰君安科技创新精选三个月	50~100

和研究部门负责人持有本开放式基金	持有股票发起 A	
	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C	50~100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	50~100
	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C	0
	合计	50~100

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	15,009,000.00	21.35%	15,009,000.00	21.35%	自基金合同生效日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	859,969.93	1.22%	-	-	-
基金经理等人员	656,739.14	0.93%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	5,475,316.28	7.79%	-	-	-
合计	22,001,025.35	31.29%	15,009,000.00	21.35%	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C
基金合同生效日（2022 年 11 月 16 日）基金份额总额	10,009,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	13,793,631.08	6,468,023.83
本报告期基金总申购份额	14,808,605.64	40,064,720.42
减：本报告期基金总赎回份额	4,050,983.34	768,263.10
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	24,551,253.38	45,764,481.15

§ 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：

本基金管理人于 2023 年 04 月 08 日发布公告，上海国泰君安证券资产管理有限公司法定代表人变更为陶耿先生，相关工商变更手续已于 2023 年 04 月 06 日在上海市场监督管理局办理完毕。

2、本报告期内基金托管人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

本基金本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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

本基金本报告期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

本基金本报告期无涉及托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	2	1,421,307,367.18	100.00%	101,357.12	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关于完成公司法定代表人变更登记的公告	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	2023-04-08
2	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下产品参与直销 APP 费率优惠活动的公告	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	2023-04-17
3	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年 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	2023-04-22
4	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 2023 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-04-23

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230101-20230630	15,009,000.00	-	-	15,009,000.00	21.35%

产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延缓赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生

巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响;

(2)基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平;

(3)因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动;

(4)基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;

(5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

在本报告截止日至报告批准送出日之间,基金管理人根据法律法规及《基金合同》等法律文件的相关规定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,决定自 2023 年 7 月 24 日起,调低本基金的管理费率和托管费率并相应修订法律文件。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》。

§ 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科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金注册的批复;
- 2、《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合同》;
- 3、《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托管协议》;
- 4、《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

二〇二三年八月三十一日