

国泰君安君享优量科创1号集合资产管理计划

2023年年度报告

重要提示

集合计划管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述，并对其内容的真实性、准确性承担个别及连带责任。

集合计划托管人根据本集合计划合同规定，于2024年03月18日复核了本报告中的主要财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自2023年01月01日起至2023年12月31日止。

一、集合资产管理计划简介

(一) 基本资料

集合计划名称	国泰君安君享优量科创1号集合资产管理计划
成立日期	2019年08月07日
成立规模	266,058,161.20
集合计划管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司
集合计划托管人	中国银行股份有限公司

(二) 管理人

法定名称：上海国泰君安证券资产管理有限公司

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

法定代表人：陶耿

电话：021-38676022

传真：021-38871190

联系人：吕巍

(三) 托管人

名称：中国银行股份有限公司
 办公地址：上海市浦东新区银城中路200号
 法定代表人：赵蓉
 电话：021-58883676
 信息披露人：朱怡玮

二、主要财务指标

（一）主要财务指标

下述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

期间数据和指标	本期
	2023年01月01日 - 2023年12月31日
本期利润	10,277,785.40
本期基金份额净值增长率	3.58%
期末数据和指标	2023年12月31日
期末可供分配利润	44,100,008.90
期末可供分配基金份额利润	0.2056
期末基金资产净值	260,551,885.58
期末基金份额净值	1.215
累计期末指标	2023年12月31日
基金份额累计净值增长率	21.50%

（二）财务指标的计算公式

- 1、期末单位集合计划资产净值=期末集合计划资产净值÷集合计划份额
- 2、累计单位集合计划资产净值=期末单位集合计划资产净值+单位集合计划已分红收益
- 3、本期单位基金净值增长率=(本期第一次分红或扩募前单位基金资产净值÷期初单位基金资产净值)×(本期第二次分红或扩募前单位基金资产净值÷本期第一次分红或扩募后单位基金资产净值)×……×(期末单位基金资产净值÷本期最后一次分红或扩募后单位基金资产净值)-1
- 4、单位基金累计净值增长率=(第一年度单位基金资产净值增长率+1)×(第二年度单位基金资产净值增长率+1)×(第三年度单位基金资产净值增长率+1)×……×(上年度单位基金资产净值增长率+1)×(本期单位基金资产净值增长率+1)-1

三、价值变动情况

（一）自集合计划合同生效以来集合计划份额净值的变动情况

国泰君安君享优量科创1号集合资产管理计划累计净值增长率走势图
(2019年08月07日-2023年12月31日)



四、报告期内资产运作情况

(一) 业绩表现

截止 2023 年 12 月 31 日，集合计划单位净值为 1.215 元，本期净值增长率为 3.58%，集合计划累计净值增长率为 21.50%。

(二) 投资经理简介

石人杰, 爱丁堡大学金融数学硕士, 9 年证券从业经验, 其中 5 年研究经历, 4 年投资经历; 曾任国泰君安资产管理量化投资部交易员、研究员, 现任国泰君安资管量化投资部投资经理。主要负责私募量化产品的投资运作。投资风格稳健, 风险和回撤控制能力较佳, 会积极的通过持续迭代的量化模型在市场中获取超额收益。

(三) 投资经理工作报告

一、市场观察

2023 年第一季度, A 股市场交投活跃度显著提升, 整体走势上行。北向资金在 1 月天量净流入, 一季度整体净流入超 1800 亿, 大幅超越 2022 年全年净流入。一季度主要市场指数表现差异较大, 上证综指上涨 5.94%、万得全 A 指数上涨 6.47%, 上证 50、沪深 300、中证 500、中证 1000 指数分别上涨 1.01%、4.63%、8.11%、9.46%, 创业板指、科创 50 分别上涨 2.24%、12.67%。行业方面, 涨幅居前的是计算机 (38.70%)、传媒 (34.22%)、通信 (28.88%)、电子 (16.88%), 跌幅较大的是房地产 (-6.21%), 餐饮旅游、银行、电力设备及新能源也有所下跌。

2023 年第二季度, A 股市场交投活跃度呈现前高后低, 整体走势震荡下行。北向资金净流入趋

势显著放缓，4月及5月有大幅度净流出，二季度整体净流出26亿元。二季度主要市场指数表现差异不大，上证综指下跌2.16%、万得全A指数下跌3.20%，上证50、沪深300、中证500、中证1000指数分别下跌6.38%、5.15%、5.38%、3.98%，创业板指、科创50分别上下跌7.69%、7.06%。行业方面，涨幅居前的是通信(+12.83%)、家电(+7.12%)、传媒(+6.86%)，跌幅较大的是消费者服务(-23.89%)、食品饮料(-11.34%)、农林牧渔(-10.72%)。

2023年第三季度，A股市场日均成交额0.79亿元，交投活跃度较低，整体走势震荡下行。北向资金在7月净买入之后大幅卖出，三季度整体净流出801.32亿元。三季度A股市场结构分化，超大盘、价值风格股票整体占优。主要宽基指数表现如下：上证综指下跌2.86%、万得全A指数下跌4.33%，上证50上涨0.60%，沪深300、中证500、中证1000、中证2000指数分别下跌3.98%、5.13%、7.92%、5.73%，创业板指、科创50分别下跌9.53%、11.67%。行业方面，涨幅居前的是非银金融(+5.62%)、煤炭(+5.26%)、石油石化(+4.37%)，跌幅较大的是电力设备(-15.68%)、传媒(-15.57%)、计算机(-11.70%)。

2023年第四季度，A股市场日均成交额0.83亿元，交投活跃度环比上述但总体情绪仍然较低，整体走势震荡下行，投资主要聚焦于中小盘及结构性机会。北向资金延续较大规模净流出，四季度整体净流出594.89亿元。A股市场结构分化，超大盘、价值风格股票整体占优。主要宽基指数表现如下：上证综指下跌4.36%、万得全A指数下跌3.84%，沪深300、中证500、中证1000指数分别下跌7.00%、4.60%、3.15%，中证2000指数上涨1.92%，创业板指、科创50分别下跌5.61%、4.03%。行业方面，涨幅居前的是煤炭(+4.47%)、电子(+3.95%)，跌幅较大的包括房地产(-13.83%)、建材(-13.20%)、消费者服务(-11.12%)、电力设备及新能源(-9.35%)。从主要风险因子收益率来看，小市值、反转因子超额收益显著，动量、估值、成长风格具备小幅超额，流动性、残差波动率具备负向超额收益。

二、股指期货基差及交投情况

一季度，IH、IF的基差基本保持平水或略微升水，IC、IM的基差还是保持贴水，整体贴水幅度有所收缩，一季度整体基差波动率较大，基差交易型机会较多。交投方面，IH平均日成交量为6.47万手，平均日持仓量为12.7万手，IF平均日成交量为9.4万手，平均日持仓量为20.98万手，IC平均日成交量为7.11万手，平均日持仓量为28.92万手，IM平均日成交量为5.16万手，平均日持仓量为14.11万手，本季度交投最活跃的品种为IF，持仓量最大的品种为IC，IM自上市以来持仓量持续增长。

二季度，IH、IF的基差基本保持升水状态，IC长期在平水徘徊，IM的基差还是保持轻微贴水，整体贴水幅度平稳，一季度整体基差波动率较大，基差交易型机会较多。交投方面，IH平均日成交量为6.43万手，平均日持仓量为14.22万手，IF平均日成交量为8.92万手，平均日持仓量为21.26万手，IC平均日成交量为7.22万手，平均日持仓量为29.06万手，IM平均日成交量为5.62万手，平均日持仓量为17.17万手，本季度交投最活跃的品种为IF，持仓量最大的品种为IC，IM自上市以来持仓量持续增长。

三季度，IH、IF的基差基本保持升水状态，IC长期在平水徘徊，IM的基差还是保持轻微贴水，整体贴水幅度平稳，三季度整体基差波动率有所放大，基差交易型机会较多。交投方面，IH平均日成交量为6.37万手，平均日持仓量为14.04万手，IF平均日成交量为9.68万手，平均日持仓量为

24.43万手，IC平均日成交量为6.83万手，平均日持仓量为28.99万手，IM平均日成交量为6.32万手，平均日持仓量为19.62万手，本季度交投最活跃的品种为IF，持仓量最大的品种为IC，IM自上市以来持仓量持续增长。

四季度股指期货基差发生较大波动，个品种均发生基差大幅扩张再快速收敛的过程，最终IH、IF的基差保持升水状态，IC恢复平水，IM的基差保持轻微贴水，四季度整体基差波动率有所放大，基差交易型机会较多。交投方面，IH平均日成交量为5.88万手，平均日持仓量为13.53万手，IF平均日成交量为9.97万手，平均日持仓量为26.93万手，IC平均日成交量为7.54万手，平均日持仓量为29.73万手，IM平均日成交量为7.53万手，平均日持仓量为22.77万手，本季度交投最活跃的品种为IF，持仓量最大的品种为IC，IM自上市以来持仓量持续增长。

三、风险因子情况

从主要风险因子收益率来看，一季度，短期反转、中小市值、估值、盈利风格表现较好，残差波动率、流动性有明显的负向超额收益，价值风格优于成长风格。行业板块方面的分化巨大，TMT主题投资的热度居高不下，涨幅大幅领先市场，同时交易结构极为拥挤。

二季度，小市值、长期动量、短期反转均有较强的超额收益，流动性、Beta呈现负向超额，价值风格略优于成长风格。行业板块方面的分化较大，TMT的主题投资热点有所分散、呈现结构性行情，经济强相关的消费和传统行业走势较弱。

三季度，估值、小市值、弹性因子具备超额收益，流动性、残差波动率具备明显的负向超额收益，价值风格优于成长风格。行业板块方面的分化较大，大金融、传统能源板块占优，电新、TMT等成长性板块表现较弱。

四季度，估值、小市值、弹性因子具备超额收益，流动性、残差波动率具备明显的负向超额收益，价值风格优于成长风格。行业板块方面的分化较大，大金融、传统能源板块占优，电新、TMT等成长性板块表现较弱。

四、超额收益情况

一季度，北向大幅净流入、公募新发规模低位回升、融资余额明显上升、日均成交额逐步恢复至万亿级别。我们的Alpha模型在一季度跑出较好的超额收益，高频与基本面相结合的模型体现出较大的优势，同时对于Alpha以及另类模型的研发也处于持续迭代中。

二季度，北向资金流入趋势显著放缓、公募新发规模继续低迷、市场交投活跃度有所下降，整体来看市场信心尚未恢复，增量资金不足，市场呈现存量博弈的特征。我们的Alpha模型在二季度跑出较好的超额收益，尤其是基于中证500的Alpha模型表现最优。高频与基本面相结合的模型体现出较大的优势，同时对于Alpha以及另类模型的研发也处于持续迭代中。

三季度，北向资金大幅净流出、公募新发规模继续低迷、市场交投活跃度较低，整体来看市场信心尚未恢复且增量资金不足，市场呈现存量博弈的特征。三季度，我们的Alpha模型表现稳健，在不同基准指数上的超额收益略有不同，基于中证1000的Alpha模型超额收益最优，基于中证500和沪深300的Alpha模型的超额收益略小。高频与基本面相结合的模型体现出较大的优势，同时对于Alpha以及另类模型的研发也处于持续迭代中。

四季度，北向资金延续大幅净流出、公募新发规模继续低迷、市场交投活跃度较低，整体来看市场信心尚未恢复且增量资金不足，市场呈现存量博弈的特征。四季度，我们的Alpha模型整体表

现稳健，高频与基本面相结合、多模型叠加、均衡性较高的信号强度较好。具体到不同对标基准指数上，基于中证1000的Alpha模型表现较好、全市场量化选股策略的表现最佳，基于中证500和沪深300的Alpha模型超额偏震荡。

展望2024年第一季度，我们有以下观点和判断：

1) 首先我们对2024年一季度A股的看法保持相对乐观，整体宽基指数的筑底已经持续一段时间，在面对北向资金持续性抛压的过程中，A股已经表现出一定程度的韧性。主动权益类产品发行遇冷使得中小盘行情将会持续。

2) 面对2024年一季度可能的春季行情，我们认为基本面和高频模型均有较好的发挥空间。结合本团队对于Alpha因子及策略模型的持续迭代更新，我们继续看好后续的Alpha模型表现，同时也会注重不同策略本身的收益规律，进行适度的灵活切换以兑现收益。

3) 市场追逐高动量的行情可能会在接下来一段时间持续波动，我们的Alpha模型在各大类风险因子上有着非常严格的约束，即使遭遇极端行情，策略遭受较大影响的概率较小。今年以来我们对模型进行了全面升级，提升了模型的超额收益率和高频策略的兑现率，因此当前产品将在合适的对冲成本下继续保持高仓位运行，也会重点关注基差交易的机会适当的平滑产品净值曲线，在Alpha策略配置上，高频和基本面策略配置比较均衡，并加强对策略的持续跟踪和改进，会提前展期来锁定未来的对冲成本，均衡配置各策略，在对冲标的选择上，也积极的通过综合配置IC、IF和IM不同的对冲组合来分散单个策略和品种上的失效风险。

4) 针对多变的市场环境，单一频段或者资产的信号难以很快适应，而相关性较低的多策略混合能够有效提升量化策略的适应能力，我们目前的策略库包括高频Alpha策略（依赖更多的是价量信号，用于捕捉短周期强势股）、中长频Alpha策略和主动量化选股策略（依赖基本面数据和预期数据，用于捕捉中长期强势股）、股指期货CTA策略（与股票Alpha策略有非常强的互补性）。

5) 我们会加强对模型的深度分析和跟踪，并通过业绩反馈来不断改进模型，此外，也会加强应对极端行情的能力。策略研究上，我们会不断研发和改进新的因子和模型，切实有效地提升底层Alpha模型的表现。

落实到未来产品具体策略配置层面，原则上我们始终坚持用多策略来分散风险、用多品种股指期货对冲来分散基差的风险、用多空仓的均衡来规避市场的风险、用控制行业暴露来规避行业的风险，力求在基差盈亏可控的范围下尽量通过博取组合的超额收益来贡献业绩。在具体模型上，主要采用以机器学习算法为基础的动态多因子Alpha模型、结合Alpha信号过滤的事件驱动套利模型、以量价指标为主的高频统计套利模型、以纯财务因子为主的基本面模型以及以股票高频数据为主的短周期Alpha策略等，并按照对冲品种、风险偏好等构建多种多样的投资组合，然后按照当时对冲品种的基差情况、市场风险偏好以及产品净值情况来做投资组合层面的配置。

（四）投资经理变更情况

无

（五）资产管理计划收益分配情况

无

（六）托管人履职报告

详见附件。

五、 集合计划财务报表及投资组合报告

（一）集合计划财务报表

1. 资产负债表

单位：人民币元

资 产	期末余额 2023 年 12 月 31 日	上年年末余额 2022 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	65,674,456.81	18,744,171.43
结算备付金	28,909,220.17	29,403,299.46
存出保证金	18,242,019.07	29,334,580.33
交易性金融资产	166,030,650.69	223,400,436.29
其中：股票投资	166,030,650.69	223,400,436.29
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	-	-
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	-	619,841.21
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	278,856,346.74	301,502,328.72
负债和净资产	期末余额 2023 年 12 月 31 日	上年年末余额 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	13,848,950.67	471,101.29
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	1,025,093.01	1,125,549.97
应付托管费	68,339.54	75,036.62
应付销售服务费	-	-
应付投资顾问费	-	-
应交税费	4,026.79	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	3,358,051.15	2,223,133.07
负债合计	18,304,461.16	3,894,820.95
净资产：		
实收基金	214,430,195.83	253,679,330.59
其他综合收益	-	-
未分配利润	46,121,689.75	43,928,177.18
净资产合计	260,551,885.58	297,607,507.77
负债和净资产总计	278,856,346.74	301,502,328.72

2. 利润表

单位：人民币元

项 目	本期金额 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 12 月 31 日	上期金额 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入	15,089,442.56	7,649,972.59
1. 利息收入	652,681.74	662,096.25
其中：存款利息收入	652,681.74	659,506.68
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	-	2,589.57
证券出借利息收入	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	18,729,617.92	6,813,451.83
其中：股票投资收益	737,100.34	-29,544,840.38
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	14,986,327.79	33,177,216.52
股利收益	3,691,944.78	3,750,314.80

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	-	-
投资收益抵减-金融商品转让增值税	-685,754.99	-569,239.11
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,292,857.10	173,489.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	935.45
减：二、营业总支出	4,811,657.16	4,632,282.30
1.管理人报酬	4,410,036.25	4,254,981.78
2.托管费	294,002.51	283,595.37
3.销售服务费	-	-
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	82,290.59	68,308.70
8.其他费用	25,327.81	25,396.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	10,277,785.40	3,017,690.29
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	10,277,785.40	3,017,690.29
五、其他综合收益的税后净额	-	-
六、综合收益总额	10,277,785.40	3,017,690.29

3. 净资产变动表

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期金额 2023年01月01日至2023年12月31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）	253,679,330.59	-	43,928,177.18	297,607,507.77
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）	253,679,330.59	-	43,928,177.18	297,607,507.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-39,249,134.76	-	2,193,512.57	-37,055,622.19
（一）综合收益总额	-	-	10,277,785.40	10,277,785.40

(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)	-39,249,134.76	-	-8,084,272.83	-47,333,407.59
其中:1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-39,249,134.76	-	-8,084,272.83	-47,333,407.59
(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)	214,430,195.83	-	46,121,689.75	260,551,885.58
项目	上期金额 2022年01月01日至2022年12月31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)	220,743,215.18	-	34,960,612.59	255,703,827.77
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)	220,743,215.18	-	34,960,612.59	255,703,827.77
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	32,936,115.41	-	8,967,564.59	41,903,680.00
(一)综合收益总额	-	-	3,017,690.29	3,017,690.29
(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)	32,936,115.41	-	5,949,874.30	38,885,989.71
其中:1.基金申购款	33,871,569.11	-	6,128,430.89	40,000,000.00
2.基金赎回款	-935,453.70	-	-178,556.59	-1,114,010.29
(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)	253,679,330.59	-	43,928,177.18	297,607,507.77

4. 报表附注

4.1 资产管理产品的基本情况

集合计划名称为国泰君安君享优量科创1号集合资产管理计划,成立日期为2019年08月07日,成立规模266,058,161.20元,集合计划管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司,集合计划托管

人中国银行股份有限公司。

4.2 财务报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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》》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

4.3 遵循企业会计准则的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划于2023年12月31日的财务状况以及自2023年01月01日起至2023年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划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。

4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

会计政策变更的说明：本集合计划本报告期无会计政策变更。

会计估计变更的说明：本集合计划本报告期无会计估计变更。

差错更正的说明：本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

4.6 报表重要项目的说明，如管理人报酬的确定方法、暂估管理人报酬与投资者实际承担的管理人报酬可能存在差异的事实，以及公允价值计量的相关信息等

暂估业绩报酬为假设本集合计划于本报告期末按照当日的集合计划份额净值（计提业绩报酬前）清算，根据集合计划委托人持有的集合计划份额（包括未到期份额）至该日止持有期间的收益情况估算的业绩报酬。该金额是各集合计划委托人的暂估业绩报酬的合计，各集合计划委托人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认。实际计提时的业绩报酬金额可能会与此处暂估业绩报酬金额有差异。

4.7 或有和承诺事项、资产负债表日后非调整事项等需要说明的事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要披露的重大或有事项以及资产负债表日后事项。

4.8 与金融工具相关的流动性风险、信用风险、市场风险的信息

一：流动性风险

流动性风险是指集合计划在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于投资人赎回其持有的集合计划份额，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，管理人每日对申购赎回情况进行严密监控，保持投资本集合计划中的可用现金头寸与之相匹配。本集合计划的管理人在本集合计划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，有效保障本集合计划持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本集合计划管理人通过独立的风险管理部门对本集合计划持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及本集合计划在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

二：信用风险

信用风险是指在集合计划交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划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。

本集合计划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。

三：市场风险

市场风险是指集合计划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。

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。管理人定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资本集合计划的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

其他价格风险是指本集合计划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。本集合计划通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照本集合计划合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本集合计划的管理人定期运用多种定量方法对本集合计划进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本集合计划面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

4.9 资产管理产品启用侧袋机制的，应当披露扣除侧袋机制影响后的期末净资产金额及其计算方法，以及侧袋账户的有关情况

无

4.10 应当披露的其他信息

无

(二) 投资组合报告

1. 报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名证券明细

序号	资产代码	资产名称	数量（股/张）	期末市值（元）	占净值比例
1	600519	贵州茅台	1,400.00	2,416,400.00	0.93%
2	002152	广电运通	96,200.00	1,179,412.00	0.45%
3	000100	TCL 科技	272,700.00	1,172,610.00	0.45%
4	002916	深南电路	16,500.00	1,171,335.00	0.45%
5	002913	奥士康	37,800.00	1,158,570.00	0.44%
6	000987	越秀资本	192,000.00	1,155,840.00	0.44%
7	300750	宁德时代	6,900.00	1,126,494.00	0.43%
8	603993	洛阳钼业	211,900.00	1,101,880.00	0.42%
9	601600	中国铝业	195,200.00	1,100,928.00	0.42%
10	000338	潍柴动力	77,700.00	1,060,605.00	0.41%

2. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	166,030,650.69	59.54
	其中：股票	166,030,650.69	59.54
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	94,583,676.98	33.92
8	其他各项资产	18,242,019.07	6.54
9	合计	278,856,346.74	100.00

注：在以上表格中由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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	18,242,019.07

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,242,019.07

4. 投资组合报告附注

- 1、报告期内集合计划投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。
- 2、集合计划投资的前十名证券中，没有投资于超出集合计划合同规定可投资证券库之外的。

(三) 重大关联交易状况

2023年关联方持有本集合计划数据

产品代码	期间份额变动情况	期末持有份额
953270	-33,886,141.99	28,063,610.85

关联方交易明细如下：

成交日期	基金名称	委托方向	证券代码	证券简称	成交数量	成交金额
2023-01-03	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	300	3,184
2023-01-03	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	3,000	31,443
2023-01-04	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	3,100	32,907
2023-01-04	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	100	320
2023-01-05	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	900	9,603
2023-01-06	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	2,600	27,719
2023-01-10	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	2,100	22,609
2023-01-11	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	200	638
2023-01-12	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	27,400	292,229
2023-01-13	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	1,700	18,309
2023-01-13	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	600	6,500

	1号					
2023-01-16	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	30,100	337,839
2023-01-16	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	1,900	6,118
2023-01-18	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	6,900	77,904
2023-01-19	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	400	4,583
2023-01-30	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	24,600	79,458
2023-01-31	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	38,900	125,647
2023-02-01	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	7,500	85,643
2023-02-01	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	29,700	95,337
2023-02-02	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	6,100	19,581
2023-02-02	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	13,600	155,484
2023-02-02	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	53,600	172,592
2023-02-03	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	2,500	28,283
2023-02-03	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	21,200	68,052
2023-02-03	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	6,100	30,199
2023-02-06	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	2,100	10,447
2023-02-06	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	14,900	167,053
2023-02-06	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	25,300	81,024
2023-02-07	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	45,000	143,699
2023-02-07	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	7,400	82,814
2023-02-07	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	4,100	20,379
2023-02-08	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	6,500	20,865

2023-02-08	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	1,600	17,832
2023-02-08	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	200	1,000
2023-02-08	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	1,000	11,161
2023-02-08	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	700	3,513
2023-02-09	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	700	7,826
2023-02-09	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	3,200	16,163
2023-02-09	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	9,600	30,728
2023-02-10	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	32,200	162,243
2023-02-10	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	6,000	19,297
2023-02-10	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	1,200	13,393
2023-02-13	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	12,200	39,162
2023-02-13	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	1,000	5,069
2023-02-13	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	2,000	22,358
2023-02-13	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	1,600	17,869
2023-02-14	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	4,500	49,928
2023-02-14	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	47,800	153,307
2023-02-14	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	1,300	4,186
2023-02-14	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	27,900	141,460
2023-02-15	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	21,900	242,850
2023-02-15	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	17,300	55,360
2023-02-15	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	2,100	10,578
2023-02-16	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	35,100	112,827

2023-02-16	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	600	6,750
2023-02-16	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	2,600	13,114
2023-02-17	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	33,400	107,438
2023-02-17	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	2,800	30,345
2023-02-20	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	24,500	79,135
2023-02-21	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	13,400	147,556
2023-02-21	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	200	646
2023-02-22	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	5,800	18,734
2023-02-22	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	2,500	27,498
2023-02-23	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	3,500	38,870
2023-02-27	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	100	507
2023-02-28	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	100	505
2023-02-28	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	2,700	30,530
2023-03-01	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	1,400	16,032
2023-03-01	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	28,400	92,016
2023-03-02	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	1,300	14,761
2023-03-03	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	700	7,857
2023-03-06	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	6,100	68,199
2023-03-06	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	13,900	46,009
2023-03-07	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	15,400	51,670
2023-03-07	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	2,700	30,014
2023-03-08	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	8,200	89,386

2023-03-09	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	39,800	133,480
2023-03-13	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	2,600	27,631
2023-03-14	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	4,000	42,386
2023-03-14	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	100	333
2023-03-15	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	7,500	25,425
2023-03-16	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	1,200	12,849
2023-03-17	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	1,281	13,887.04
2023-03-20	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	8,600	30,108
2023-03-21	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	8,400	28,728
2023-03-22	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	200	688
2023-03-22	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	2,600	27,968
2023-03-23	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	18,500	64,215
2023-03-24	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	12,500	42,668
2023-03-27	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	72,000	241,680
2023-03-27	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	1,500	16,224
2023-03-28	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	6,800	73,857
2023-03-28	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	3,200	10,766
2023-03-29	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	11,100	119,262
2023-03-29	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	30,200	103,210
2023-03-30	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	6,100	20,679
2023-03-30	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	5,200	55,289
2023-03-31	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	8,100	86,929

2023-03-31	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	38,900	131,093
2023-03-31	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	1,900	6,437
2023-04-03	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	8,200	27,552
2023-04-03	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	13,000	141,743
2023-04-04	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	23,000	78,256
2023-04-06	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	1,600	17,433
2023-04-06	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	15,300	52,632
2023-04-11	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	15,300	52,785
2023-04-13	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	12,200	133,076
2023-04-14	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	13,400	146,143
2023-04-17	君享优量科创1号	买入	601696	中银证券	20,500	228,111
2023-04-17	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	3,100	11,061
2023-04-19	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	2,900	31,571
2023-04-20	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	9,100	98,492
2023-04-21	君享优量科创1号	卖出	601696	中银证券	41,800	441,169
2023-05-08	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	50,700	226,880
2023-05-09	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	38,000	173,070
2023-05-10	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	12,800	54,649
2023-06-06	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	100	405
2023-06-13	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	100	406
2023-06-21	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	300	1,344
2023-06-21	君享优量科创1号	卖出	601788	光大证券	300	4,890

2023-06-21	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	3,400	13,262
2023-06-26	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	300	1,338
2023-07-04	君享优量科创1号	申购	301456	盘古智能	2,346	89,054.16
2023-07-12	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	1,400	5,502
2023-07-25	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	5,100	19,329
2023-08-30	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	2,600	9,777
2023-08-31	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	1,400	5,250
2023-09-01	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	5,100	18,933
2023-09-28	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	2,700	10,170
2023-09-21	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	6,900	26,013
2023-08-07	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	100	385
2023-08-31	君享优量科创1号	卖出	601788	光大证券	200	3,520
2023-09-18	君享优量科创1号	买入	601788	光大证券	200	3,348
2023-07-14	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	12,400	49,413
2023-07-31	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	100	391
2023-08-02	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	16,300	62,390
2023-08-18	君享优量科创1号	买入	601788	光大证券	200	3,638
2023-09-06	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	7,300	27,010
2023-08-29	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	2,700	10,258
2023-09-04	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	3,600	13,456
2023-09-12	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	13,100	48,077
2023-09-15	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	4,700	17,437

2023-09-22	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	8,500	32,130
2023-07-17	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	14,500	54,537
2023-07-10	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	22,900	89,081
2023-08-25	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	31,000	117,319
2023-08-29	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	4,600	17,483
2023-09-05	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	8,300	30,793
2023-09-07	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	2,700	10,016
2023-09-14	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	6,300	23,436
2023-09-25	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	3,500	13,267
2023-07-04	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	100	394
2023-07-11	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	3,000	11,769
2023-07-20	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	5,900	22,066
2023-08-01	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	18,000	70,560
2023-09-11	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	6,800	25,092
2023-08-30	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	7,700	29,029
2023-07-14	君享优量科创1号	卖出	601788	光大证券	200	3,294
2023-07-04	君享优量科创1号	买入	601788	光大证券	200	3,264
2023-07-18	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	23,400	86,814
2023-07-19	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	17,100	63,477
2023-07-21	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	6,900	25,700
2023-08-18	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	1,600	6,080
2023-09-18	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	5,500	20,330

2023-09-26	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	11,600	43,823
2023-07-06	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	2,400	9,320
2023-09-22	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	1,600	6,032
2023-12-13	君享优量科创1号	申购	601096	宏盛华源	18,486	31,426.2
2023-11-03	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	8,900	34,743
2023-11-06	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	11,900	52,186
2023-11-07	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	700	3,073
2023-11-23	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	17,100	74,534
2023-11-30	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	500	2,147
2023-12-04	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	3,700	16,133
2023-12-05	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	3,700	14,948
2023-12-06	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	6,900	27,333
2023-11-10	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	4,800	20,880
2023-12-15	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	1,400	5,531
2023-12-11	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	1,500	5,895
2023-11-08	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	1,800	7,807
2023-10-13	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	3,500	13,926
2023-10-19	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	1,500	5,951
2023-11-15	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	6,700	26,423
2023-11-15	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	900	3,951
2023-11-16	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	11,100	44,067
2023-11-20	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	5,300	23,053

2023-12-06	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	1,200	5,260
2023-12-18	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	6,700	26,599
2023-12-22	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	3,300	13,200
2023-12-26	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	2,400	9,720
2023-11-20	君享优量科创1号	卖出	601788	光大证券	1,000	16,899
2023-12-01	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	3,400	14,666
2023-11-21	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	100	437
2023-10-10	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	5,400	20,250
2023-11-02	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	7,000	27,720
2023-11-15	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	10,500	41,395
2023-11-27	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	12,100	48,118
2023-11-28	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	400	1,746
2023-11-29	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	3,400	14,726
2023-12-11	君享优量科创1号	买入	601788	光大证券	500	7,835
2023-12-12	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	23,000	91,373
2023-11-14	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	2,400	10,475
2023-11-17	君享优量科创1号	卖出	601788	光大证券	200	3,378
2023-11-28	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	4,900	19,453
2023-11-29	君享优量科创1号	卖出	601788	光大证券	400	6,498
2023-12-13	君享优量科创1号	买入	601788	光大证券	900	14,237
2023-10-16	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	2,100	8,379
2023-12-04	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	4,400	17,776

2023-12-21	君享优量科创1号	买入	601788	光大证券	1,300	19,787
2023-10-31	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	100	428
2023-11-22	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	300	1,303
2023-10-30	君享优量科创1号	卖出	601788	光大证券	200	3,272
2023-11-02	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	6,500	28,275
2023-11-09	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	37,600	163,361
2023-11-14	君享优量科创1号	买入	601788	光大证券	1,200	20,506
2023-12-05	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	1,000	4,346
2023-12-08	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	10,800	42,556
2023-12-20	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	11,700	53,404
2023-12-26	君享优量科创1号	卖出	601788	光大证券	2,200	32,839
2023-12-28	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	17,000	68,000
2023-12-07	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	400	1,737
2023-12-19	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	11,400	45,486
2023-11-13	君享优量科创1号	买入	601788	光大证券	600	10,109
2023-11-14	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	31,500	125,055
2023-11-16	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	100	437
2023-11-03	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	12,600	55,114
2023-11-17	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	8,600	34,016
2023-11-22	君享优量科创1号	卖出	601788	光大证券	700	11,747
2023-11-27	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	600	2,602
2023-12-28	君享优量科创1号	卖出	601788	光大证券	1,600	24,690

2023-11-10	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	1,300	5,122
2023-11-28	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	100	435
2023-11-02	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	300	1,301
2023-11-16	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	2,600	11,333
2023-11-20	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	12,300	48,831
2023-11-24	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	3,400	13,532
2023-12-08	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	100	395
2023-12-08	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	13,900	61,686
2023-12-21	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	14,400	57,154
2023-12-25	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	20,500	94,693
2023-11-08	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	5,500	21,340
2023-11-16	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	2,800	11,116
2023-11-21	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	300	1,311
2023-12-22	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	1,000	4,584
2023-11-13	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	20,500	80,585
2023-11-17	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	400	1,744
2023-12-11	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	2,300	8,970
2023-11-13	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	100	438
2023-10-12	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	15,100	58,431
2023-11-28	君享优量科创1号	买入	601788	光大证券	2,500	40,757
2023-12-20	君享优量科创1号	买入	601788	光大证券	5,200	79,247
2023-12-29	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	7,900	36,696

2023-12-19	君享优量科创1号	买入	601788	光大证券	800	12,409
2023-12-27	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	300	1,372
2023-10-30	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	200	758
2023-12-28	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	3,200	14,814
2023-12-13	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	2,700	10,748
2023-11-01	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	74,900	326,791
2023-11-17	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	17,900	78,213
2023-12-21	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	9,800	44,674
2023-11-22	君享优量科创1号	买入	000912	泸天化	600	2,616
2023-11-22	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	12,000	47,682
2023-12-14	君享优量科创1号	买入	601788	光大证券	600	9,469
2023-12-29	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	14,700	58,653
2023-11-24	君享优量科创1号	卖出	000912	泸天化	500	2,179
2023-12-12	君享优量科创1号	买入	601788	光大证券	300	4,777
2023-12-25	君享优量科创1号	卖出	601988	中国银行	9,000	36,090
2023-11-28	君享优量科创1号	买入	601988	中国银行	1,400	5,558

（四）两费及业绩报酬情况

项目	当前费率	计提方式	支付方式
管理费	1.5000%	每日计提	按季支付
托管费	0.1000%	每日计提	按季支付

项目	当前计提基准	计提比例	计提方式	支付方式
业绩报酬	6.0000%	20.0000%	分红或退出时计提	发生时支付

六、集合计划份额变动

单位：份

期初集合计划份额总额	253,693,903.47
报告期内集合计划总申购份额	-
报告期内集合计划总赎回份额	39,249,134.76
报告期末集合计划份额总额	214,444,768.71

七、重要事项提示

无

八、备查文件目录

（一）本集合计划备查文件目录

- 1、中国证监会核准集合计划募集的无异议函；
- 2、《国泰君安君享优量科创1号集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《国泰君安君享优量科创1号集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《国泰君安君享优量科创1号集合资产管理计划说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、集合计划托管人业务资格批件、营业执照。

（二）存放地点及查阅方式

投资者可于本集合计划管理人办公时间预约查阅，或登录集合计划管理人网站 www.gtjazg.com 查阅，还可拨打本公司客服电话（95521）查询相关信息。

上海国泰君安证券资产管理有限公司

二〇二四年三月三十一日