

国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 08 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年01月01日起至2024年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	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	15
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60
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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60

§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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	62
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	63
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件.....	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金	
基金简称	国泰君安中证 1000 优选股票发起	
基金主代码	019505	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 12 月 12 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	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	189,667,573.99 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安中证 1000 优选股票发起 A	国泰君安中证 1000 优选股票发起 C
下属分级基金的交易代码	019505	019506
报告期末下属分级基金的份额总额	147,195,905.80 份	42,471,668.19 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金依据宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，重点关注包括 GDP 增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势，同时强调金融市场投资者行为分析，关注资本市场资金供求关系变化等因素，在深入分析基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度，形成资产配置方案。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>在股票投资方面，本基金在量化策略配置和投资组合管理的框架下，根据量化模型主要精选中证 1000 指数成份股中成长性良好且估值合理的上市公司股票构建投资组合，并根据市场风格变化及股票技术面因素，不定期对策略权重进行优化调整，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。本基金的投资策略还包括债券投资策略、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、参与股指期货交易策略、参与国债期货交易策略、股票期权投资策略、存托凭证投资策略。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税

	后) ×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金, 其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海国泰君安证券资产管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	郭明
	联系电话	021-38676022	010-66105799
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95521	95588
传真		021-38871190	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		陶耿	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gtjazg.com
基金中期报告备置地点	上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上海国泰君安证券资产管理有限公司	上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位: 人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024 年 01 月 01 日-2024 年 06 月 30 日)
---------------	---

	国泰君安中证 1000 优选股票发起 A	国泰君安中证 1000 优选股票发起 C
本期已实现收益	-8,810,489.02	-3,910,456.97
本期利润	-16,286,581.79	-5,509,159.17
加权平均基金份额本期利润	-0.1003	-0.0999
本期加权平均净值利润率	-10.77%	-10.77%
本期基金份额净值增长率	-10.31%	-10.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-15,507,590.97	-4,558,636.25
期末可供分配基金份额利润	-0.1054	-0.1073
期末基金资产净值	131,688,314.83	37,913,031.94
期末基金份额净值	0.8946	0.8927
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-10.54%	-10.73%

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰君安中证 1000 优选股票发起 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	-6.86%	1.46%	-8.15%	1.36%	1.29%	0.10%
过去三个月	-5.34%	1.48%	-9.51%	1.42%	4.17%	0.06%
过去六个月	-10.31%	1.90%	-15.97%	1.87%	5.66%	0.03%
自基金合同生效起至今	-10.54%	1.80%	-18.43%	1.79%	7.89%	0.01%

国泰君安中证 1000 优选股票发起 C 净值表现

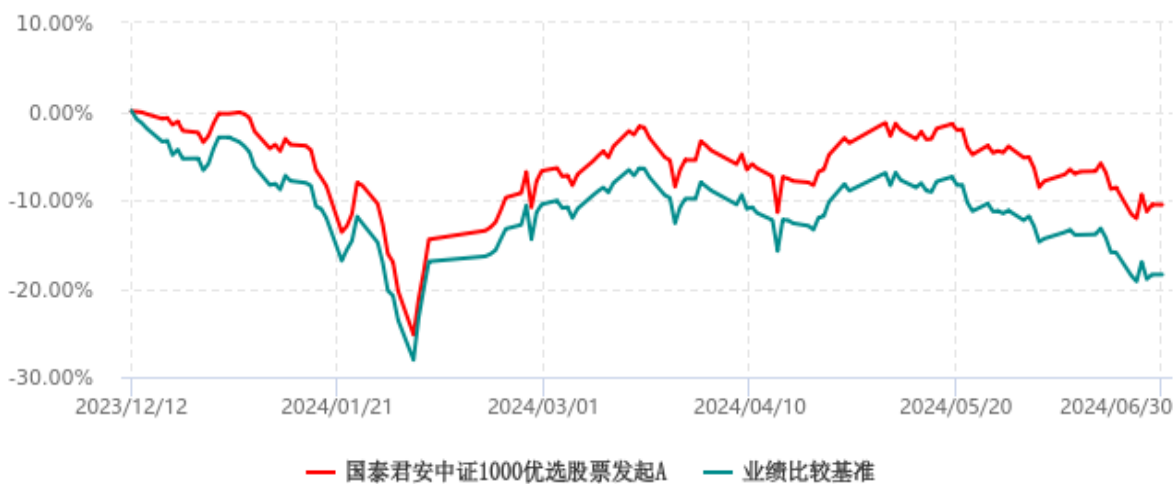
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-6.88%	1.46%	-8.15%	1.36%	1.27%	0.10%
过去三个月	-5.43%	1.48%	-9.51%	1.42%	4.08%	0.06%

过去六个月	-10.48%	1.90%	-15.97%	1.87%	5.49%	0.03%
自基金合同生效起至今	-10.73%	1.80%	-18.43%	1.79%	7.70%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰君安中证1000优选股票发起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

(2023年12月12日-2024年06月30日)

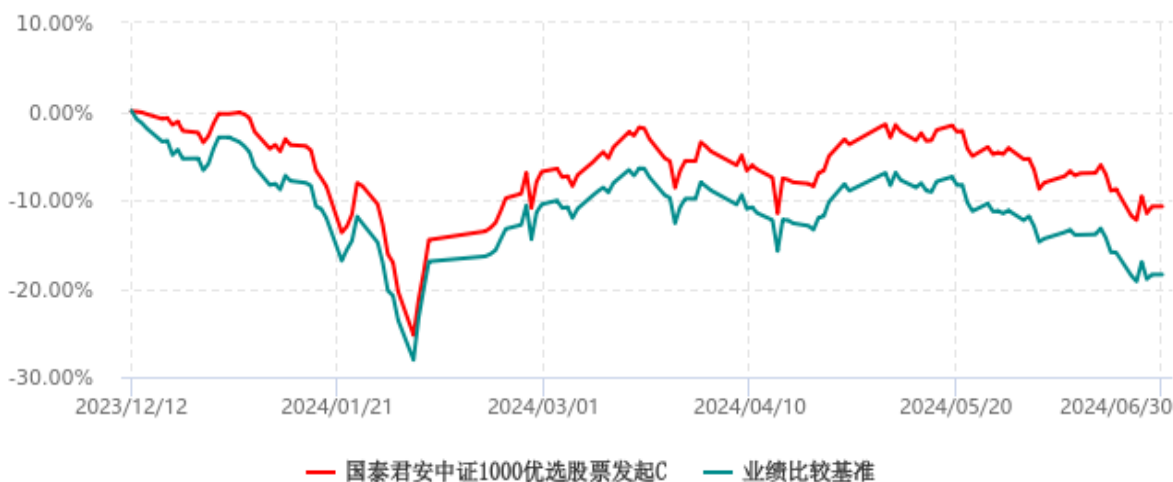


注：1、本基金于 2023 年 12 月 12 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

国泰君安中证1000优选股票发起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

(2023年12月12日-2024年06月30日)



注：1、本基金于 2023 年 12 月 12 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海国泰君安证券资产管理有限公司正式成立于 2010 年 10 月 18 日，经中国证监会证监许可【2010】631 号文批准，是业内首批券商系资产管理公司。公司注册资本金 20 亿元，注册地上海。

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理国泰君安现金管家货币市场基金、国泰君安 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、国泰君安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金、国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金、国泰君安君得明混合型证券投资基金、国泰君安东久新经济产业园封闭式基础设施证券投资基金、国泰君安君得利短债债券型证券投资基金、国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、国泰君安 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安安弘六个月定期开放债券型证券投资基金、国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金等 53 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡崇海	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安稳健债增利债券型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。	2023-12-12	-	13 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士。曾任香港科技大学人工智能实验室访问学者，其后加盟方正证券研究所、国泰君安证券咨询部及研究所从事量化对冲模型的研发工作，2014 年加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，先后在量化投资部、权益与衍生品部担任高级投资经理，从事量化投资和策略研发工作，在 Alpha 量化策略以及基于机器学习的投资方面有独到且深入的研究。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 2 次。本基金与本公司管理的其他组合在不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

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

随着我国积极的财政政策适度加力，高水平对外开放政策不断延续，以及消费需求仍处于充分释放阶段，未来市场具备回升条件，我们预计，未来市场板块轮动速度仍然较快。以分散化投资为主的量化投资在今年超大盘股引领的防御性行情下，阶段性面临一定的挑战，也本没有一种投资方法论可以通吃所有风格的行情，但是量化投资从投资理念和投资逻辑来讲并未发生本质性改变，以博取 Alpha 为主要目的的量化选股型产品在当前市场点位仍具有很高的性价比。在本基金中，我们通过挖掘有投资逻辑的 Alpha 因子，不断改进底层量化模型以及定期监控策略的表现等方式来增强策略表现。我们一直坚守一贯的投资体系和理念，并尽可能以此来稳定投资者对我们超额收益率的预期。在量化增强层面，我们将结合财务数据为基础的基本面信号和实时量价信号，通过机器学习模型来有效选择因子，并通过投资组合管理来控制模型在主要市场风险和行业上相对于基准指数的暴露程度，力求以较为稳定的方式增强中证 1000 指数。另外一方面，由于本基金采用的基本面量化信号和实时量价信号在逻辑和数值层面均有较低的相关性，我们相信能够在兼顾两者的情况下追求稳健的 Alpha，更有效发挥两者的协同和共振效应，并根据市场的流动性和波动率进行及时优化。我们的投资策略是通过积少成多、以概率取胜的方式增厚投资收益，因此更需要投资者长期持有。我们认为中证 1000 指数当前依然处于历史低估阶段，成长性良好，指数未来上涨的空间依然远大于下跌的空间，我们将努力通过科学的手段增强量化模型的超额收益率水平，以此不断为客户增厚投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安中证 1000 优选股票发起 A 基金份额净值为 0.8946 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.31%，同期业绩比较基准收益率为-15.97%；截至报告期末国泰君安中证 1000 优选股票发起 C 基金份额净值为 0.8927 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.48%，同期业绩比较基准收益率为-15.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，A 股权益市场估值仍然处于历史底部位置，A 股指数具有较高的配置性价比，在积极的财政和货币政策的支撑下，A 股依然有望延续震荡反弹的格局。海外方面，美联储降息预期再次扩张，引来美元指数和美债利率的进一步走弱，人民币汇率回升，有助于海外资金加速回流 A 股。国内方面，监管层面对股票市场的非常态波动采取了积极行动，“国九条”的实施与打击财务造假举措的不断推进，短期内对中小市值公司确实造成一定情绪面的冲击，但长远来看，这些措施

犹如“刮骨疗伤”，短期的阵痛反而有利于资本市场中长期的健康发展，在提升上市公司质量和注重投资者回报的同时，为投资者创造更加透明和公平的投资环境。审视当下的行情，诚然目前市场依然处于风险偏好较低的缩量博弈阶段，市场信心的恢复尚需时日，但是我们认为大多数股票的市场化“出清”较为彻底，过去多年的下跌对当下复杂经济环境和国际政治形势的估值消化已经较为充分，“磨底”的煎熬并不妨碍我们对于下半年主要股票宽基指数的行情变得积极乐观起来。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关规定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——上海国泰君安证券资产管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对上海国泰君安证券资产管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	10,596,472.88	36,782,079.63
结算备付金		1,790,833.93	10,005,917.80
存出保证金		349,776.00	-
交易性金融资产	6.4.7.2	157,163,697.08	193,049,949.41
其中：股票投资		157,163,697.08	193,049,949.41
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-

应收申购款		916.26	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		169,901,696.15	239,837,946.84
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		17,868.07	-
应付管理人报酬		144,797.52	123,617.42
应付托管费		21,719.65	18,542.61
应付销售服务费		12,952.67	13,997.29
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	103,011.47	7,772.00
负债合计		300,349.38	163,929.32
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	189,667,573.99	240,305,928.96
未分配利润	6.4.7.8	-20,066,227.22	-631,911.44

净资产合计		169,601,346.77	239,674,017.52
负债和净资产总计		169,901,696.15	239,837,946.84

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 189,667,573.99 份。其中国泰君安中证 1000 优选股票发起 A 基金份额净值 0.8946 元，基金份额总额 147,195,905.80 份；国泰君安中证 1000 优选股票发起 C 基金份额净值 0.8927 元，基金份额总额 42,471,668.19 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-20,450,511.49
1. 利息收入		41,712.92
其中：存款利息收入	6.4.7.9	41,712.92
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-11,507,682.35
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-12,219,204.70
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.11	-756,294.12
股利收益	6.4.7.12	1,467,816.47

其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-9,074,794.97
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	90,252.91
减：二、营业总支出		1,345,229.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,006,394.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	150,959.24
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	101,991.69
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	6.4.7.15	85,883.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-21,795,740.96
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-21,795,740.96
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-21,795,740.96

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金

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

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	240,305,928.96	-631,911.44	239,674,017.52
二、本期期初净资产	240,305,928.96	-631,911.44	239,674,017.52

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-50,638,354.97	-19,434,315.78	-70,072,670.75
（一）、综合收益总额	-	-21,795,740.96	-21,795,740.96
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-50,638,354.97	2,361,425.18	-48,276,929.79
其中：1. 基金申购款	1,104,206.44	-61,886.29	1,042,320.15
2. 基金赎回款	-51,742,561.41	2,423,311.47	-49,319,249.94
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	189,667,573.99	-20,066,227.22	169,601,346.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

陶耿	陶耿	茹建江
-----	-----	-----
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)已获中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023] 2015 号《关于准予国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金注册的批复》，由上海国泰君安证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《国泰君安中证 1000 优选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负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2023 年 11 月 20 日至 2023 年 12 月 8 日共募集 240,252,220.83 元(不含认购资金利息)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0576 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金基金合同》于 2023 年 12 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额 240,305,928.96 份基金份额，其中认购资金利息折合 53,708.13 份基金份额。本基金的基金管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金基金合同》，本基金根据是否收取认购费、申购费、销售服务费，将基金份额分为不同的类别。投资人在认购、申购时收取认购费、申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；投资人在认购、申购时不收取认购费、申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金

份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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：本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 80%-95%；本基金投资于中证 1000 指数的成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，待履行适当程序后，以变更后的规定为准。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

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、金融负债或权益工具。

(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、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点

的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
活期存款	5,229,391.33
等于：本金	5,228,843.73
加：应计利息	547.60
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	5,367,081.55
等于：本金	5,366,682.18
加：应计利息	399.37
减：坏账准备	-
合计	10,596,472.88

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	165,759,646.21	-	157,163,697.08	-8,595,949.13
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	165,759,646.21	-	157,163,697.08	-8,595,949.13

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	3,043,270.00	0.00	-	-
股指期货	3,043,270.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,043,270.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2407	IM2407	3	2,914,800.00	-128,470.00
合计				-128,470.00
减：可抵销期货暂收款				-128,470.00
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	33.98
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	78,497.20

预提审计费	14,918.54
其他应付	9,561.75
合计	103,011.47

6.4.7.7 实收基金

国泰君安中证 1000 优选股票发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	172,275,944.23	172,275,944.23
本期申购	384,670.98	384,670.98
本期赎回（以“-”号填列）	-25,464,709.41	-25,464,709.41
本期末	147,195,905.80	147,195,905.80

国泰君安中证 1000 优选股票发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	68,029,984.73	68,029,984.73
本期申购	719,535.46	719,535.46
本期赎回（以“-”号填列）	-26,277,852.00	-26,277,852.00
本期末	42,471,668.19	42,471,668.19

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

国泰君安中证 1000 优选股票发起 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	-694,189.55	251,300.08	-442,889.47
本期期初	-694,189.55	251,300.08	-442,889.47
本期利润	-8,810,489.02	-7,476,092.77	-
			16,286,581.79
本期基金份额交易产生的变动数	1,416,541.72	-194,661.43	1,221,880.29
其中：基金申购款	-15,171.80	-2,721.82	-17,893.62
基金赎回款	1,431,713.52	-191,939.61	1,239,773.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,088,136.85	-7,419,454.12	-
			15,507,590.97

国泰君安中证 1000 优选股票发起 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	-288,097.73	99,075.76	-189,021.97
本期期初	-288,097.73	99,075.76	-189,021.97
本期利润	-3,910,456.97	-1,598,702.20	-
			5,509,159.17
本期基金份额交易产生的变动数	1,777,130.88	-637,585.99	1,139,544.89
其中：基金申购款	-40,505.37	-3,487.30	-43,992.67
基金赎回款	1,817,636.25	-634,098.69	1,183,537.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,421,423.82	-2,137,212.43	-
			4,558,636.25

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	14,961.37
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	7,295.30
结算备付金利息收入	19,456.25
其他	-
合计	41,712.92

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,252,377,411.86
减：卖出股票成本总额	1,263,624,593.72
减：交易费用	972,022.84
买卖股票差价收入	-12,219,204.70

6.4.7.11 衍生工具收益

6.4.7.11.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	-751,070.00
减：交易费用	5,224.12
合计	-756,294.12

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,467,816.47
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	1,467,816.47

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-8,946,324.97
——股票投资	-8,946,324.97
——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	-128,470.00
——权证投资	-
——期货投资	-128,470.00
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	-9,074,794.97

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	90,252.91
合计	90,252.91

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	14,918.54
信息披露费	70,725.20

证券出借违约金	-
银行汇划费	240.00
合计	85,883.74

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海国泰君安证券资产管理有限公司 (以下简称“国泰君安资管”)	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)	基金托管人、代销机构
国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君安证券”)	基金管理人的股东、代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券	2,488,365,427.18	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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券	186,130.91	100.00%	0.00	0.00%

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,006,394.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	463,360.70
应支付基金管理人的净管理费	543,034.10

注：基金管理人报酬按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的管理人报酬

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人报酬逐日累计至每月月底，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	150,959.24

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费逐日累计至每月月底，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安中证 1000 优选股票发起 A	国泰君安中证 1000 优选股票发起 C	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	83,040.31	83,040.31
上海国泰君安证券资产管理有限公司	-	17,036.11	17,036.11
中国工商银行股份有限公司	-	1,915.19	1,915.19
合计	-	101,991.61	101,991.61

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国泰君安中证 1000 优选股票发起 A

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2023 年 12 月 12 日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	5,009,225.45
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	5,009,225.45
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.40%

国泰君安中证 1000 优选股票发起 C

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2023 年 12 月 12 日）持有的基金份额	-

报告期初持有的基金份额	5,000,225.00
报告期内申购/买入总份额	-
报告期内因拆分变动份额	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	5,000,225.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.77%

注：1. 基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。2. 报告期末持有的本基金份额占基金分类份额比例，比例的分母采用各自类别的份额计算。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行，本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
国泰君安证券股份有限公司	5,367,081.55	7,295.30
中国工商银行股份有限公司	5,229,391.33	14,961.37

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。
2. 本基金的其他存款由基金结算机构国泰君安证券保管，按协议约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301589	诺瓦星云	2024年02月01日	1-6个月(含)	网下新股限售	126.89	188.01	533	37,559.44	100,209.33	-
603350	安乃达	2024年06月26日	5个交易日	新股未上市	20.56	20.56	991	20,374.96	20,374.96	-
301536	星辰科技	2024年03月20日	1-6个月(含)	网下新股限售	16.16	32.27	424	6,851.84	13,682.48	-
688691	灿芯股份	2024年04月02日	1-6个月(含)	网下新股限售	19.86	42.51	222	4,408.92	9,437.22	-
301392	汇成真空	2024年05月28日	1-6个月(含)	网下新股限售	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
688709	成都华微	2024年01月31日	1-6个月(含)	网下新股限售	15.69	18.79	429	6,731.01	8,060.91	-
301580	爱迪特	2024年06月19日	1-6个月(含)	网下新股限售	44.95	65.93	109	4,899.55	7,186.37	-
301539	宏鑫科技	2024年04月03日	1-6个月(含)	网下新股限售	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
001389	广合科技	2024年03月26日	1-6个月(含)	网下新股限售	17.43	34.56	183	3,189.69	6,324.48	-
688530	欧莱新材	2024年04月	1-6个月	网下新股	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-

		月 29 日	(含)	限售						
301588	美新科技	2024 年 03 月 06 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024 年 01 月 26 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
688584	上海合晶	2024 年 02 月 01 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	22.66	15.89	327	7,409.82	5,196.03	-
001359	平安电工	2024 年 03 月 19 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	17.39	20.60	160	2,782.40	3,296.00	-
603375	盛景微	2024 年 01 月 17 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	38.18	38.90	68	2,596.24	2,645.20	-
603344	星德胜	2024 年 03 月 13 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	19.18	22.66	112	2,148.16	2,537.92	-
603381	永臻股份	2024 年 06 月 19 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	23.35	25.13	77	1,797.95	1,935.01	-

注: 1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300630	普利制药	2024-05-06	-	12.35	2024-07-08	9.88	6,900	93,881.20	85,215.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了由董事会（含内部控制委员会）、经营管理层（含风险控制委员会、首席风险官）、风险管理部门，以及业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司，其他银行存款为国泰君安证券券商保证金，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2023 年 12 月 31 日：本基金未持有信用类债券)。

6.4.13.3 流动性风险

“流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。”

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持证券均在证券交易所交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足

额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金、结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	10,596,472.88	-	-	-	10,596,472.88
结算备付金	1,790,833.93	-	-	-	1,790,833.93
存出保证金	349,776.00	-	-	-	349,776.00
交易性金融资产	-	-	-	157,163,697.08	157,163,697.08
应收申购款	-	-	-	916.26	916.26
资产总计	12,737,082.81	-	-	157,164,613.34	169,901,696.15
负债					
应付赎回款	-	-	-	17,868.07	17,868.07
应付管理人报酬	-	-	-	144,797.52	144,797.52
应付托管费	-	-	-	21,719.65	21,719.65
应付销售服	-	-	-	12,952.67	12,952.67

务费					
其他负债	-	-	-	103,011.47	103,011.47
负债总计	-	-	-	300,349.38	300,349.38
利率敏感度 缺口	12,737,082.8 1	-	-	156,864,263.9 6	169,601,346.7 7
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	36,782,079.6 3	-	-	-	36,782,079.63
结算备付金	10,005,917.8 0	-	-	-	10,005,917.80
交易性金融 资产	-	-	-	193,049,949.4 1	193,049,949.4 1
资产总计	46,787,997.4 3	-	-	193,049,949.4 1	239,837,946.8 4
负债					
应付管理人 报酬	-	-	-	123,617.42	123,617.42
应付托管费	-	-	-	18,542.61	18,542.61
应付销售服 务费	-	-	-	13,997.29	13,997.29
其他负债	-	-	-	7,772.00	7,772.00
负债总计	-	-	-	163,929.32	163,929.32
利率敏感度 缺口	46,787,997.4 3	-	-	192,886,020.0 9	239,674,017.5 2

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例 0.00% (2023 年 12 月 31 日: 0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2023 年 12 月 31 日: 同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	157,163,697.08	92.67	193,049,949.41	80.55
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	157,163,697.08	92.67	193,049,949.41	80.55

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2024 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 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	156,865,097.42	192,984,499.41
第二层次	105,589.96	65,450.00
第三层次	193,009.70	-
合计	157,163,697.08	193,049,949.41

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	157,163,697.08	92.50

	其中：股票	157,163,697.08	92.50
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	12,387,306.81	7.29
8	其他各项资产	350,692.26	0.21
9	合计	169,901,696.15	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 0.00 元，占期末净值的比例为 0.00%；通过转融通证券出借业务的证券公允价值为 0.00 元，占资产净值的比例为 0.00%。

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	610,963.00	0.36
B	采矿业	4,194,472.00	2.47
C	制造业	109,132,026.02	64.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,137,316.00	4.21
E	建筑业	1,349,658.00	0.80
F	批发和零售业	3,120,857.20	1.84
G	交通运输、仓储和邮政业	5,956,657.00	3.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,901,191.86	10.55
J	金融业	1,115,326.65	0.66
K	房地产业	1,990,892.00	1.17
L	租赁和商务服务业	1,651,154.00	0.97
M	科学研究和技术服务业	1,803,234.35	1.06
N	水利、环境和公共设施管理业	513,151.00	0.30
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	672,758.00	0.40
S	综合	14,040.00	0.01
	合计	157,163,697.08	92.67

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	002468	申通快递	194,400	1,632,960.00	0.96
2	300735	光弘科技	74,300	1,604,880.00	0.95
3	002292	奥飞娱乐	256,663	1,534,844.74	0.90
4	300229	拓尔思	112,900	1,516,247.00	0.89
5	002020	京新药业	144,300	1,510,821.00	0.89
6	600596	新安股份	190,600	1,448,560.00	0.85
7	688088	虹软科技	49,400	1,425,684.00	0.84
8	601311	骆驼股份	177,300	1,421,946.00	0.84
9	600420	国药现代	131,200	1,401,216.00	0.83
10	002237	恒邦股份	120,600	1,388,106.00	0.82
11	003021	兆威机电	29,800	1,375,270.00	0.81
12	688586	江航飞机装备	145,401	1,352,229.30	0.80
13	002245	蔚蓝锂芯	170,200	1,319,050.00	0.78
14	000969	安泰科技	166,100	1,317,173.00	0.78
15	600602	云赛智联	118,200	1,304,928.00	0.77
16	600006	东风汽车	185,800	1,187,262.00	0.70
17	000600	建投能源	187,500	1,181,250.00	0.70
18	002100	天康生物	170,200	1,179,486.00	0.70
19	600718	东软集团	141,100	1,166,897.00	0.69
20	002378	章源钨业	200,300	1,149,722.00	0.68
21	000913	钱江摩托	72,500	1,142,600.00	0.67
22	002241	歌尔股份	58,400	1,139,384.00	0.67
23	300463	迈克生物	99,400	1,131,172.00	0.67
24	600428	中远海特	184,500	1,129,140.00	0.67
25	603013	亚普股份	81,300	1,095,111.00	0.65
26	603328	依顿电子	137,800	1,083,108.00	0.64
27	300747	锐科激光	60,800	1,079,200.00	0.64
28	000758	中色股份	205,900	1,045,972.00	0.62

29	300034	钢研高纳	64,900	1,031,261.00	0.61
30	300113	顺网科技	100,000	1,024,000.00	0.60
31	002351	漫步者	77,800	1,023,070.00	0.60
32	003039	顺控发展	80,600	1,009,918.00	0.60
33	301262	海看股份	44,300	998,965.00	0.59
34	600335	国机汽车	171,900	991,863.00	0.58
35	688380	中微半导	59,074	987,717.28	0.58
36	002534	西子洁能	97,800	978,978.00	0.58
37	002906	华阳集团	36,300	971,388.00	0.57
38	688289	圣湘生物	55,001	966,917.58	0.57
39	300233	金城医药	64,500	962,340.00	0.57
40	002249	大洋电机	202,400	957,352.00	0.56
41	300634	彩讯股份	56,500	950,895.00	0.56
42	300768	迪普科技	80,200	950,370.00	0.56
43	002036	联创电子	140,700	949,725.00	0.56
44	300725	药石科技	35,300	944,981.00	0.56
45	003816	中国广核	195,800	906,554.00	0.53
46	002267	陕天然气	119,400	902,664.00	0.53
47	002550	千红制药	166,900	899,591.00	0.53
48	688362	甬矽电子	46,124	897,573.04	0.53
49	002422	科伦药业	29,500	894,735.00	0.53
50	600480	凌云股份	90,300	887,649.00	0.52
51	002010	传化智联	230,600	885,504.00	0.52
52	002946	新乳业	100,800	883,008.00	0.52
53	300620	光库科技	23,900	879,042.00	0.52
54	300596	利安隆	32,200	873,586.00	0.52
55	300660	江苏雷利	33,500	854,920.00	0.50
56	301171	易点天下	57,700	848,190.00	0.50
57	300031	宝通科技	57,200	821,964.00	0.48
58	300741	华宝股份	53,700	818,388.00	0.48
59	002446	盛路通信	144,700	817,555.00	0.48
60	300482	万孚生物	33,500	817,400.00	0.48
61	001338	永顺泰	82,600	809,480.00	0.48
62	300973	立高食品	28,700	806,183.00	0.48
63	603229	奥翔药业	80,032	804,321.60	0.47
64	688123	聚辰半导体	13,200	802,956.00	0.47
65	688208	道通科技	32,454	783,439.56	0.46
66	603299	苏盐井神	82,200	780,900.00	0.46
67	300773	拉卡拉	62,400	775,632.00	0.46
68	000830	鲁西化工	66,600	771,894.00	0.46
69	603212	赛伍技术	69,400	766,176.00	0.45
70	300737	科顺股份	174,200	749,060.00	0.44
71	603169	兰石重装	164,500	740,250.00	0.44

72	002120	韵达股份	93,800	726,012.00	0.43
73	688127	蓝特光学	39,433	725,172.87	0.43
74	000725	京东方 A	176,200	720,658.00	0.42
75	002706	良信股份	104,600	717,556.00	0.42
76	300821	东岳硅材	104,200	712,728.00	0.42
77	600559	老白干酒	38,900	707,202.00	0.42
78	600736	苏州高新	168,600	701,376.00	0.41
79	002519	银河电子	136,800	671,688.00	0.40
80	002612	朗姿股份	48,300	667,506.00	0.39
81	000930	中粮科技	131,600	661,948.00	0.39
82	002023	海特高新	71,900	657,885.00	0.39
83	605507	国邦医药	39,000	649,350.00	0.38
84	688128	中国电器研究 院	37,361	642,982.81	0.38
85	301260	格力博	46,900	638,778.00	0.38
86	000795	英洛华	115,300	638,762.00	0.38
87	001213	中铁特货	159,300	629,235.00	0.37
88	002897	意华股份	16,500	621,390.00	0.37
89	601038	一拖股份	39,200	619,752.00	0.37
90	688336	三生国健	30,443	619,515.05	0.37
91	000735	罗牛山	141,100	610,963.00	0.36
92	601101	昊华能源	64,600	593,674.00	0.35
93	002635	安洁科技	38,000	586,720.00	0.35
94	300045	华力创通	32,900	580,685.00	0.34
95	601877	正泰电器	30,400	579,424.00	0.34
96	601069	西部黄金	49,300	573,359.00	0.34
97	301316	慧博云通	39,000	572,520.00	0.34
98	600562	国睿科技	41,200	562,792.00	0.33
99	601001	晋控煤业	34,000	561,680.00	0.33
100	688141	杰华特微电子	34,400	555,904.00	0.33
101	000555	神州信息	59,200	551,744.00	0.33
102	002990	盛视科技	27,300	549,549.00	0.32
103	002777	久远银海	36,600	548,634.00	0.32
104	000837	秦川机床	74,400	547,584.00	0.32
105	600761	安徽合力	25,000	541,000.00	0.32
106	301071	力量钻石	19,300	534,803.00	0.32
107	002139	拓邦股份	50,000	531,000.00	0.31
108	603896	寿仙谷	22,500	528,075.00	0.31
109	000517	荣安地产	195,900	525,012.00	0.31
110	603693	江苏新能	44,700	519,414.00	0.31
111	688389	深圳普门科技	31,866	518,141.16	0.31
112	300303	聚飞光电	106,369	516,953.34	0.30
113	603055	台华新材	50,700	513,591.00	0.30

114	603098	森特股份	64,800	509,328.00	0.30
115	603118	共进股份	75,900	508,530.00	0.30
116	600409	三友化工	97,800	490,956.00	0.29
117	000990	诚志股份	65,400	486,576.00	0.29
118	002539	云图控股	67,100	478,423.00	0.28
119	002145	中核钛白	144,400	473,632.00	0.28
120	000568	泸州老窖	3,300	473,517.00	0.28
121	600929	雪天盐业	89,300	473,290.00	0.28
122	301327	华宝新能	8,250	472,725.00	0.28
123	688776	国光电气	8,456	468,462.40	0.28
124	002034	旺能环境	36,000	468,360.00	0.28
125	600362	江西铜业	19,400	459,392.00	0.27
126	002043	兔宝宝	44,200	458,354.00	0.27
127	600048	保利发展	52,200	457,272.00	0.27
128	603025	大豪科技	32,500	449,150.00	0.26
129	600578	京能电力	138,100	447,444.00	0.26
130	300624	万兴科技	8,300	440,481.00	0.26
131	603823	百合花	44,700	432,249.00	0.25
132	300638	广和通	25,200	430,920.00	0.25
133	601991	大唐发电	141,700	426,517.00	0.25
134	300602	飞荣达	27,700	418,547.00	0.25
135	002274	华昌化工	55,700	413,294.00	0.24
136	300039	上海凯宝	77,100	412,485.00	0.24
137	300674	宇信科技	36,700	406,636.00	0.24
138	000810	创维数字	47,200	404,976.00	0.24
139	603489	DR 八方股份	14,800	399,304.00	0.24
140	000524	岭南控股	49,400	398,164.00	0.23
141	002215	诺普信	53,300	397,085.00	0.23
142	000065	北方国际	38,100	395,097.00	0.23
143	600468	百利电气	90,100	388,331.00	0.23
144	002320	海峡股份	74,900	386,484.00	0.23
145	688209	英集芯科技	30,625	380,056.25	0.22
146	002913	奥士康	13,900	372,659.00	0.22
147	600125	铁龙物流	62,400	372,528.00	0.22
148	600750	江中药业	16,100	372,071.00	0.22
149	300047	天源迪科	56,000	366,240.00	0.22
150	600389	江山股份	25,800	364,038.00	0.21
151	002773	康弘药业	16,800	363,720.00	0.21
152	601633	长城汽车	14,300	361,790.00	0.21
153	688007	光峰科技	22,054	355,069.40	0.21
154	600459	贵研铂业	26,000	351,260.00	0.21
155	300115	长盈精密	28,104	336,966.96	0.20
156	002993	奥海科技	9,000	334,800.00	0.20

157	601375	中原证券	97,400	332,134.00	0.20
158	600096	云天化	17,100	332,082.00	0.20
159	000035	中国天楹	72,000	326,160.00	0.19
160	600812	华北制药	78,900	325,068.00	0.19
161	000821	京山轻机	28,600	324,038.00	0.19
162	688378	奥来德光电	13,676	320,838.96	0.19
163	002757	南兴股份	26,400	318,120.00	0.19
164	002242	九阳股份	30,300	317,544.00	0.19
165	002646	天佑德酒	31,000	317,130.00	0.19
166	688239	贵州航宇科技	9,023	314,000.40	0.19
167	301080	百普赛斯	8,900	311,500.00	0.18
168	603297	永新光学	5,100	308,499.00	0.18
169	002782	可立克	27,800	308,024.00	0.18
170	600269	赣粤高速	59,000	305,030.00	0.18
171	600019	宝钢股份	45,800	304,570.00	0.18
172	688313	仕佳光子	31,273	297,718.96	0.18
173	601222	林洋能源	47,200	295,944.00	0.17
174	600028	中国石化	46,200	291,984.00	0.17
175	603766	隆鑫通用	43,000	291,540.00	0.17
176	002026	山东威达	34,200	283,860.00	0.17
177	600027	华电国际	40,900	283,846.00	0.17
178	002925	盈趣科技	22,400	283,808.00	0.17
179	002449	国星光电	39,800	283,376.00	0.17
180	300134	大富科技	40,800	278,256.00	0.16
181	300783	三只松鼠	12,500	273,375.00	0.16
182	002537	海联金汇	52,500	271,425.00	0.16
183	603308	应流股份	21,800	270,756.00	0.16
184	688105	XD 诺唯赞生物	13,500	270,135.00	0.16
185	002054	德美化工	55,000	270,050.00	0.16
186	300188	国投智能	24,300	269,973.00	0.16
187	300232	洲明科技	51,700	269,874.00	0.16
188	600011	华能国际	27,700	266,474.00	0.16
189	601888	中国中免	4,200	262,458.00	0.15
190	603888	新华网	12,000	258,120.00	0.15
191	600617	国新能源	103,120	257,800.00	0.15
192	300182	捷成股份	69,000	255,990.00	0.15
193	600610	中毅达	64,300	255,914.00	0.15
194	600916	中国黄金	26,400	253,968.00	0.15
195	002907	华森制药	20,100	253,662.00	0.15
196	600809	山西汾酒	1,200	253,056.00	0.15
197	600717	天津港	58,100	248,087.00	0.15
198	600572	康恩贝	55,500	248,085.00	0.15

199	605369	拱东医疗	6,200	247,380.00	0.15
200	600062	华润双鹤	12,400	242,792.00	0.14
201	300170	汉得信息	39,500	242,530.00	0.14
202	688183	生益电子	12,510	242,443.80	0.14
203	600776	东方通信	24,400	239,852.00	0.14
204	601668	中国建筑	45,100	239,481.00	0.14
205	603348	文灿股份	8,600	238,134.00	0.14
206	002204	大连重工	55,600	237,412.00	0.14
207	000630	铜陵有色	64,800	233,928.00	0.14
208	600577	精达股份	58,100	230,657.00	0.14
209	688315	诺禾致源科技	21,030	229,647.60	0.14
210	601890	亚星锚链	32,400	228,420.00	0.13
211	600971	恒源煤电	18,800	224,472.00	0.13
212	000928	中钢国际	40,200	223,110.00	0.13
213	002601	龙佰集团	11,800	219,126.00	0.13
214	601801	皖新传媒	31,200	216,216.00	0.13
215	002128	电投能源	10,200	215,220.00	0.13
216	002191	劲嘉股份	59,300	214,073.00	0.13
217	300573	兴齐眼药	1,300	213,200.00	0.13
218	688403	汇成股份	25,100	212,848.00	0.13
219	002901	大博医疗	8,200	211,806.00	0.12
220	301078	孩子王	41,600	210,496.00	0.12
221	600210	紫江企业	39,300	209,076.00	0.12
222	688352	颀中科技	18,300	208,803.00	0.12
223	603501	韦尔股份	2,100	208,677.00	0.12
224	002004	华邦健康	54,800	208,240.00	0.12
225	002206	海利得	54,400	207,808.00	0.12
226	300408	三环集团	7,100	207,249.00	0.12
227	600789	鲁抗医药	29,600	207,200.00	0.12
228	688116	天奈科技	8,900	205,412.00	0.12
229	002642	荣联科技	39,700	204,852.00	0.12
230	601168	西部矿业	11,400	204,630.00	0.12
231	002545	东方铁塔	29,900	203,619.00	0.12
232	600601	方正科技	65,800	197,400.00	0.12
233	301301	川宁生物	15,400	196,812.00	0.12
234	600201	生物股份	26,700	192,507.00	0.11
235	688531	日联科技股份	4,150	191,564.00	0.11
236	688249	晶合集成	13,000	190,710.00	0.11
237	688800	瑞可达连接系统	6,772	190,157.76	0.11
238	300257	开山股份	18,800	189,880.00	0.11
239	000538	云南白药	3,700	189,255.00	0.11
240	002727	一心堂	12,500	188,625.00	0.11

241	000960	锡业股份	12,100	187,429.00	0.11
242	688432	有研硅	19,326	187,268.94	0.11
243	605020	永和股份	9,700	186,046.00	0.11
244	002617	露笑科技	38,400	184,320.00	0.11
245	002046	国机精工	17,800	181,026.00	0.11
246	002315	焦点科技	6,700	180,632.00	0.11
247	002265	建设工业	20,900	180,367.00	0.11
248	603610	麒盛科技	18,200	179,816.00	0.11
249	300403	汉字集团	25,700	175,531.00	0.10
250	600367	红星发展	17,700	175,407.00	0.10
251	002745	木林森	21,500	173,290.00	0.10
252	601186	中国铁建	20,100	172,257.00	0.10
253	600623	华谊集团	29,100	168,198.00	0.10
254	300841	康华生物	3,300	167,112.00	0.10
255	000690	宝新能源	32,700	166,770.00	0.10
256	002097	山河智能	27,500	165,825.00	0.10
257	600933	爱柯迪	11,000	162,690.00	0.10
258	300035	中科电气	18,600	158,286.00	0.09
259	603881	数据港	12,414	157,781.94	0.09
260	600612	老凤祥	2,700	157,113.00	0.09
261	002587	奥拓电子	29,200	157,096.00	0.09
262	600963	岳阳林纸	42,800	157,076.00	0.09
263	002896	中大力德	5,600	156,240.00	0.09
264	600158	中体产业	20,300	156,107.00	0.09
265	002577	雷柏科技	12,600	155,862.00	0.09
266	600031	三一重工	9,400	155,100.00	0.09
267	601600	中国铝业	20,300	154,889.00	0.09
268	603790	雅运股份	16,100	154,560.00	0.09
269	300017	网宿科技	19,000	150,100.00	0.09
270	300772	运达股份	15,400	147,840.00	0.09
271	688472	阿特斯阳光电 力	14,466	147,263.88	0.09
272	002701	奥瑞金	35,000	145,600.00	0.09
273	002416	爱施德	16,400	145,140.00	0.09
274	300381	溢多利	23,600	144,904.00	0.09
275	603306	华懋科技	8,000	144,560.00	0.09
276	301408	华人健康	14,100	144,243.00	0.09
277	301069	凯盛新材	11,000	144,210.00	0.09
278	600869	远东股份	41,300	144,137.00	0.08
279	688498	源杰科技	1,100	144,089.00	0.08
280	600787	中储股份	29,800	143,338.00	0.08
281	600183	生益科技	6,800	143,208.00	0.08
282	300539	横河精密	17,600	141,680.00	0.08

283	002106	莱宝高科	12,800	139,520.00	0.08
284	601952	苏垦农发	15,200	137,104.00	0.08
285	600587	新华医疗	8,700	136,938.00	0.08
286	600819	耀皮玻璃	31,600	133,352.00	0.08
287	300672	国科微	2,500	132,100.00	0.08
288	600908	无锡银行	24,500	130,340.00	0.08
289	301175	中科环保	29,500	129,505.00	0.08
290	002284	亚太股份	19,100	129,116.00	0.08
291	603367	辰欣药业	9,200	128,248.00	0.08
292	600223	福瑞达	17,200	121,604.00	0.07
293	603915	国茂股份	11,800	121,422.00	0.07
294	600064	南京高科	20,000	121,400.00	0.07
295	601969	海南矿业	18,500	117,290.00	0.07
296	688195	腾景科技	4,724	115,785.24	0.07
297	002332	仙琚制药	10,000	114,100.00	0.07
298	000042	中洲控股	28,400	112,180.00	0.07
299	000828	东莞控股	12,200	109,922.00	0.06
300	600993	马应龙	4,000	106,680.00	0.06
301	000426	兴业银锡	7,800	105,924.00	0.06
302	300226	上海钢联	6,200	105,028.00	0.06
303	002613	北玻股份	29,600	103,008.00	0.06
304	603983	丸美股份	3,700	101,861.00	0.06
305	301589	诺瓦星云	533	100,209.33	0.06
306	688383	新益昌科技	1,900	99,009.00	0.06
307	605228	神通科技	11,500	98,670.00	0.06
308	002135	东南网架	24,800	98,208.00	0.06
309	601163	三角轮胎	6,400	97,408.00	0.06
310	300206	理邦仪器	11,200	96,208.00	0.06
311	603883	老百姓	5,170	94,921.20	0.06
312	603920	世运电路	4,800	94,752.00	0.06
313	002099	海翔药业	18,400	94,024.00	0.06
314	000034	神州数码	4,100	93,849.00	0.06
315	000019	深粮控股	16,200	92,988.00	0.05
316	002399	海普瑞	10,700	92,769.00	0.05
317	300451	创业慧康	26,500	91,690.00	0.05
318	002825	纳尔股份	14,500	90,335.00	0.05
319	601126	四方股份	4,700	90,334.00	0.05
320	603998	方盛制药	8,700	89,349.00	0.05
321	600406	国电南瑞	3,500	87,360.00	0.05
322	002312	川发龙蟒	12,900	86,817.00	0.05
323	603309	维力医疗	7,800	85,878.00	0.05
324	002467	二六三	25,600	85,504.00	0.05
325	300630	普利制药	6,900	85,215.00	0.05

326	002075	沙钢股份	22,383	84,383.91	0.05
327	601068	中铝国际	19,800	83,358.00	0.05
328	300755	华致酒行	6,100	83,326.00	0.05
329	603595	东尼电子	4,000	82,360.00	0.05
330	603399	吉翔股份	13,300	82,327.00	0.05
331	601137	博威合金	5,400	82,296.00	0.05
332	688055	昆山龙腾光电	25,900	82,103.00	0.05
333	002837	英维克	3,800	81,282.00	0.05
334	600030	中信证券	4,400	80,212.00	0.05
335	603203	XD 快克智能	3,400	80,172.00	0.05
336	601229	上海银行	11,000	79,860.00	0.05
337	688381	帝奥微电子	4,078	79,439.44	0.05
338	600682	南京新百	15,800	78,842.00	0.05
339	300409	道氏技术	9,200	78,752.00	0.05
340	301087	可孚医疗	2,300	77,970.00	0.05
341	603195	公牛集团	1,000	77,120.00	0.05
342	000567	海德股份	13,665	76,660.65	0.05
343	601898	中煤能源	6,100	76,128.00	0.04
344	600549	厦门钨业	4,400	75,900.00	0.04
345	300709	精研科技	3,000	75,840.00	0.04
346	601319	中国人保	14,700	75,705.00	0.04
347	600771	广誉远	4,000	75,320.00	0.04
348	301219	腾远钴业	1,900	72,694.00	0.04
349	002171	楚江新材	11,000	72,490.00	0.04
350	603897	长城科技	4,100	71,955.00	0.04
351	600021	上海电力	7,200	71,208.00	0.04
352	688508	芯朋微电子	1,931	70,230.47	0.04
353	300684	中石科技	4,000	69,360.00	0.04
354	301155	海力风电	1,700	68,391.00	0.04
355	600315	上海家化	3,800	67,564.00	0.04
356	002068	黑猫股份	9,500	67,450.00	0.04
357	600497	驰宏锌锗	12,500	66,750.00	0.04
358	603368	柳药集团	3,800	66,500.00	0.04
359	300738	奥飞数据	6,500	65,780.00	0.04
360	000066	中国长城	7,500	65,625.00	0.04
361	603162	海通发展	7,000	65,100.00	0.04
362	603733	仙鹤股份	3,700	65,046.00	0.04
363	600863	内蒙华电	13,900	64,496.00	0.04
364	600015	华夏银行	10,000	64,000.00	0.04
365	603936	博敏电子	7,600	63,840.00	0.04
366	603198	迎驾贡酒	1,100	63,250.00	0.04
367	601975	招商南油	17,600	63,184.00	0.04
368	000786	北新建材	2,100	62,286.00	0.04

369	601225	陕西煤业	2,300	59,271.00	0.03
370	300909	汇创达	2,600	58,084.00	0.03
371	600475	华光环能	6,600	57,486.00	0.03
372	300348	长亮科技	8,400	57,288.00	0.03
373	600586	金晶科技	9,700	56,260.00	0.03
374	600502	安徽建工	13,000	55,900.00	0.03
375	603678	火炬电子	2,200	54,318.00	0.03
376	300953	震裕科技	1,000	54,200.00	0.03
377	601336	新华保险	1,800	54,054.00	0.03
378	601318	中国平安	1,300	53,768.00	0.03
379	002567	唐人神	9,900	53,064.00	0.03
380	600033	福建高速	15,500	51,925.00	0.03
381	000920	沃顿科技	7,000	51,310.00	0.03
382	688150	莱特光电股份	2,600	50,440.00	0.03
383	300382	斯莱克	8,500	50,235.00	0.03
384	601016	节能风电	16,800	50,232.00	0.03
385	002340	格林美	7,800	49,686.00	0.03
386	600325	华发股份	7,600	49,400.00	0.03
387	600727	鲁北化工	7,600	47,880.00	0.03
388	000565	渝三峡 A	11,500	46,345.00	0.03
389	688279	峰昭科技	400	44,360.00	0.03
390	600320	振华重工	12,900	44,118.00	0.03
391	600141	兴发集团	2,300	43,884.00	0.03
392	600556	天下秀	11,900	43,316.00	0.03
393	300357	我武生物	2,100	42,462.00	0.03
394	600391	航发科技	2,700	41,175.00	0.02
395	601333	广深铁路	12,700	41,148.00	0.02
396	688475	萤石网络	1,200	40,932.00	0.02
397	300428	立中集团	2,200	40,898.00	0.02
398	601187	厦门银行	7,600	40,508.00	0.02
399	600449	宁夏建材	3,300	38,775.00	0.02
400	601116	三江购物	5,000	38,050.00	0.02
401	002544	普天科技	2,000	37,380.00	0.02
402	601369	陕鼓动力	4,600	36,892.00	0.02
403	603186	华正新材	1,500	35,670.00	0.02
404	300049	福瑞股份	700	35,238.00	0.02
405	002961	瑞达期货	3,200	35,040.00	0.02
406	688601	力芯微股份	800	34,952.00	0.02
407	605589	圣泉集团	1,700	34,493.00	0.02
408	002182	宝武镁业	3,000	33,840.00	0.02
409	603103	横店影视	2,400	33,216.00	0.02
410	600648	外高桥	3,600	31,896.00	0.02
411	600864	哈投股份	6,700	31,825.00	0.02

412	603919	金徽酒	1,700	30,889.00	0.02
413	603267	鸿远电子	900	30,690.00	0.02
414	002051	中工国际	4,400	30,624.00	0.02
415	605111	新洁能	1,000	30,590.00	0.02
416	600163	中闽能源	6,300	30,366.00	0.02
417	600835	上海机电	2,600	29,926.00	0.02
418	002294	信立泰	1,100	29,293.00	0.02
419	605018	长华集团	3,200	28,992.00	0.02
420	002876	三利谱	1,200	28,944.00	0.02
421	600509	天富能源	5,200	28,652.00	0.02
422	600018	上港集团	4,800	27,744.00	0.02
423	600366	宁波韵升	5,300	27,666.00	0.02
424	600961	株冶集团	2,800	26,432.00	0.02
425	003035	南网能源	5,900	25,960.00	0.02
426	000917	电广传媒	5,100	25,755.00	0.02
427	300587	天铁股份	6,300	25,452.00	0.02
428	000063	中兴通讯	900	25,173.00	0.01
429	688019	安集科技	200	25,160.00	0.01
430	603317	天味食品	2,200	25,102.00	0.01
431	688233	神工半导体	1,300	25,051.00	0.01
432	300176	派生科技	5,600	24,696.00	0.01
433	601577	长沙银行	3,000	24,540.00	0.01
434	600285	羚锐制药	1,000	24,210.00	0.01
435	600023	浙能电力	3,400	24,174.00	0.01
436	600645	中源协和	1,500	24,150.00	0.01
437	600531	豫光金铅	3,600	23,184.00	0.01
438	002349	精华制药	3,500	22,960.00	0.01
439	601677	明泰铝业	1,900	21,964.00	0.01
440	000001	平安银行	2,100	21,315.00	0.01
441	603350	C安乃达	991	20,374.96	0.01
442	688138	清溢光电	932	20,038.00	0.01
443	603633	徕木股份	2,500	19,775.00	0.01
444	600252	中恒集团	9,100	19,747.00	0.01
445	000975	银泰黄金	1,200	19,548.00	0.01
446	600400	红豆股份	9,000	19,530.00	0.01
447	601121	宝地矿业	3,400	19,346.00	0.01
448	600619	海立股份	3,400	17,578.00	0.01
449	688093	世华科技	957	17,388.69	0.01
450	300432	富临精工	2,700	17,388.00	0.01
451	003040	楚天龙	1,400	17,220.00	0.01
452	688363	华熙生物	302	17,084.14	0.01
453	300687	赛意信息	1,200	16,704.00	0.01
454	600814	杭州解百	2,800	16,520.00	0.01

455	000738	航发控制	800	16,056.00	0.01
456	002434	万里扬	3,200	15,680.00	0.01
457	002061	浙江交科	4,220	15,403.00	0.01
458	002244	滨江集团	2,100	15,246.00	0.01
459	600523	贵航股份	1,500	14,850.00	0.01
460	300505	川金诺	1,200	14,628.00	0.01
461	688182	灿勤科技	1,100	14,564.00	0.01
462	601669	中国电建	2,600	14,534.00	0.01
463	601231	环旭电子	900	14,445.00	0.01
464	603056	德邦股份	1,100	14,410.00	0.01
465	000833	粤桂股份	3,000	14,040.00	0.01
466	301536	星辰科技	424	13,682.48	0.01
467	300003	乐普医疗	900	13,356.00	0.01
468	000030	富奥股份	2,600	12,766.00	0.01
469	002125	湘潭电化	1,300	12,649.00	0.01
470	600882	妙可蓝多	1,000	12,470.00	0.01
471	002406	远东传动	2,500	12,325.00	0.01
472	600760	中航沈飞	300	12,030.00	0.01
473	300758	七彩化学	1,100	11,825.00	0.01
474	002511	中顺洁柔	1,700	11,764.00	0.01
475	601949	中国出版	1,900	11,229.00	0.01
476	601619	嘉泽新能	3,600	10,908.00	0.01
477	300140	节能环境	1,800	10,746.00	0.01
478	600810	XD 神马股份	1,700	10,540.00	0.01
479	000429	粤高速 A	1,000	10,410.00	0.01
480	601857	中国石油	1,000	10,320.00	0.01
481	600308	华泰股份	3,200	10,048.00	0.01
482	002423	中粮资本	1,300	9,737.00	0.01
483	600025	华能水电	900	9,702.00	0.01
484	688691	灿芯半导体股份	222	9,437.22	0.01
485	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.01
486	600458	时代新材	900	9,090.00	0.01
487	603439	贵州三力	700	8,932.00	0.01
488	000968	蓝焰控股	1,400	8,904.00	0.01
489	002779	中坚科技	300	8,502.00	0.01
490	605333	沪光股份	300	8,355.00	0.00
491	300068	南都电源	1,000	8,280.00	0.00
492	688709	成都华微	429	8,060.91	0.00
493	002845	同兴达	600	7,932.00	0.00
494	002264	新华都	1,500	7,665.00	0.00
495	603345	安井食品	100	7,431.00	0.00
496	603496	恒为科技	300	7,335.00	0.00

497	301580	爱迪特	109	7,186.37	0.00
498	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
499	601500	通用股份	1,300	6,942.00	0.00
500	300887	谱尼测试	900	6,660.00	0.00
501	002048	宁波华翔	500	6,470.00	0.00
502	001389	广合科技	183	6,324.48	0.00
503	001979	招商蛇口	700	6,153.00	0.00
504	601728	中国电信	1,000	6,150.00	0.00
505	688046	药康生物	600	6,132.00	0.00
506	000875	吉电股份	1,100	5,863.00	0.00
507	002276	万马股份	800	5,736.00	0.00
508	002839	张家港行	1,400	5,628.00	0.00
509	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
510	603296	华勤技术	100	5,523.00	0.00
511	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
512	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
513	688584	上海合晶硅材料	327	5,196.03	0.00
514	603266	天龙股份	300	5,076.00	0.00
515	002225	濮耐股份	1,200	4,908.00	0.00
516	002212	天融信	1,000	4,870.00	0.00
517	002959	小熊电器	100	4,811.00	0.00
518	688259	创耀通信科技	120	4,795.20	0.00
519	002967	广电计量	400	4,720.00	0.00
520	600979	广安爱众	1,400	4,704.00	0.00
521	600488	津药药业	1,300	4,459.00	0.00
522	688626	翔宇医疗	138	4,380.12	0.00
523	300260	新莱应材	200	4,188.00	0.00
524	000650	仁和药业	700	4,130.00	0.00
525	002140	东华科技	500	3,875.00	0.00
526	000657	中钨高新	400	3,656.00	0.00
527	300457	赢合科技	200	3,566.00	0.00
528	001359	平安电工	160	3,296.00	0.00
529	002651	利君股份	600	3,294.00	0.00
530	601216	君正集团	800	2,952.00	0.00
531	000926	福星股份	900	2,853.00	0.00
532	688408	中信博新能源	29	2,670.32	0.00
533	603375	盛景微电子	68	2,645.20	0.00
534	603344	星德胜科技	112	2,537.92	0.00
535	688561	奇安信集团	101	2,385.62	0.00
536	688372	伟测科技	50	1,966.50	0.00
537	603381	永臻股份	77	1,935.01	0.00
538	601800	中国交建	200	1,788.00	0.00

539	600990	四创电子	100	1,755.00	0.00
540	000551	创元科技	200	1,746.00	0.00
541	000060	中金岭南	400	1,696.00	0.00
542	688222	成都先导	135	1,532.25	0.00
543	688232	国泰新点软件	32	631.04	0.00
544	688317	上海之江生物	41	590.81	0.00
545	688312	燕麦科技	24	582.00	0.00
546	688252	天德钰科技	29	421.37	0.00
547	688247	宣泰医药	34	279.48	0.00
548	688503	聚和材料股份 公司	9	252.90	0.00
549	688510	航亚科技	11	202.51	0.00
550	688219	会通股份	20	155.40	0.00
551	688433	华曙高科	5	104.30	0.00
552	688101	三达膜环境技 术	6	68.28	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	000555	神州信息	4,019,965.00	1.68
2	600602	云赛智联	3,869,349.00	1.61
3	688128	中国电器研究 院	3,864,723.00	1.61
4	000600	建投能源	3,680,587.00	1.54
5	688183	生益电子	3,569,393.93	1.49
6	600776	东方通信	3,542,577.00	1.48
7	300735	光弘科技	3,493,614.00	1.46
8	300233	金城医药	3,386,456.00	1.41
9	300229	拓尔思	3,345,581.00	1.40
10	603013	亚普股份	3,289,390.00	1.37
11	601633	长城汽车	3,262,241.00	1.36
12	002292	奥飞娱乐	3,218,898.05	1.34
13	000969	安泰科技	3,196,869.00	1.33
14	002468	申通快递	3,120,104.00	1.30
15	600028	中国石化	3,089,127.00	1.29
16	600812	华北制药	3,057,640.00	1.28
17	603299	苏盐井神	3,025,958.00	1.26
18	000550	江铃汽车	2,973,073.00	1.24

19	002757	南兴股份	2,957,451.00	1.23
20	000810	创维数字	2,956,586.00	1.23

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	000555	神州信息	4,074,192.00	1.70
2	688183	生益电子	3,855,116.32	1.61
3	688128	中国电器研究院	3,794,358.29	1.58
4	600776	东方通信	3,708,037.99	1.55
5	300476	胜宏科技	3,618,517.00	1.51
6	000550	江铃汽车	3,604,861.00	1.50
7	601019	山东出版	3,418,534.00	1.43
8	601633	长城汽车	3,390,960.00	1.41
9	600028	中国石化	3,368,888.00	1.41
10	600966	博汇纸业	3,311,012.00	1.38
11	002773	康弘药业	3,254,192.00	1.36
12	600812	华北制药	3,254,125.00	1.36
13	002895	川恒股份	3,209,117.00	1.34
14	601801	皖新传媒	3,169,828.00	1.32
15	601068	中铝国际	3,164,137.00	1.32
16	301165	锐捷网络	3,157,158.00	1.32
17	002913	奥士康	3,150,173.00	1.31
18	002204	大连重工	3,115,851.00	1.30
19	601949	中国出版	2,991,520.00	1.25
20	601118	海南橡胶	2,948,371.75	1.23

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	1,236,684,666.36
卖出股票收入（成交）总额	1,252,377,411.86

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

本基金可参与股指期货交易。若本基金参与股指期货交易，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

本基金可参与国债期货交易。若本基金参与国债期货交易，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	349,776.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	916.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	350,692.26

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
国泰君安中证	1,602	91,882.5 9	15,602,284.8 5	10.60%	131,593,620.9 5	89.40%

1000 优选股票发起 A						
国泰君安中证 1000 优选股票发起 C	553	76,802.29	7,540,806.85	17.75%	34,930,861.34	82.25%
合计	2,155	88,012.80	23,143,091.70	12.20%	166,524,482.29	87.80%

注：分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国泰君安中证 1000 优选股票发起 A	252,068.51	0.1712%
	国泰君安中证 1000 优选股票发起 C	10,118.60	0.0238%
	合计	262,187.11	0.1382%

注：分类基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	国泰君安中证 1000 优选股票发起 A	0
	国泰君安中证 1000 优选股票发起 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安中证 1000 优选股票发起 A	0
	国泰君安中证 1000 优选股票发起 C	0
	合计	0

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人以及本基金基金经理均未持有本基金份额。

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	10,009,450.45	5.28%	10,009,450.45	5.28%	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	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	262,187.11	0.14%	-	-	-
合计	10,271,637.56	5.42%	10,009,450.45	5.28%	-

注：其他为公司普通员工持有份额，持有期限为不低于 6 个月。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安中证 1000 优选股票发起 A	国泰君安中证 1000 优选股票发起 C
基金合同生效日（2023 年 12 月 12 日）基金份额总额	172,275,944.23	68,029,984.73
本报告期期初基金份额总额	172,275,944.23	68,029,984.73
本报告期基金总申购份额	384,670.98	719,535.46
减：本报告期基金总赎回份额	25,464,709.41	26,277,852.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	147,195,905.80	42,471,668.19

注：基金总申购份额含红利再投资及转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2024 年 2 月 28 日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告》。自 2024 年 2 月 26 日起叶明同志代为履行公司首席信息官，朱晓力同志不再担任公司首席信息官职务。

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

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

2、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	2	2,488,365,427.18	100.00%	186,130.91	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高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-02-28
2	国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回和定期定额投资业务的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2024-03-12
3	上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-03-20
4	上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-03-20
5	国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-04-22
6	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024-04-22
7	国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2024-06-28
8	国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2024-06-28

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安中证 1000 优选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
二〇二四年八月三十日