

国泰君安量化选股混合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:中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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	6
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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
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.....	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
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.....	63
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.....	63
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.....	64
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.....	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
7.12 投资组合报告附注.....	64

§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
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	66
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	66
§ 9 开放式基金份额变动	67
§ 10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
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.....	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
10.4 基金投资策略的改变	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
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	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
10.8 其他重大事件.....	69
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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.....	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
§ 12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录.....	70
12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金		
基金简称	国泰君安量化选股混合发起		
基金主代码	016466		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2022 年 08 月 18 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	中国邮政储蓄银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1, 319, 207, 649. 49 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	国泰君安量化选股混合发起 A	国泰君安量化选股混合发起 C	国泰君安量化选股混合发起 D
下属分级基金的交易代码	016466	016467	018963
报告期末下属分级基金的份额总额	620, 976, 483. 48 份	332, 192, 834. 28 份	366, 038, 331. 73 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	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。 本基金的投资策略还包括股票投资策略、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、股指期货投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中证全指指数收益率*80%+中债综合全价指数收益率*20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公 司
信息披露负 责人	姓名	吕巍
	联系电话	021-38676022
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com
客户服务电话	95521	95580
传真	021-38871190	010-68858120
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 3 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	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码	200120	100808
法定代表人	陶耿	刘建军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名 称	《中国证券报》
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）		
	国泰君安量化选 股混合发起 A	国泰君安量化选 股混合发起 C	国泰君安量化选股 混合发起 D
本期已实现收益	-104,969,269.54	-63,743,003.48	-64,978,903.13
本期利润	-106,806,236.34	-71,595,449.22	-81,525,514.19
加权平均基金份额本期利润	-0.1252	-0.1473	-0.1323
本期加权平均净值利润率	-13.00%	-15.37%	-13.73%
本期基金份额净值增长率	-10.04%	-10.22%	-10.21%

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	-45,753,166.15	-26,737,359.04	-28,164,579.13
期末可供分配基金份额利润	-0.0737	-0.0805	-0.0769
期末基金资产净值	575,223,317.33	305,455,475.24	337,873,752.60
期末基金份额净值	0.9263	0.9195	0.9231
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	-7.37%	-8.05%	-16.40%

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

国泰君安量化选股混合发起 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	-5.34%	0.90%	-4.52%	0.64%	-0.82%	0.26%
过去三个月	-6.11%	1.17%	-4.81%	0.82%	-1.30%	0.35%
过去六个月	-10.04%	1.62%	-6.37%	1.04%	-3.67%	0.58%
过去一年	-15.49%	1.30%	-12.98%	0.87%	-2.51%	0.43%
自基金合同生效起至今	-7.37%	1.15%	-18.43%	0.82%	11.06%	0.33%

国泰君安量化选股混合发起 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	-5.37%	0.90%	-4.52%	0.64%	-0.85%	0.26%
过去三个月	-6.21%	1.17%	-4.81%	0.82%	-1.40%	0.35%
过去六个月	-10.22%	1.62%	-6.37%	1.04%	-3.85%	0.58%
过去一年	-15.83%	1.29%	-12.98%	0.87%	-2.85%	0.42%
自基金合同生效起至今	-8.05%	1.15%	-18.43%	0.82%	10.38%	0.33%

国泰君安量化选股混合发起 D 净值表现

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①—③	②—④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	-5.36%	0.90%	-4.52%	0.64%	-0.84%	0.26%
过去三个月	-6.20%	1.17%	-4.81%	0.82%	-1.39%	0.35%
过去六个月	-10.21%	1.62%	-6.37%	1.04%	-3.84%	0.58%
自基金合同生效起至今	-16.40%	1.34%	-14.54%	0.89%	-1.86%	0.45%

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

国泰君安量化选股混合发起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08月18日-2024年06月30日)



国泰君安量化选股混合发起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08月18日-2024年06月30日)



国泰君安量化选股混合发起D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08月07日-2024年06月30日)



注：本基金于 2022 年 8 月 18 日成立，D 类份额于 2023 年 8 月 7 日首次申购确认，D 类份额当期的相关数据和指标按实际存续期（即 2023 年 8 月 7 日至 2024 年 06 月 30 日）计算。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海国泰君安证券资产管理有限公司正式成立于 2010 年 10 月 18 日，经中国证监会证监许可

【2010】631 号文批准，是业内首批券商系资产管理公司。公司注册资本金 20 亿元，注册地上海。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡崇海	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金	2022-08-18	-	13 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士。曾任香港科技大学人工智能实验室访问学者，其后加盟方正证券研究所、国泰君安证券咨询部及研究所从事量化对冲模型的研发工作，2014 年加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，先后在量化投资部、权益与衍生品部担任高级投资经理，从事量化投资和策略研发工作，在 Alpha 量化策略以及基于机器学习的投资方面有独到且深入的研究。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。

	基金经理。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。				
--	---------------------------------	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

分散化持股为主要投资风格的量化策略并不友好。

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

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。尽管市场风格和行业走势会发生变化，但我们仍将坚持一贯的投资理念和投资组合管理体系。在本基金中，我们通过挖掘有投资逻辑的 Alpha 因子，不断改进底层量化模型以及定期监控策略的表现等方式来增强策略表现。我们一直坚守一贯的投资体系和理念，并尽可能以此来稳定投资者对我们超额收益率的预期。在量化增强层面，我们将结合财务数据为基础的基本面信号和量价信号，通过机器学习模型来有效选择因子，在全市场选股的基础上，通过投资组合管理的方式在控制投资组合整体风险的同时最大化 Alpha 能力的输出。由于基本面量化和量价在信号层面较低的相关性，我们相信能够在兼顾两者的情况下追求稳健的 Alpha。作为全市场选股的量化基金，相比于通过控制仓位来做择时操作，我们更倾向于通过较稳定的仓位运行来最大程度的兑现我们稳定的 Alpha 能力。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。我们认为当前市场整体估值依然处于历史低估阶段，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强化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量化选股混合发起 A 基金份额净值为 0.9263 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.04%，同期业绩比较基准收益率为-6.37%；截至报告期末国泰君安量化选股混合发起 C 基金份额净值为 0.9195 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.22%，同期业绩比较基准收益率为-6.37%；截至报告期末国泰君安量化选股混合发起 D 基金份额净值为 0.9231 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.21%，同期业绩比较基准收益率为-

6.37%。

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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其

他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。中国邮政储蓄银行股份有限公司具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，中国邮政储蓄银行股份有限公司在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、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：国泰君安量化选股混合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	139,653,304.57	178,682,778.20
结算备付金		5,720,358.75	16,193,213.38
存出保证金		2,914,800.00	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,122,257,128.76	2,444,062,227.49
其中：股票投资		1,122,257,128.76	2,444,062,227.49
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		1,420,904.84	16,823,492.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,271,966,496.92	2,655,761,711.28
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		51,626,215.96	27,588,252.46
应付管理人报酬		1,123,732.69	2,194,652.52
应付托管费		168,559.91	329,197.86
应付销售服务费		235,614.66	536,577.83

应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	259,828.53	167,341.74
负债合计		53,413,951.75	30,816,022.41
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,319,207,649.49	2,554,263,232.70
未分配利润	6.4.7.8	-100,655,104.32	70,682,456.17
净资产合计		1,218,552,545.17	2,624,945,688.87
负债和净资产总计		1,271,966,496.92	2,655,761,711.28

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,319,207,649.49 份。其中国泰君安量化选股混合发起 A 基金份额净值 0.9263 元，基金份额总额 620,976,483.48 份；国泰君安量化选股混合发起 C 基金份额净值 0.9195 元，基金份额总额 332,192,834.28 份；国泰君安量化选股混合发起 D 基金份额净值 0.9231 元，基金份额总额 366,038,331.73 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安量化选股混合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	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-247,029,545.31	8,447,505.93
1. 利息收入		426,201.29	68,939.15
其中：存款利息收入	6.4.7.9	426,201.29	68,939.15
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）		-225,164,690.20	11,535,619.95
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-235,056,037.00	8,025,789.71
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	-4,642,553.97	-769,586.78
股利收益	6.4.7.12	14,533,900.77	4,279,417.02
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	-26,236,023.60	-3,898,380.90
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	3,944,967.20	741,327.73
减：二、营业总支出		12,897,654.44	1,756,907.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,320,107.50	1,265,448.23
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,398,016.20	189,817.30
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,094,995.38	249,573.63
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	84,535.36	52,068.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-259,927,199.75	6,690,598.50

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-259,927,199.75	6,690,598.50
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-259,927,199.75	6,690,598.50

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安量化选股混合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	2,554,263,232.70	70,682,456.17	2,624,945,688.87
二、本期期初净资产	2,554,263,232.70	70,682,456.17	2,624,945,688.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-171,337,560.49	-
（一）、综合收益总额	1,235,055,583.21	-259,927,199.75	1,406,393,143.70
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	88,589,639.26	-
其中：1. 基金申购款	1,235,055,583.21	-	1,146,465,943.95
2. 基金赎回款	839,946,932.05	-35,809,899.05	804,137,033.00
（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）	-	124,399,538.31	-
四、本期期末净资产	2,075,002,515.26	-100,655,104.32	1,950,602,976.95
	1,319,207,649.49	-	1,218,552,545.17
项目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	16,472,307.61	-824,732.61	15,647,575.00
二、本期期初净资产	16,472,307.61	-824,732.61	15,647,575.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	723,031,139.11	70,621,528.96	793,652,668.07
（一）、综合收益总额	-	6,690,598.50	6,690,598.50
（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）	723,031,139.11	63,930,930.46	786,962,069.57
其中：1. 基金申购款	827,126,390.10	71,861,228.92	898,987,619.02

2. 基金赎回款	-104,095,250.99	-7,930,298.46	-112,025,549.45
(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	739,503,446.72	69,796,796.35	809,300,243.07

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

国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]1607号《关于准予国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金注册的批复》注册,由上海国泰君安证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币15,019,990.10元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第0716号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》于2022年8月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为15,019,990.10份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为15,019,000.00份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《关于国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金增加D类基金份额并修改法律文件的公告》,本基金自2023年8月1日起在原有A类基金份额和C类基金份额的基础上增加D类份额,并对本基金的基金合同作相应修改。本基金增加D类基金份额后,三类基金份额分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。投资者申购时可以自主选择与A类基金份额、C类基金份额或D类基金份额相对应的基金代码进行申购。

根据《国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费,并不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费,并不收取申购费用的基金份额,称为D类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安量化选股混合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：股票(含存托凭证)资产占基金资产的 60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率×80%+中债综合全价指数收益率×20%。

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》、《国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报告所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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	77,301,965.18
等于：本金	77,287,391.22
加：应计利息	14,573.96
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	62,351,339.39
等于：本金	62,348,916.12
加：应计利息	2,423.27
减：坏账准备	-
合计	139,653,304.57

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,163,976,306.31	-	1,122,257,128.76	-41,719,177.55
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,163,976,306.31	-	1,122,257,128.76	-41,719,177.55

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 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	24,283,153.85	0.00	-	-
--股指期货	24,283,153.85	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	24,283,153.85	-	-	-

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	25	24,290,000.00	6,846.15
合计				6,846.15
减：可抵销期货暂收款				6,846.15
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	173,013.59
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	59,672.34
预提审计费	24,863.02
其他应付	2,279.58
合计	259,828.53

6.4.7.7 实收基金

国泰君安量化选股混合发起 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	1,006,563,351.58	1,006,563,351.58
本期申购	369,317,142.84	369,317,142.84
本期赎回（以“-”号填列）	-754,904,010.94	-754,904,010.94
本期末	620,976,483.48	620,976,483.48

国泰君安量化选股混合发起 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	716,584,193.27	716,584,193.27
本期申购	60,691,197.28	60,691,197.28

本期赎回（以“-”号填列）	-445,082,556.27	-445,082,556.27
本期末	332,192,834.28	332,192,834.28

国泰君安量化选股混合发起 D

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	831,115,687.85	831,115,687.85
本期申购	409,938,591.93	409,938,591.93
本期赎回（以“-”号填列）	-875,015,948.05	-875,015,948.05
本期末	366,038,331.73	366,038,331.73

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

国泰君安量化选股混合发起 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	54,224,501.26	-24,288,848.51	29,935,652.75
本期期初	54,224,501.26	-24,288,848.51	29,935,652.75
本期利润	-104,969,269.54	-1,836,966.80	-
			106,806,236.34
本期基金份额交易产生的变动数	14,962,910.94	16,154,506.50	31,117,417.44
其中：基金申购款	-5,975,975.51	-10,873,626.03	-16,849,601.54
基金赎回款	20,938,886.45	27,028,132.53	47,967,018.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-35,781,857.34	-9,971,308.81	-45,753,166.15

国泰君安量化选股混合发起 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	34,622,777.33	-17,265,960.80	17,356,816.53
本期期初	34,622,777.33	-17,265,960.80	17,356,816.53
本期利润	-63,743,003.48	-7,852,445.74	-
			71,595,449.22
本期基金份额交易产生的变动数	7,714,154.65	19,787,119.00	27,501,273.65
其中：基金申购款	-921,803.11	-1,074,683.14	-1,996,486.25
基金赎回款	8,635,957.76	20,861,802.14	29,497,759.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-21,406,071.50	-5,331,287.54	-
			26,737,359.04

国泰君安量化选股混合发起 D

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	43,456,244.29	-20,066,257.40	23,389,986.89
本期期初	43,456,244.29	-20,066,257.40	23,389,986.89
本期利润	-64,978,903.13	-16,546,611.06	-
			81,525,514.19
本期基金份额交易产生的变动数	-760,824.04	30,731,772.21	29,970,948.17
其中：基金申购款	-15,098,428.60	-1,865,382.66	-
			16,963,811.26
基金赎回款	14,337,604.56	32,597,154.87	46,934,759.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-22,283,482.88	-5,881,096.25	-
			28,164,579.13

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	281,581.77
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	66,966.33
结算备付金利息收入	77,653.19
其他	-
合计	426,201.29

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	13,395,859,841.07
减：卖出股票成本总额	13,620,709,629.38
减：交易费用	10,206,248.69
买卖股票差价收入	-235,056,037.00

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	-4,574,626.15
减：交易费用	67,927.82

合计	-4,642,553.97
----	---------------

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	14,533,900.77
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	14,533,900.77

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	-26,242,869.75
——股票投资	-26,242,869.75
——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	6,846.15
——权证投资	-
————期货投资	6,846.15
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	-26,236,023.60

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	3,944,967.20
合计	3,944,967.20

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	24,863.02

信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
合计	84,535.36

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海国泰君安证券资产管理有限公司 (以下简称“国泰君安资管”)	基金管理人
中国邮政储蓄银行股份有限公司(以 下简称“中国邮政储蓄银行”)	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、代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总 额的比例	成交金额	占当期股票成交总 额的比例
国泰君安 证券	25,717,409,659.4 9	100.00%	6,473,568,964.8 6	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券	1,858,755.95	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券	461,431.11	100.00%	0.00	0.00%

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,320,107.50	1,265,448.23
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,631,750.02	235,775.49
应支付基金管理人的净管理费	6,688,357.48	1,029,672.74

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年实际天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，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	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,398,016.20	189,817.30

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年实际天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，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			
	国泰君安量化 选股混合发起 A	国泰君安量化 选股混合发起 C	国泰君安量化 选股混合发起 D	合计
国君君安资管	-	64,378.26	818,209.47	882,587.73
国泰君安证券	-	292,891.45	-	292,891.45
合计	-	357,269.71	818,209.47	1,175,479.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	国泰君安量化 选股混合发起 A	国泰君安量化 选股混合发起 C	国泰君安量化 选股混合发起 D	合计
国泰君安资管	-	27,925.39	-	27,925.39
国泰君安证券	-	82,625.90	-	82,625.90
合计	-	110,551.29	-	110,551.29

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费，C/D 类份额的销售服务费年费率为 0.40%，销售服务费按前一日 C/D 类份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C/D 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C/D 类份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国泰君安量化选股混合发起 A

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2022 年 08 月 18 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,009,000.00	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	10,009,000.00
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	1.61%	2.56%

国泰君安量化选股混合发起 C

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2022 年 08 月 18 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	5,010,000.00	5,010,000.00
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	5,010,000.00	5,010,000.00
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	1.51%	1.44%

国泰君安量化选股混合发起 D

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2022 年 08 月 18 日）持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	35,071,750.28	-
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	7,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	28,071,750.28	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.67%	-

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

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

国泰君安量化选股混合发起 D

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国邮政储蓄银行	100,030.01	0.03%	-	-

注：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，本基金上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行	77,301,965.18	281,581.77	19,765,484.57	23,662.08
国泰君安证券	62,351,339.39	66,966.33	36,286,367.77	31,190.55

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄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

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须做说明的其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
688717	艾罗能源	2023年12月26日	1-6个月(含)	网下新股限售	55.66	47.02	11,303	629,124.98	531,467.06	-
301589	诺瓦星云	2024年02月01日	1-6个月(含)	网下新股限售	126.89	188.01	1,244	87,680.99	233,884.44	-
603350	安乃达	2024年06月26日	5个交易日	新股未上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-
688709	成都华微	2024年01月31日	1-6个月(含)	网下新股限售	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

301536	星辰科技	2024年03月20日	1-6个月(含)	网下新股限售	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
688584	上海合晶	2024年02月01日	1-6个月(含)	网下新股限售	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
301580	爱迪特	2024年06月19日	1-6个月(含)	网下新股限售	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
688691	灿芯股份	2024年04月02日	1-6个月(含)	网下新股限售	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	1-6个月(含)	创业板打新限售	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024年05月28日	1-6个月(含)	网下新股限售	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301587	中瑞股份	2024年03月27日	1-6个月(含)	网下新股限售	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
00138	广合	2024	1-6个月	网	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-

9	科技	年 03 月 26 日	月 (含)	下新股限售						
301539	宏鑫科技	2024 年 04 月 03 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688530	欧莱新材	2024 年 04 月 29 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024 年 03 月 06 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024 年 01 月 26 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603325	博隆技术	2024 年 01 月 03 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603381	永臻股份	2024 年 06 月 19 日	1-6 个月 (含)	网下新股限售	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
603344	星德胜	2024 年 03 月 13 日	1-6 个月 (含)	网下新	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-

		日)	股 限 售						
001359	平安 电工	2024 年 03 月 19 日	1-6 个 月 (含)	网 下 新 股 限 售	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603312	西典 新能	2024 年 01 月 04 日	1-6 个 月 (含)	网 下 新 股 限 售	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
001379	腾达 科技	2024 年 01 月 11 日	1-6 个 月 (含)	网 下 新 股 限 售	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景 微	2024 年 01 月 17 日	1-6 个 月 (含)	网 下 新 股 限 售	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-

注: 1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期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	停 牌 日 期	停 牌 原 因	期 末 估 值 单 价	复 牌 日 期	复 牌 开	数 量 (股)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注

	称		因			盘 单 价				
300630	普利制药	2024-05-06	-	12.35	2024-07-08	9.88	29,700	405,567.50	366,795.00	-

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国邮政储蓄银行股份有限公司，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	139,653,304.57	-	-	-	139,653,304.57
结算备付金	5,720,358.75	-	-	-	5,720,358.75
存出保证金	2,914,800.00	-	-	-	2,914,800.00
交易性金融资产	-	-	-	1,122,257,128.76	1,122,257,128.76
应收申购款	-	-	-	1,420,904.84	1,420,904.84
资产总计	148,288,463.32	-	-	1,123,678,033.60	1,271,966,496.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	51,626,215.96	51,626,215.96
应付管理人报酬	-	-	-	1,123,732.69	1,123,732.69
应付托管费	-	-	-	168,559.91	168,559.91
应付销售服务费	-	-	-	235,614.66	235,614.66
其他负债	-	-	-	259,828.53	259,828.53
负债总计	-	-	-	53,413,951.75	53,413,951.75

利率敏感度缺口	148,288,463.32	-	-	1,070,264,081.85	1,218,552,545.17
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	178,682,778.20	-	-	-	178,682,778.20
结算备付金	16,193,213.38	-	-	-	16,193,213.38
交易性金融资产	-	-	-	2,444,062,227.49	2,444,062,227.49
应收申购款	-	-	-	16,823,492.21	16,823,492.21
资产总计	194,875,991.58	-	-	2,460,885,719.70	2,655,761,711.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	27,588,252.46	27,588,252.46
应付管理人报酬	-	-	-	2,194,652.52	2,194,652.52
应付托管费	-	-	-	329,197.86	329,197.86
应付销售服务费	-	-	-	536,577.83	536,577.83
其他负债	-	-	-	167,341.74	167,341.74
负债总计	-	-	-	30,816,022.41	30,816,022.41
利率敏感度缺口	194,875,991.58	-	-	2,430,069,697.29	2,624,945,688.87

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	1,122,257,128.76	92.10	2,444,062,227.49	93.11
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,122,257,128.76	92.10	2,444,062,227.49	93.11

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 6.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	87,216,275.18	161,363,203.06
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-87,216,275.18	-161,363,203.06

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低

层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	1,120,947,113.90	2,442,669,456.36
第二层次	388,403.56	898,742.02
第三层次	921,611.30	494,029.11
合计	1,122,257,128.76	2,444,062,227.49

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,122,257,128.76	88.23
	其中：股票	1,122,257,128.76	88.23
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	145,373,663.32	11.43
8	其他各项资产	4,335,704.84	0.34
9	合计	1,271,966,496.92	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	2,896,137.00	0.24
B	采矿业	60,141,187.82	4.94
C	制造业	660,350,353.44	54.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	65,081,161.06	5.34
E	建筑业	33,791,036.00	2.77
F	批发和零售业	12,964,338.90	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	28,296,175.94	2.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	77,534,995.93	6.36
J	金融业	141,491,692.08	11.61
K	房地产业	17,390,847.00	1.43
L	租赁和商务服务业	15,129,608.50	1.24

M	科学研究和技术服务业	4,230,780.09	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	665,726.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	586,740.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	1,706,349.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	1,122,257,128.76	92.10

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	600519	贵州茅台	11,600	17,021,724.00	1.40
2	601229	上海银行	2,246,600	16,310,316.00	1.34
3	000725	京东方 A	3,297,100	13,485,139.00	1.11
4	000830	鲁西化工	1,118,000	12,957,620.00	1.06
5	002241	歌尔股份	654,700	12,773,197.00	1.05
6	601668	中国建筑	2,344,700	12,450,357.00	1.02
7	003816	中国广核	2,669,000	12,357,470.00	1.01
8	601877	正泰电器	637,000	12,141,220.00	1.00
9	600028	中国石化	1,881,100	11,888,552.00	0.98
10	000568	泸州老窖	80,000	11,479,200.00	0.94
11	601633	长城汽车	452,900	11,458,370.00	0.94
12	600015	华夏银行	1,773,870	11,352,768.00	0.93

				0	
13	600809	山西汾酒	52,400	11,050,112.00	0.91
14	600019	宝钢股份	1,596,300	10,615,395.00	0.87
15	000930	中粮科技	1,947,501	9,795,930.03	0.80
16	600030	中信证券	533,050	9,717,501.50	0.80
17	002422	科伦药业	313,400	9,505,422.00	0.78
18	601888	中国中免	147,400	9,211,026.00	0.76
19	600048	保利发展	1,044,100	9,146,316.00	0.75
20	601398	工商银行	1,575,400	8,979,780.00	0.74
21	600027	华电国际	1,289,500	8,949,130.00	0.73
22	601577	长沙银行	1,044,800	8,546,464.00	0.70
23	601319	中国人保	1,634,000	8,415,100.00	0.69
24	002468	申通快递	967,400	8,126,160.00	0.67
25	002120	韵达股份	1,017,700	7,876,998.00	0.65
26	300408	三环集团	265,600	7,752,864.00	0.64
27	002601	龙佰集团	417,200	7,747,404.00	0.64
28	601600	中国铝业	1,010,000	7,706,300.00	0.63
29	601186	中国铁建	897,600	7,692,432.00	0.63
30	600362	江西铜业	323,100	7,651,008.00	0.63
31	601857	中国石油	734,276	7,577,728.32	0.62
32	000538	云南白药	145,300	7,432,095.00	0.61
33	600096	云天化	364,800	7,084,416.00	0.58
34	601991	大唐发电	2,344,500	7,056,945.00	0.58
35	601318	中国平安	167,800	6,940,208.00	0.57
36	601169	北京银行	1,180,300	6,892,952.00	0.57
37	300229	拓尔思	507,300	6,813,039.00	0.56
38	688088	虹软科技	234,352	6,763,398.72	0.56
39	600183	生益科技	313,800	6,608,628.00	0.54
40	600031	三一重工	400,000	6,600,000.00	0.54
41	300034	钢研高纳	399,000	6,340,110.00	0.52
42	688586	江航飞机装备	679,343	6,317,889.90	0.52
43	002292	奥飞娱乐	1,018,600	6,091,228.00	0.50
44	601669	中国电建	1,074,000	6,003,660.00	0.49
45	600602	云赛智联	534,800	5,904,192.00	0.48
46	600011	华能国际	607,300	5,842,226.00	0.48
47	000063	中兴通讯	208,000	5,817,760.00	0.48
48	603501	韦尔股份	58,200	5,783,334.00	0.47
49	301260	格力博	423,090	5,762,485.80	0.47
50	002340	格林美	903,900	5,757,843.00	0.47
51	601166	兴业银行	318,000	5,603,160.00	0.46
52	601311	骆驼股份	678,600	5,442,372.00	0.45

53	600760	中航沈飞	134,800	5,405,480.00	0.44
54	002519	银河电子	1,097,200	5,387,252.00	0.44
55	002245	蔚蓝锂芯	687,100	5,325,025.00	0.44
56	601336	新华保险	175,200	5,261,256.00	0.43
57	601898	中煤能源	412,900	5,152,992.00	0.42
58	600006	东风汽车	802,500	5,127,975.00	0.42
59	601225	陕西煤业	198,600	5,117,922.00	0.42
60	000786	北新建材	169,000	5,012,540.00	0.41
61	688249	晶合集成	339,715	4,983,619.05	0.41
62	000960	锡业股份	317,500	4,918,075.00	0.40
63	000969	安泰科技	606,300	4,807,959.00	0.39
64	600596	新安股份	630,473	4,791,594.80	0.39
65	603328	依顿电子	608,200	4,780,452.00	0.39
66	300821	东岳硅材	678,249	4,639,223.16	0.38
67	003021	兆威机电	99,300	4,582,695.00	0.38
68	002020	京新药业	434,900	4,553,403.00	0.37
69	300634	彩讯股份	269,400	4,534,002.00	0.37
70	000001	平安银行	439,900	4,464,985.00	0.37
71	688363	华熙生物	77,162	4,365,054.34	0.36
72	002897	意华股份	113,700	4,281,942.00	0.35
73	601939	建设银行	563,700	4,171,380.00	0.34
74	600875	东方电气	223,600	4,125,420.00	0.34
75	000807	云铝股份	304,300	4,111,093.00	0.34
76	300750	宁德时代	22,800	4,104,684.00	0.34
77	688472	阿特斯阳光电 力	397,172	4,043,210.96	0.33
78	002399	海普瑞	465,092	4,032,347.64	0.33
79	300017	网宿科技	508,700	4,018,730.00	0.33
80	300442	润泽科技	166,000	3,975,700.00	0.33
81	600736	苏州高新	954,500	3,970,720.00	0.33
82	002475	立讯精密	100,400	3,946,724.00	0.32
83	002558	巨人网络	417,424	3,940,482.56	0.32
84	603296	华勤技术	71,260	3,935,689.80	0.32
85	603013	亚普股份	288,166	3,881,596.02	0.32
86	600141	兴发集团	202,000	3,854,160.00	0.32
87	600062	华润双鹤	186,700	3,655,586.00	0.30
88	002906	华阳集团	135,623	3,629,271.48	0.30
89	002966	苏州银行	482,000	3,615,000.00	0.30
90	688055	昆山龙腾光电	1,138,682	3,609,621.94	0.30
91	600468	百利电气	822,000	3,542,820.00	0.29
92	002284	亚太股份	521,718	3,526,813.68	0.29
93	300747	锐科激光	198,600	3,525,150.00	0.29
94	300233	金城医药	234,800	3,503,216.00	0.29

95	600406	国电南瑞	139,600	3,484,416.00	0.29
96	300047	天源迪科	529,700	3,464,238.00	0.28
97	300735	光弘科技	159,400	3,443,040.00	0.28
98	000333	美的集团	53,300	3,437,850.00	0.28
99	600789	鲁抗医药	486,300	3,404,100.00	0.28
100	601288	农业银行	771,500	3,363,740.00	0.28
101	601997	贵阳银行	633,100	3,336,437.00	0.27
102	601800	中国交建	371,700	3,322,998.00	0.27
103	000913	钱江摩托	209,700	3,304,872.00	0.27
104	600863	内蒙华电	710,900	3,298,576.00	0.27
105	603229	奥翔药业	324,396	3,260,179.80	0.27
106	601988	中国银行	705,500	3,259,410.00	0.27
107	002128	电投能源	154,400	3,257,840.00	0.27
108	000060	中金岭南	755,129	3,201,746.96	0.26
109	002907	华森制药	252,000	3,180,240.00	0.26
110	603198	迎驾贡酒	55,200	3,174,000.00	0.26
111	002001	新和成	163,500	3,139,200.00	0.26
112	600309	万华化学	38,800	3,137,368.00	0.26
113	603517	绝味食品	198,400	3,055,360.00	0.25
114	000524	岭南控股	376,700	3,036,202.00	0.25
115	600050	中国联通	641,260	3,013,922.00	0.25
116	300113	顺网科技	290,800	2,977,792.00	0.24
117	300463	迈克生物	260,170	2,960,734.60	0.24
118	000066	中国长城	337,300	2,951,375.00	0.24
119	600690	海尔智家	103,800	2,945,844.00	0.24
120	601231	环旭电子	181,200	2,908,260.00	0.24
121	300725	药石科技	107,795	2,885,672.15	0.24
122	002267	陕天然气	379,400	2,868,264.00	0.24
123	600489	中金黄金	193,500	2,863,800.00	0.24
124	600023	浙能电力	401,976	2,858,049.36	0.23
125	002046	国机精工	279,700	2,844,549.00	0.23
126	600335	国机汽车	492,500	2,841,725.00	0.23
127	601238	广汽集团	366,900	2,839,806.00	0.23
128	603806	福斯特	188,264	2,767,480.80	0.23
129	000630	铜陵有色	762,900	2,754,069.00	0.23
130	600985	淮北矿业	164,100	2,747,034.00	0.23
131	002036	联创电子	398,133	2,687,397.75	0.22
132	600578	京能电力	818,300	2,651,292.00	0.22
133	601390	中国中铁	403,100	2,628,212.00	0.22
134	601628	中国人寿	84,014	2,608,634.70	0.21
135	601688	华泰证券	208,500	2,583,315.00	0.21
136	002237	恒邦股份	223,500	2,572,485.00	0.21
137	301262	海看股份	113,500	2,559,425.00	0.21

138	601168	西部矿业	137,500	2,468,125.00	0.20
139	000157	中联重科	321,300	2,467,584.00	0.20
140	603883	老百姓	134,300	2,465,748.00	0.20
141	600036	招商银行	71,100	2,430,909.00	0.20
142	600497	驰宏锌锗	455,100	2,430,234.00	0.20
143	603823	百合花	249,100	2,408,797.00	0.20
144	300768	迪普科技	202,800	2,403,180.00	0.20
145	001338	永顺泰	245,000	2,401,000.00	0.20
146	002249	大洋电机	507,500	2,400,475.00	0.20
147	603317	天味食品	208,946	2,384,073.86	0.20
148	600480	凌云股份	241,300	2,371,979.00	0.19
149	605369	拱东医疗	58,596	2,337,980.40	0.19
150	300660	江苏雷利	91,400	2,332,528.00	0.19
151	002543	万和电气	231,600	2,306,736.00	0.19
152	002351	漫步者	175,300	2,305,195.00	0.19
153	600372	中航机载	189,400	2,267,118.00	0.19
154	000858	五粮液	17,700	2,266,308.00	0.19
155	601615	明阳智能	237,100	2,238,224.00	0.18
156	002845	同兴达	167,600	2,215,672.00	0.18
157	300973	立高食品	78,800	2,213,492.00	0.18
158	601666	平煤股份	197,400	2,210,880.00	0.18
159	002206	海利得	570,500	2,179,310.00	0.18
160	301171	易点天下	148,249	2,179,260.30	0.18
161	600718	东软集团	262,900	2,174,183.00	0.18
162	601216	君正集团	589,200	2,174,148.00	0.18
163	002449	国星光电	304,000	2,164,480.00	0.18
164	000738	航发控制	106,500	2,137,455.00	0.18
165	600886	国投电力	117,100	2,135,904.00	0.18
166	605228	神通科技	248,300	2,130,414.00	0.17
167	002446	盛路通信	374,000	2,113,100.00	0.17
168	601016	节能风电	681,400	2,037,386.00	0.17
169	603212	赛伍技术	184,000	2,031,360.00	0.17
170	600562	国睿科技	145,700	1,990,262.00	0.16
171	600971	恒源煤电	166,325	1,985,920.50	0.16
172	002642	荣联科技	383,201	1,977,317.16	0.16
173	601881	中国银河	181,800	1,974,348.00	0.16
174	600276	恒瑞医药	51,300	1,972,998.00	0.16
175	301408	华人健康	192,600	1,970,298.00	0.16
176	600021	上海电力	198,700	1,965,143.00	0.16
177	600332	白云山	65,900	1,932,847.00	0.16
178	002706	良信股份	281,700	1,932,462.00	0.16
179	601198	东兴证券	241,400	1,921,544.00	0.16
180	300741	华宝股份	126,000	1,920,240.00	0.16

181	000735	罗牛山	437,700	1,895,241.00	0.16
182	601818	光大银行	593,100	1,880,127.00	0.15
183	601069	西部黄金	161,500	1,878,245.00	0.15
184	603345	安井食品	25,200	1,872,612.00	0.15
185	300403	汉宇集团	273,200	1,865,956.00	0.15
186	600990	四创电子	105,900	1,858,545.00	0.15
187	603025	大豪科技	134,040	1,852,432.80	0.15
188	002142	宁波银行	83,000	1,830,980.00	0.15
189	002100	天康生物	257,100	1,781,703.00	0.15
190	300684	中石科技	102,100	1,770,414.00	0.15
191	688380	中微半导	105,200	1,758,944.00	0.14
192	600900	长江电力	60,500	1,749,660.00	0.14
193	600814	杭州解百	296,100	1,746,990.00	0.14
194	600315	上海家化	98,100	1,744,218.00	0.14
195	600420	国药现代	160,600	1,715,208.00	0.14
196	600269	赣粤高速	331,000	1,711,270.00	0.14
197	300737	科顺股份	392,720	1,688,696.00	0.14
198	000975	银泰黄金	103,200	1,681,128.00	0.14
199	300433	蓝思科技	92,100	1,680,825.00	0.14
200	300357	我武生物	82,900	1,676,238.00	0.14
201	000651	格力电器	42,700	1,674,694.00	0.14
202	600617	国新能源	665,840	1,664,600.00	0.14
203	603203	XD 快克智能	70,500	1,662,390.00	0.14
204	000636	风华高科	126,300	1,649,478.00	0.14
205	603195	公牛集团	21,255	1,639,185.60	0.13
206	002545	东方铁塔	240,000	1,634,400.00	0.13
207	600064	南京高科	268,300	1,628,581.00	0.13
208	301316	慧博云通	110,200	1,617,736.00	0.13
209	601077	渝农商行	319,600	1,604,392.00	0.13
210	603169	兰石重装	354,100	1,593,450.00	0.13
211	002990	盛视科技	79,000	1,590,270.00	0.13
212	300674	宇信科技	142,700	1,581,116.00	0.13
213	601101	昊华能源	171,600	1,577,004.00	0.13
214	002106	莱宝高科	143,300	1,561,970.00	0.13
215	605018	长华集团	170,650	1,546,089.00	0.13
216	601006	大秦铁路	215,800	1,545,128.00	0.13
217	000050	深天马 A	211,100	1,536,808.00	0.13
218	002004	华邦健康	403,400	1,532,920.00	0.13
219	002757	南兴股份	125,900	1,517,095.00	0.12
220	300188	国投智能	136,500	1,516,515.00	0.12
221	301071	力量钻石	54,580	1,512,411.80	0.12
222	300307	慈星股份	253,100	1,505,945.00	0.12
223	002145	中核钛白	455,300	1,493,384.00	0.12

224	600795	国电电力	248,900	1,490,911.00	0.12
225	601728	中国电信	242,100	1,488,915.00	0.12
226	300999	金龙鱼	54,100	1,479,635.00	0.12
227	688313	仕佳光子	153,975	1,465,842.00	0.12
228	600642	申能股份	165,100	1,457,833.00	0.12
229	600908	无锡银行	271,700	1,445,444.00	0.12
230	600025	华能水电	132,000	1,422,960.00	0.12
231	002534	西子洁能	138,360	1,384,983.60	0.11
232	002010	传化智联	360,100	1,382,784.00	0.11
233	002048	宁波华翔	106,500	1,378,110.00	0.11
234	688111	金山办公	6,043	1,374,782.50	0.11
235	688150	莱特光电股份	70,541	1,368,495.40	0.11
236	002946	新乳业	155,900	1,365,684.00	0.11
237	600409	三友化工	272,000	1,365,440.00	0.11
238	600282	南钢股份	271,400	1,351,572.00	0.11
239	300957	贝泰妮	27,900	1,348,128.00	0.11
240	001213	中铁特货	339,500	1,341,025.00	0.11
241	601816	京沪高铁	248,000	1,331,760.00	0.11
242	600350	山东高速	149,700	1,324,845.00	0.11
243	002378	章源钨业	230,000	1,320,200.00	0.11
244	600517	国网英大	304,200	1,317,186.00	0.11
245	600348	华阳股份	132,000	1,314,720.00	0.11
246	002536	飞龙股份	137,400	1,308,048.00	0.11
247	601500	通用股份	243,600	1,300,824.00	0.11
248	002612	朗姿股份	93,502	1,292,197.64	0.11
249	000708	中信特钢	95,200	1,291,864.00	0.11
250	601699	潞安环能	71,000	1,287,230.00	0.11
251	002185	华天科技	157,900	1,286,885.00	0.11
252	600703	三安光电	109,400	1,282,168.00	0.11
253	600610	中毅达	319,400	1,271,212.00	0.10
254	000758	中色股份	246,800	1,253,744.00	0.10
255	002617	露笑科技	256,600	1,231,680.00	0.10
256	300708	聚灿光电	134,200	1,207,800.00	0.10
257	300482	万孚生物	49,300	1,202,920.00	0.10
258	600559	老白干酒	66,000	1,199,880.00	0.10
259	002979	雷赛智能	65,600	1,193,920.00	0.10
260	002034	旺能环境	91,700	1,193,017.00	0.10
261	603897	长城科技	67,300	1,181,115.00	0.10
262	001979	招商蛇口	134,000	1,177,860.00	0.10
263	601766	中国中车	155,000	1,164,050.00	0.10
264	601698	中国卫通	81,700	1,151,153.00	0.09
265	002294	信立泰	43,000	1,145,090.00	0.09
266	600436	片仔癀	5,500	1,139,435.00	0.09

267	002179	中航光电	29,890	1,137,314.50	0.09
268	002839	张家港行	277,000	1,113,540.00	0.09
269	600741	华域汽车	67,500	1,105,650.00	0.09
270	603118	共进股份	160,000	1,072,000.00	0.09
271	000501	武商集团	159,400	1,063,198.00	0.09
272	601899	紫金矿业	60,500	1,062,985.00	0.09
273	000555	神州信息	114,000	1,062,480.00	0.09
274	300602	飞荣达	69,500	1,050,145.00	0.09
275	000900	现代投资	281,900	1,031,754.00	0.08
276	600694	大商股份	61,250	1,029,612.50	0.08
277	603367	辰欣药业	72,800	1,014,832.00	0.08
278	002026	山东威达	121,300	1,006,790.00	0.08
279	002410	广联达	104,600	1,002,068.00	0.08
280	300115	长盈精密	83,280	998,527.20	0.08
281	688138	清溢光电	46,428	998,202.00	0.08
282	601098	中南传媒	80,300	997,326.00	0.08
283	600098	广州发展	155,700	996,480.00	0.08
284	601108	财通证券	148,500	981,585.00	0.08
285	000338	潍柴动力	60,000	974,400.00	0.08
286	600020	中原高速	267,200	945,888.00	0.08
287	600057	厦门象屿	138,100	939,080.00	0.08
288	600612	老凤祥	16,100	936,859.00	0.08
289	002768	国恩股份	49,700	929,390.00	0.08
290	002371	北方华创	2,900	927,681.00	0.08
291	002563	森马服饰	158,900	923,209.00	0.08
292	601100	恒立液压	19,700	917,626.00	0.08
293	300003	乐普医疗	61,700	915,628.00	0.08
294	002180	纳思达	34,600	914,132.00	0.08
295	300341	麦克奥迪	106,100	910,338.00	0.07
296	000030	富奥股份	185,100	908,841.00	0.07
297	002841	视源股份	30,700	906,571.00	0.07
298	003039	顺控发展	72,100	903,413.00	0.07
299	601066	中信建投	46,600	896,584.00	0.07
300	002202	金风科技	133,400	896,448.00	0.07
301	601998	中信银行	133,400	893,780.00	0.07
302	688728	格科微有限公司	73,492	889,988.12	0.07
303	300102	乾照光电	136,800	878,256.00	0.07
304	603939	益丰药房	35,700	876,435.00	0.07
305	603489	DR 八方股份	31,840	859,043.20	0.07
306	002550	千红制药	159,100	857,549.00	0.07
307	688378	奥来德光电	36,500	856,290.00	0.07
308	300772	运达股份	87,730	842,208.00	0.07

309	688127	蓝特光学	45,525	837,204.75	0.07
310	600177	雅戈尔	114,000	811,680.00	0.07
311	002537	海联金汇	156,400	808,588.00	0.07
312	002608	江苏国信	104,200	807,550.00	0.07
313	600428	中远海特	130,500	798,660.00	0.07
314	600038	中直股份	19,200	789,312.00	0.06
315	002957	科瑞技术	57,700	782,412.00	0.06
316	600325	华发股份	119,600	777,400.00	0.06
317	300059	东方财富	73,148	772,442.88	0.06
318	002577	雷柏科技	61,900	765,703.00	0.06
319	603993	XD 洛阳钼业	90,000	765,000.00	0.06
320	300498	温氏股份	38,400	761,088.00	0.06
321	002271	东方雨虹	61,600	760,144.00	0.06
322	300919	中伟股份	24,400	756,156.00	0.06
323	605366	宏柏新材	126,974	737,718.94	0.06
324	688036	传音控股	9,600	734,784.00	0.06
325	600819	耀皮玻璃	173,000	730,060.00	0.06
326	600549	厦门钨业	42,300	729,675.00	0.06
327	600765	中航重机	35,300	720,120.00	0.06
328	600660	福耀玻璃	14,963	716,727.70	0.06
329	601636	旗滨集团	109,800	708,210.00	0.06
330	688315	诺禾致源科技	64,707	706,600.44	0.06
331	300409	道氏技术	82,100	702,776.00	0.06
332	600919	江苏银行	92,700	688,761.00	0.06
333	600619	海立股份	132,400	684,508.00	0.06
334	600699	均胜电子	45,900	680,238.00	0.06
335	300709	精研科技	26,800	677,504.00	0.06
336	600566	济川药业	21,100	669,081.00	0.05
337	002406	远东传动	135,100	666,043.00	0.05
338	600016	民生银行	175,700	665,903.00	0.05
339	603896	寿仙谷	28,300	664,201.00	0.05
340	601222	林洋能源	104,200	653,334.00	0.05
341	002777	久远银海	43,200	647,568.00	0.05
342	000987	越秀资本	129,900	644,304.00	0.05
343	601958	金钼股份	61,500	640,215.00	0.05
344	600308	华泰股份	203,300	638,362.00	0.05
345	300035	中科电气	74,400	633,144.00	0.05
346	600862	中航高科	33,400	627,252.00	0.05
347	002573	清新环境	161,600	625,392.00	0.05
348	002140	东华科技	79,600	616,900.00	0.05
349	000100	TCL 科技	142,100	613,872.00	0.05
350	688601	力芯微股份	13,985	611,004.65	0.05
351	002539	云图控股	85,100	606,763.00	0.05

352	603178	圣龙股份	28,100	602,183.00	0.05
353	000559	万向钱潮	134,620	600,405.20	0.05
354	603297	永新光学	9,900	598,851.00	0.05
355	600926	杭州银行	44,900	585,945.00	0.05
356	603899	晨光股份	18,700	584,936.00	0.05
357	688233	神工半导体	30,030	578,678.10	0.05
358	600941	中国移动	5,300	569,750.00	0.05
359	002913	奥士康	21,100	565,691.00	0.05
360	601808	中海油服	31,900	548,680.00	0.05
361	003035	南网能源	123,500	543,400.00	0.04
362	002078	太阳纸业	38,800	541,260.00	0.04
363	002423	中粮资本	72,200	540,778.00	0.04
364	300620	光库科技	14,600	536,988.00	0.04
365	600577	精达股份	133,900	531,583.00	0.04
366	688717	艾罗能源	11,303	531,467.06	0.04
367	002950	奥美医疗	80,000	528,000.00	0.04
368	600623	华谊集团	91,100	526,558.00	0.04
369	601985	中国核电	49,200	524,472.00	0.04
370	300758	七彩化学	48,600	522,450.00	0.04
371	000517	荣安地产	192,900	516,972.00	0.04
372	603676	卫信康	63,900	511,839.00	0.04
373	601187	厦门银行	95,400	508,482.00	0.04
374	300773	拉卡拉	40,900	508,387.00	0.04
375	300661	圣邦股份	6,100	504,958.00	0.04
376	000958	电投产融	135,200	494,832.00	0.04
377	688362	甬矽电子	24,914	484,826.44	0.04
378	688141	杰华特微电子	29,900	483,184.00	0.04
379	300595	欧普康视	30,700	481,376.00	0.04
380	002454	松芝股份	85,400	477,386.00	0.04
381	002594	比亚迪	1,900	475,475.00	0.04
382	000837	秦川机床	63,900	470,304.00	0.04
383	300303	聚飞光电	93,100	452,466.00	0.04
384	603738	泰晶科技	32,996	450,065.44	0.04
385	600707	彩虹股份	65,900	448,779.00	0.04
386	603055	台华新材	44,300	448,759.00	0.04
387	600887	伊利股份	17,200	444,448.00	0.04
388	600860	京城股份	55,000	443,850.00	0.04
389	002500	山西证券	94,200	442,740.00	0.04
390	300596	利安隆	16,200	439,506.00	0.04
391	300045	华力创通	24,700	435,955.00	0.04
392	002265	建设工业	50,100	432,363.00	0.04
393	002876	三利谱	17,600	424,512.00	0.03
394	600367	红星发展	42,700	423,157.00	0.03

395	600717	天津港	98,222	419,407.94	0.03
396	300438	鹏辉能源	22,800	418,152.00	0.03
397	002609	捷顺科技	55,100	417,658.00	0.03
398	688352	颀中科技	36,453	415,928.73	0.03
399	603658	安图生物	9,000	414,630.00	0.03
400	603610	麒盛科技	41,800	412,984.00	0.03
401	002896	中大力德	14,600	407,340.00	0.03
402	000534	万泽股份	40,500	402,165.00	0.03
403	300396	迪瑞医疗	19,700	400,107.00	0.03
404	300278	华昌达	139,400	400,078.00	0.03
405	300624	万兴科技	7,447	395,212.29	0.03
406	000800	一汽解放	50,200	393,066.00	0.03
407	300015	爱尔眼科	38,000	392,160.00	0.03
408	000709	河钢股份	197,800	383,732.00	0.03
409	300291	百纳千成	90,000	383,400.00	0.03
410	002009	天奇股份	33,700	382,158.00	0.03
411	601375	中原证券	109,300	372,713.00	0.03
412	601872	招商轮船	44,000	371,800.00	0.03
413	300630	普利制药	29,700	366,795.00	0.03
414	300909	汇创达	16,300	364,142.00	0.03
415	300088	长信科技	77,100	362,370.00	0.03
416	000429	粤高速 A	34,800	362,268.00	0.03
417	300451	创业慧康	104,500	361,570.00	0.03
418	601601	中国太保	12,900	359,394.00	0.03
419	002352	顺丰控股	10,000	356,900.00	0.03
420	000776	广发证券	29,200	355,364.00	0.03
421	600346	恒力石化	25,200	351,540.00	0.03
422	002635	安洁科技	22,700	350,488.00	0.03
423	603056	德邦股份	26,400	345,840.00	0.03
424	000906	浙商中拓	50,525	340,538.50	0.03
425	300481	濮阳惠成	24,600	339,480.00	0.03
426	601009	南京银行	32,200	334,558.00	0.03
427	301206	三元生物	13,600	334,288.00	0.03
428	601038	一拖股份	20,900	330,429.00	0.03
429	002701	奥瑞金	78,900	328,224.00	0.03
430	603355	莱克电气	15,060	325,296.00	0.03
431	300258	精锻科技	39,700	322,761.00	0.03
432	300349	金卡智能	27,000	321,840.00	0.03
433	600582	天地科技	46,500	320,385.00	0.03
434	300724	捷佳伟创	5,900	318,659.00	0.03
435	601966	玲珑轮胎	17,200	315,964.00	0.03
436	000810	创维数字	36,400	312,312.00	0.03
437	002587	奥拓电子	58,000	312,040.00	0.03

438	002139	拓邦股份	28,700	304,794.00	0.03
439	301029	怡合达	15,200	298,832.00	0.02
440	000683	远兴能源	42,600	294,366.00	0.02
441	000551	创元科技	33,500	292,455.00	0.02
442	688550	瑞联新材料	12,485	289,527.15	0.02
443	600746	江苏索普	49,000	288,610.00	0.02
444	002384	东山精密	13,900	287,730.00	0.02
445	688195	腾景科技	11,731	287,526.81	0.02
446	600196	复星医药	12,800	283,392.00	0.02
447	002032	苏泊尔	5,600	280,560.00	0.02
448	600161	天坛生物	11,300	275,720.00	0.02
449	600556	天下秀	75,400	274,456.00	0.02
450	600929	雪天盐业	51,400	272,420.00	0.02
451	002838	道恩股份	29,900	270,894.00	0.02
452	000990	诚志股份	36,100	268,584.00	0.02
453	688208	道通科技	11,100	267,954.00	0.02
454	601116	三江购物	35,100	267,111.00	0.02
455	600488	津药药业	75,200	257,936.00	0.02
456	601890	亚星锚链	36,400	256,620.00	0.02
457	600219	南山铝业	67,300	256,413.00	0.02
458	603496	恒为科技	10,400	254,280.00	0.02
459	000596	古井贡酒	1,200	253,284.00	0.02
460	603396	金辰股份	7,800	253,266.00	0.02
461	000963	华东医药	9,100	253,071.00	0.02
462	300033	同花顺	2,400	248,880.00	0.02
463	600997	开滦股份	36,100	247,646.00	0.02
464	600893	航发动力	6,610	241,595.50	0.02
465	300257	开山股份	23,900	241,390.00	0.02
466	002531	天顺风能	26,900	240,486.00	0.02
467	600598	北大荒	19,200	239,808.00	0.02
468	002056	横店东磁	19,100	238,177.00	0.02
469	002416	爱施德	26,800	237,180.00	0.02
470	002264	新华都	45,800	234,038.00	0.02
471	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.02
472	603809	豪能股份	28,700	231,896.00	0.02
473	300136	信维通信	11,800	231,044.00	0.02
474	300390	天华新能	13,400	230,212.00	0.02
475	603299	苏盐井神	24,100	228,950.00	0.02
476	603515	欧普照明	13,000	225,420.00	0.02
477	000783	长江证券	46,500	224,595.00	0.02
478	002807	江阴银行	59,500	224,315.00	0.02
479	002027	分众传媒	36,300	219,978.00	0.02
480	002116	中国海诚	23,200	215,992.00	0.02

481	301439	泓淋电力	16,700	211,589.00	0.02
482	600933	爱柯迪	14,300	211,497.00	0.02
483	688002	睿创微纳	7,390	206,698.30	0.02
484	600373	中文传媒	13,900	206,276.00	0.02
485	600820	隧道股份	31,500	205,695.00	0.02
486	300558	贝达药业	6,300	205,065.00	0.02
487	300039	上海凯宝	38,300	204,905.00	0.02
488	300014	亿纬锂能	5,100	203,592.00	0.02
489	600032	浙江新能	27,900	203,112.00	0.02
490	603019	中科曙光	4,800	199,200.00	0.02
491	603369	今世缘	4,300	198,660.00	0.02
492	603156	养元饮品	9,300	197,811.00	0.02
493	002367	康力电梯	34,000	196,180.00	0.02
494	600763	通策医疗	3,600	194,580.00	0.02
495	601328	交通银行	25,800	192,726.00	0.02
496	002303	美盈森	78,355	188,835.55	0.02
497	688153	唯捷创芯	5,100	188,700.00	0.02
498	600523	贵航股份	18,600	184,140.00	0.02
499	600339	中油工程	58,900	183,768.00	0.02
500	688475	萤石网络	5,367	183,068.37	0.02
501	600999	招商证券	13,100	182,221.00	0.01
502	600188	DR 兖矿能源	8,000	181,840.00	0.01
503	603228	景旺电子	5,700	181,260.00	0.01
504	600186	莲花控股	52,000	178,360.00	0.01
505	002035	华帝股份	28,400	176,932.00	0.01
506	603558	健盛集团	17,400	173,130.00	0.01
507	300170	汉得信息	27,900	171,306.00	0.01
508	002023	海特高新	18,500	169,275.00	0.01
509	600150	中国船舶	4,100	166,911.00	0.01
510	300207	欣旺达	10,800	163,836.00	0.01
511	600104	上汽集团	11,700	162,162.00	0.01
512	002825	纳尔股份	26,000	161,980.00	0.01
513	300628	亿联网络	4,400	161,788.00	0.01
514	600928	西安银行	49,200	160,884.00	0.01
515	300009	安科生物	18,800	160,552.00	0.01
516	600502	安徽建工	36,800	158,240.00	0.01
517	301069	凯盛新材	12,000	157,320.00	0.01
518	603998	方盛制药	15,300	157,131.00	0.01
519	688252	天德钰科技	10,540	153,146.20	0.01
520	600085	同仁堂	3,900	149,019.00	0.01
521	603733	仙鹤股份	8,300	145,914.00	0.01
522	300193	佳士科技	19,600	145,432.00	0.01
523	603098	森特股份	18,500	145,410.00	0.01

524	688981	中芯国际	3,100	142,910.00	0.01
525	002945	华林证券	13,900	138,722.00	0.01
526	000728	国元证券	22,300	135,138.00	0.01
527	603288	海天味业	3,700	127,539.00	0.01
528	600295	鄂尔多斯	12,800	126,976.00	0.01
529	000937	冀中能源	18,800	125,960.00	0.01
530	002984	森麒麟	5,200	125,268.00	0.01
531	000027	深圳能源	16,600	121,180.00	0.01
532	002054	德美化工	24,600	120,786.00	0.01
533	300751	迈为股份	1,000	119,480.00	0.01
534	300288	朗玛信息	11,300	119,441.00	0.01
535	603595	东尼电子	5,800	119,422.00	0.01
536	000507	珠海港	26,900	119,167.00	0.01
537	688093	世华科技	6,499	118,086.83	0.01
538	003019	宸展光电	4,600	116,518.00	0.01
539	002557	洽洽食品	4,100	115,579.00	0.01
540	603565	中谷物流	13,000	113,620.00	0.01
541	002238	天威视讯	14,300	112,255.00	0.01
542	600663	陆家嘴	12,700	112,014.00	0.01
543	688403	汇成股份	13,200	111,936.00	0.01
544	300790	宇瞳光学	8,100	109,350.00	0.01
545	300383	光环新网	12,900	109,005.00	0.01
546	002419	天虹股份	26,000	108,680.00	0.01
547	002320	海峡股份	20,400	105,264.00	0.01
548	600380	健康元	9,400	104,998.00	0.01
549	002311	海大集团	2,200	103,510.00	0.01
550	600284	浦东建设	19,200	102,528.00	0.01
551	300286	安科瑞	4,600	99,544.00	0.01
552	002215	诺普信	12,700	94,615.00	0.01
553	301080	百普赛斯	2,700	94,500.00	0.01
554	600973	宝胜股份	26,000	93,860.00	0.01
555	600879	航天电子	11,900	92,463.00	0.01
556	002664	信质集团	7,500	89,250.00	0.01
557	002019	亿帆医药	6,800	84,048.00	0.01
558	002925	盈趣科技	6,600	83,622.00	0.01
559	600546	山煤国际	5,600	81,872.00	0.01
560	688776	国光电气	1,443	79,942.20	0.01
561	603399	吉翔股份	12,600	77,994.00	0.01
562	603258	电魂网络	4,600	74,290.00	0.01
563	002088	鲁阳节能	6,100	73,749.00	0.01
564	000045	深纺织A	8,800	70,576.00	0.01
565	601928	凤凰传媒	6,400	70,144.00	0.01
566	600039	四川路桥	8,200	64,698.00	0.01

567	002645	华宏科技	9,700	61,692.00	0.01
568	002244	滨江集团	8,400	60,984.00	0.01
569	605218	伟时电子	3,700	59,755.00	0.00
570	300296	利亚德	13,200	59,400.00	0.00
571	600585	海螺水泥	2,500	58,975.00	0.00
572	600628	新世界	9,600	52,032.00	0.00
573	300320	海达股份	6,200	50,592.00	0.00
574	601801	皖新传媒	7,100	49,203.00	0.00
575	002465	海格通信	4,600	47,656.00	0.00
576	600742	一汽富维	6,300	46,935.00	0.00
577	601138	工业富联	1,700	46,580.00	0.00
578	300068	南都电源	5,600	46,368.00	0.00
579	300381	溢多利	7,300	44,822.00	0.00
580	002150	通润装备	3,400	41,582.00	0.00
581	601121	宝地矿业	7,300	41,537.00	0.00
582	600292	远达环保	8,600	40,334.00	0.00
583	000019	深粮控股	6,100	35,014.00	0.00
584	688389	深圳普门科技	1,671	27,170.46	0.00
585	600727	鲁北化工	4,300	27,090.00	0.00
586	600125	铁龙物流	4,500	26,865.00	0.00
587	301155	海力风电	600	24,138.00	0.00
588	600650	锦江在线	3,200	22,656.00	0.00
589	603350	C安乃达	1,051	21,608.56	0.00
590	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
591	600377	宁沪高速	1,500	18,900.00	0.00
592	002414	高德红外	3,100	18,259.00	0.00
593	000600	建投能源	2,800	17,640.00	0.00
594	300432	富临精工	2,700	17,388.00	0.00
595	301078	孩子王	3,300	16,698.00	0.00
596	300587	天铁股份	4,100	16,564.00	0.00
597	003022	联泓新科	1,200	16,452.00	0.00
598	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
599	000703	恒逸石化	2,000	14,180.00	0.00
600	603659	璞泰来	1,000	14,130.00	0.00
601	688584	上海合晶硅材料	866	13,760.74	0.00
602	002274	华昌化工	1,800	13,356.00	0.00
603	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
604	600236	桂冠电力	1,710	13,115.70	0.00
605	688691	灿芯半导体股份	247	10,499.97	0.00
606	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
607	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00

608	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
609	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
610	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
611	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
612	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
613	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
614	688513	苑东生物	101	5,079.29	0.00
615	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
616	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
617	603344	星德胜科技	182	4,124.12	0.00
618	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
619	002993	奥海科技	100	3,720.00	0.00
620	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
621	688029	南微医学科技	49	3,016.44	0.00
622	688698	伟创电气	108	2,912.76	0.00
623	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
624	603375	盛景微电子	72	2,800.80	0.00
625	688533	上声电子股份	102	2,638.74	0.00
626	688336	三生国健	104	2,116.40	0.00
627	688128	中国电器研究院	121	2,082.41	0.00
628	688777	中控技术	46	1,734.20	0.00
629	688239	贵州航宇科技	44	1,531.20	0.00
630	000739	普洛药业	100	1,357.00	0.00
631	688484	南芯科技	33	1,224.30	0.00
632	688358	XD 祥生医疗科技	47	1,220.59	0.00
633	603305	旭升集团	100	1,056.00	0.00
634	301018	申菱环境	50	972.00	0.00
635	688007	光峰科技	50	805.00	0.00
636	688503	聚和材料股份公司	28	786.80	0.00
637	603298	杭叉集团	40	785.60	0.00
638	600459	贵研铂业	50	675.50	0.00
639	300755	华致酒行	40	546.40	0.00
640	300797	钢研纳克	50	463.00	0.00
641	688209	英集芯科技	32	397.12	0.00
642	300508	维宏股份	20	388.60	0.00
643	688147	微导纳米科技	15	373.50	0.00
644	688433	华曙高科	15	312.90	0.00
645	688146	中船派瑞特气	10	298.50	0.00
646	603987	康德莱	42	256.62	0.00
647	603589	口子窖	6	235.14	0.00

648	603309	维力医疗	20	220.20	0.00
649	688779	长远锂科	33	152.79	0.00
650	002061	浙江交科	40	146.00	0.00
651	688509	正元地信	50	144.50	0.00
652	688657	浩辰软件	3	110.88	0.00
653	688510	航亚科技	5	92.05	0.00
654	002637	赞宇科技	10	84.60	0.00
655	688381	帝奥微电子	4	77.92	0.00
656	000597	东北制药	20	77.40	0.00
657	688123	聚辰半导体	1	60.83	0.00
658	002376	新北洋	10	53.90	0.00
659	688588	凌志软件	1	6.85	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	600276	恒瑞医药	60,689,987.0 0	2.31
2	601318	中国平安	55,871,915.6 8	2.13
3	601628	中国人寿	55,658,131.5 0	2.12
4	000568	泸州老窖	55,146,476.1 8	2.10
5	600028	中国石化	50,634,620.8 0	1.93
6	601633	长城汽车	43,361,797.6 3	1.65
7	601857	中国石油	42,812,793.0 4	1.63
8	000725	京东方 A	42,025,795.0 0	1.60
9	601138	工业富联	40,889,741.0 0	1.56
10	601888	中国中免	40,098,219.8 0	1.53
11	601728	中国电信	39,970,518.0 0	1.52
12	600519	贵州茅台	39,259,749.0	1.50

			0	
13	601390	中国中铁	39,066,683.0	1.49
			0	
14	002475	立讯精密	37,890,296.7	1.44
			5	
15	601668	中国建筑	37,634,477.0	1.43
			0	
16	002938	鹏鼎控股	36,551,679.0	1.39
			0	
17	601319	中国人保	34,912,725.0	1.33
			0	
18	600030	中信证券	34,268,696.6	1.31
			9	
19	002757	南兴股份	33,338,107.5	1.27
			0	
20	600310	广西能源	32,106,183.1	1.22
			6	

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	600276	恒瑞医药	59,251,922.1	2.26
			9	
2	601628	中国人寿	54,977,137.6	2.09
			0	
3	601857	中国石油	53,910,847.6	2.05
			4	
4	000568	泸州老窖	50,531,263.8	1.93
			2	
5	600028	中国石化	50,123,197.0	1.91
			0	
6	601318	中国平安	50,117,540.1	1.91
			6	
7	601728	中国电信	46,100,858.0	1.76
			0	
8	601138	工业富联	45,110,341.0	1.72
			0	
9	601633	长城汽车	43,674,852.1	1.66
			8	
10	601390	中国中铁	42,262,234.0	1.61

			0	
11	002415	海康威视	41,638,266.0	1.59
			0	
12	002938	鹏鼎控股	39,668,168.0	1.51
			0	
13	002913	奥士康	38,555,304.6	1.47
			6	
14	600310	广西能源	36,880,272.0	1.40
			4	
15	603993	XD 洛阳钼业	36,789,041.0	1.40
			0	
16	601766	中国中车	35,901,422.8	1.37
			5	
17	601888	中国中免	35,894,279.0	1.37
			4	
18	002475	立讯精密	35,511,381.0	1.35
			0	
19	002916	深南电路	35,349,214.0	1.35
			0	
20	601600	中国铝业	34,922,238.0	1.33
			0	

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	12,325,147,400.40
卖出股票收入（成交）总额	13,395,859,841.07

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将按照风险管理原则，以套期保值为目的，依据审慎原则适当参与股指期货投资。本基金将分析股指期货的风险收益特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，利用股指期货的杠杆作用和流动性较好的特点，及时调整投资组合的仓位及风险暴露，以提高组合的运作效率，降低基金资产调整的频率和交易成本，并更好地应对大额申购赎回等流动性风险。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将按照风险管理原则，以套期保值为目的，依据审慎原则适度参与国债期货投资。本基金运用国债期货对冲风险，利用国债期货的杠杆作用和流动性较好的特点，灵活运用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，降低基金资产调整的频率和交易成本。

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上海银行股份有限公司，2023 年 7 月至 2024 年 6 月期间，其分支行多次因业务违规、报送违规等被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行罚款、警示等。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	2,914,800.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,420,904.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,335,704.84

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
国泰君安量化选股混合发起 A	29,991	20,705.43	294,019,459.18	47.35%	326,957,024.30	52.65%
国泰君安量化选股混合发起 C	17,686	18,782.81	58,664,362.94	17.66%	273,528,471.34	82.34%
国泰君	15,863	23,074.9	334,195,512.3	91.30%	31,842,819.36	8.70%

安量化 选股混 合发起 D		8	7			
合计	63,540	20,761.8 5	686,879,334.4 9	52.07%	632,328,315.0 0	47.93%

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	国泰君安量化选股混合发起 A	4,557,612.03	0.7339%
	国泰君安量化选股混合发起 C	1,636,579.10	0.4927%
	国泰君安量化选股混合发起 D	602,650.05	0.1646%
	合计	6,796,841.18	0.5152%

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	国泰君安量化选股混合发起 A	>100
	国泰君安量化选股混合发起 C	>100
	国泰君安量化选股混合发起 D	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安量化选股混合发起 A	10~50
	国泰君安量化选股混合发起 C	>100
	国泰君安量化选股混合发起 D	0
	合计	>100

注：同时为基金管理人高级管理人员（含基金投资和部门负责人）和基金经理的，其持有份额总量的数量区间分别计算在内。

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	43,090,750.28	3.27%	15,019,000.00	1.14%	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	395,082.00	0.03%	-	-	-
基金经理等人员	1,355,938.38	0.10%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	5,045,820.80	0.38%	-	-	-
合计	49,887,591.46	3.78%	15,019,000.00	1.14%	-

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

	国泰君安量化选股混合发起 A	国泰君安量化选股混合发起 C	国泰君安量化选股混合发起 D
基金合同生效日（2022 年 08 月 18 日）基金份额总额	10,009,990.10	5,010,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	1,006,563,351.58	716,584,193.27	831,115,687.85
本报告期基金总申购份额	369,317,142.84	60,691,197.28	409,938,591.93
减：本报告期基金总赎回份额	754,904,010.94	445,082,556.27	875,015,948.05
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	620,976,483.48	332,192,834.28	366,038,331.73

注：基金总申购份额含红利再投资及转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

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

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

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

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	25,717,409,659.49	100.00%	1,858,592.81	100.00%	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024-01-22
2	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金 2023 年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-01-22
3	上海国泰君安证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-02-28
4	上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-03-20
5	上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-03-20
6	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金 2023 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-03-29
7	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024-03-29
8	国泰君安量化选股混合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
9	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024-04-22
10	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下部分产品在直销 APP 费率优惠活动的公	上海证券报、中国证券报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-05-27

	告		
11	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-06-28
12	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-06-28
13	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金（D 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2024-06-28

§ 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、关于准予国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金注册的批复；
- 2、《国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、托管人业务资格批件、营业执照；
- 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