

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

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2025 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年03月14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。

本报告期自2024年01月01日起至2024年12月31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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
8.3 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	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
8.6 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	65
8.7 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	65

8.8 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.....	65
8.9 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	65
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	65
8.12 投资组合报告附注	65
§ 9 基金份额持有人信息.....	66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
9.3 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	67
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	68
§ 10 开放式基金份额变动	68
§ 11 重大事件揭示	68
11.1 基金份额持有人大会决议	69
11.2 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.....	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4 基金投资策略的改变	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8 其他重大事件	70
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	72
12.1 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.....	72

12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
§ 13 备查文件目录	73
13.1 备查文件目录.....	73
13.2 存放地点	73
13.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金	
基金简称	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起	
基金主代码	017209	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 11 月 16 日	
基金管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	40,861,048.48 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C
下属分级基金的交易代码	017209	017210
报告期末下属分级基金的份额总额	30,315,973.45 份	10,545,075.03 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上海国泰君安证券资产管理有限公司	中国建设银行股份有限公司

		限公司	
信息披露负责人	姓名	吕巍	王小飞
	联系电话	021-38676022	021-60637103
	电子邮箱	gzxxp1@gtjas.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95521	021-60637228
传真		021-38871190	021-60635778
注册地址		上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		陶耿	张金良

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gtjazg.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢外经贸大厦 901-22 至 901-26
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年		2023 年		2022 年 11 月 16 日（基金 合同生效日）-2022 年 12 月 31 日	
	国泰君安科 技创新精选 三个月持有 股票发起 A	国泰君安科 技创新精选 三个月持有 股票发起 C	国泰君安科 技创新精选 三个月持有 股票发起 A	国泰君安科 技创新精选 三个月持有 股票发起 C	国泰君安科 技创新精选 三个月持有 股票发起 A	国泰君安科 技创新精选 三个月持有 股票发起 C

本期已实现收益	-2,177,601.67	-4,314,423.64	-1,915,838.56	-2,298,818.83	-346,177.20	-168,967.79
本期利润	-1,908,518.49	-4,913,149.39	-1,529,716.74	-2,644,373.05	-437,932.13	-223,686.09
加权平均基金份额本期利润	-0.0428	-0.2056	-0.0458	-0.0703	-0.0364	-0.0383
本期加权平均净值利润率	-4.89%	-23.87%	-4.53%	-6.90%	-3.74%	-3.93%
本期基金份额净值增长率	4.69%	4.15%	1.40%	0.92%	-3.81%	-3.87%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	379,643.78	19,631.02	-1,973,403.83	-1,419,646.07	-526,153.01	-250,528.28
期末可供分配基金份额利润	0.0125	0.0019	-0.0353	-0.0405	-0.0381	-0.0387
期末基金资产净值	30,955,411.70	10,654,970.94	54,532,719.86	33,963,615.63	13,267,478.07	6,217,495.55

期末 基金 份额 净值	1.0211	1.0104	0.9754	0.9701	0.9619	0.9613
3.1. 3 累 计期 末指 标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金 份额 累计 净值 增长 率	2.11%	1.04%	-2.46%	-2.99%	-3.81%	-3.87%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A 净值表现

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	6.36%	2.94%	3.70%	2.27%	2.66%	0.67%
过去六个月	23.11%	2.66%	20.95%	2.08%	2.16%	0.58%
过去一年	4.69%	2.27%	6.60%	1.83%	-1.91%	0.44%
自基金合同生 效起至今	2.11%	1.75%	-5.80%	1.41%	7.91%	0.34%

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C 净值表现

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	6.22%	2.94%	3.70%	2.27%	2.52%	0.67%

过去六个月	22.80%	2.66%	20.95%	2.08%	1.85%	0.58%
过去一年	4.15%	2.27%	6.60%	1.83%	-2.45%	0.44%
自基金合同生效起至今	1.04%	1.75%	-5.80%	1.41%	6.84%	0.34%

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

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年11月16日-2024年12月31日)



国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年11月16日-2024年12月31日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为 2022 年 11 月 16 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



注：本基金合同生效日为 2022 年 11 月 16 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

§ 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 12 月 31 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 57 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 指数增强基金经理，国泰君安中证 1000 指数增强基金经理，国泰君安量化选股混合发起基金经理，国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金经理，国泰君安沪深 300 指数增强发起基金经理，国泰君安中证 1000 优选股票发起基金经理，国泰君安稳健债增利债券发起基金经理，国泰君安科创板量化选股股票发起基金经理，国泰君安红利量化选股混合基金经理，国泰君安中证 A500 指数增	2022-11-16	-	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。

强基金经理。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遵规守信情况的说明

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。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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《上海国泰君安证券资产管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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 8 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

2024 年 A 股市场经历“政策驱动、结构剧变”的深度调整与修复过程，全年呈现“双底反转、风格轮动”的 W 型走势。本年度前两个季度 A 股市场呈现“V 型探底→政策托底→分化加剧”的波动特征，核心矛盾体现为政策对冲与基本面压力的博弈：一季度流动性冲击后政策快速响应稳定市场，二季度政策红利边际递减，市场回归基本面定价逻辑。从九月底开始，政策组合拳（证券基金互换便利等）超预期出台，高 Beta 板块（非银、计算机）引领反弹，风格迅速从价值切换至成长，全年 A 股整体上经历“流动性冲击→政策托底→风格再平衡”过程，监管层通过打击财务造假、优化退市等改革重塑生态，为股市中长期健康发展奠定扎实的基础。2024 年，科创 50 指数（涨幅 16.07%）表现十分亮眼，好于沪深 300（涨幅 14.68%）和中证 500（涨幅 5.46%）；科创 100 指数则出现下跌（跌幅 8.56%），表现明显弱于其他主要宽基指数。展望 2025 年，A 股有望在“政策护航与业绩修复”双轮驱动下开启慢牛征程。政策层面，互换便利与专项再贷款等央行创新货币工具进入落地阶段，叠加二十届三中全会提出的科技体制改革以及聚焦科创板高质量发展的“科创板八条”等产业政策深化，将强化流动性支持与成长股投资逻辑，市场驱动逻辑料从估值修复转向盈利验证，全 A 净利润增速有望企稳回升。结构上，上半年流动性宽松或催化小盘科技股行情，下半年随经济数据验证，顺周期板块或接力。全年看，科技与高端制造的高弹性、消费板块的修复潜力及政策受益方向或成为超额收益来源，市场或沿“震荡螺旋上升”路径演绎。

本基金聚焦科技创新类公司，特别是科创板的上市公司，具有典型成长投资风格，主要投资于成长潜力较大的科技新兴产业，挖掘 A 股未来更具潜力的结构性 Beta。以量化的方式，从各个数据维度对科技产业上市公司进行全覆盖，有效挖掘“专精特新”、“小而美”的科技创新企业，发挥量化选股及模型的优势，以期获取超越科创板主流指数（如科创 50、科创 100）的收益。同时，本基金参考中证科创信息、中证科创生物、中证科创芯片、中证科创高装、中证科创材料、中证科创新能等的行业分布，在高端装备、新材料、新能源、节能环保以及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业的科技创新企业上进行均衡配置，充分发挥量化投资分散化的优势，降低基金的整体波动。

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，量化投资在不同风格的选股方面依然有较大的可为空间和较高的性价比。在行业和个股走势出现较大的变化下，我们依然维持一贯的投资理念和投资组合管理体系，本基金在投资组合的配置和交易方面严格遵循量化模型的建议，基金经理则主要从挖掘有投资逻辑的 Alpha 因子、随着市场演变不断改进底层量化模型以及模型的日常跟踪和分析等层面不断增强策略的表现，常年来我们坚守整体一贯的投资体系和理念，也尽可能以此稳定投资者在不同市场环境下对我们超额收益率的预期。在量化增强层面，我们尽量结合以财务数据为基础的基本面信号和以量价为主的技术面信号，对于科技创新型公司也会更注重研发投入和专利数据等另类因子的挖掘和利用，并通过机器学习模型来进行有效因子的选择和因子之间的轮动，得益于基本面量化、另类因子和实时量

价在信号层面较低的相关性，使得我们有信心在兼顾各类因子的情况下追求稳健的 Alpha。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A 基金份额净值为 1.0211 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.69%，同期业绩比较基准收益率为 6.60%；截至报告期末国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C 基金份额净值为 1.0104 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.15%，同期业绩比较基准收益率为 6.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年 A 股市场呈现显著的波动性特征，全年经历了流动性冲击、政策驱动反弹及风格切换等多重考验。年初市场因雪球敲入、两融与 DMA 爆仓等风险事件引发流动性危机，中小盘指数承压；春节后政策托底力度加大，ETF 资金加速流入带动市场超跌反弹。9 月政策全面发力（如“并购六条”、市值管理政策），推动市场风险偏好大幅提升，科创板领头带领市场强势反弹。展望 2025 年，市场预计在政策深化与资金面改善的双重驱动下延续结构性行情。政策层面，“1+N”政策体系将推动资本市场高质量发展，并购重组政策引导资源向新质生产力领域集中，科技、高端制造等领域有望迎来整合潮；财政与货币政策协同发力，特别国债及专项债规模扩大，进一步释放流动性。资金面方面，险资、ETF 及外资构成三大增量来源，市场风险偏好回暖，资金供给端的规模有望较 2024 年明显改善。科创板作为市场成长股的典型代表，具有较强的新兴产业属性，盈利增长潜力较大，具有特殊的配置价值。从量化模型的 Alpha 角度来看，市场交易量的提升，风险偏好的提高有利于 Alpha 的发挥。另一方面在投研过程中，我们也逐步强化另类因子的挖掘、异质化思维建模、提升实盘模型的逻辑性、加强全方位的综合 Alpha 解决能力以及策略配置能力等，从而巩固通过量化的投资方法在成长风格下博取超额收益的能力。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合规运作角度出发，在合规文化建设、制度体系建设、合规审查及检查、反洗钱、员工执业行为规范等角度开展工作，不断深化员工的合规意识，推动公司合规文化和内部风险控制机制的完善和优化。

内部监察工作重点包括以下几个方面：

1、合规文化建设。管理人通过内外部合规培训、合规考试、法规解读、法律法规库维护更新、监管会议精神传达等多种形式推动公司合规文化建设，不断提高全体员工合规意识，为公司业务健康发展提供良好的文化土壤。

2、制度体系建设和完善。管理人根据法律法规变化，结合行业新动态，围绕新业务需要，不断优化和健全公司制度体系，并注重相关制度体系的落实和执行。通过制度体系的建设和完善，不断提升了业务管理流程的健全性、规范性、精细化和可操作性，为公司业务规范运营和合规管理进

一步夯实了制度基础。

3、合规审查和检查。根据法律法规、监管要求和公司制度规定，做好对公司新业务、新产品、新投资品种及其他创新业务的法律合规及风险控制支持，定期对产品销售、投资、研究及交易等相关业务活动的日常合规性进行检查，查漏补缺。合规检查工作促进了内部控制管理的完善，防范了合规风险的进一步发生。

4、员工执业与投资行为管理。根据法律法规和公司制度要求，管理人不断加强员工执业行为管理。管理人要求新员工入职时需提供和完善个人信息并完成相关投资的申报工作，对投资、交易人员的通讯工具实行交易时间段集中管理，并对监控摄像、电子邮件、电话录音和即时通讯工具聊天记录定期进行合规检查。通过一系列常态化的员工执业和投资行为管理，促进员工执业和投资行为持续符合监管要求。

5、反洗钱合规管理。报告期内，管理人持续加强反洗钱合规管理，制定反洗钱工作方案，并在年度内推进落实。持续做好日常可疑交易监控排查、客户风险等级划分、修订反洗钱内部控制管理制度、跟进反洗钱系统改造、完成各类反洗钱工作报告、反洗钱金融机构分类评级自评工作等。

管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部合规风控工作的科学性和有效性，努力防范和控制各类风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2025]200Z1991 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	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全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金（以下简称“国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会</p>

	(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	—
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金的基金管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p>

	<p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	张振波 徐翘楚
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢外经贸大厦 901-22 至 901-26
审计报告日期	2025-03-25

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	3,043,887.06	6,195,015.66
结算备付金		911,858.08	800,633.38
存出保证金		139,304.88	-
交易性金融资产	7.4.7.2	37,595,810.91	81,691,185.22

其中：股票投资		37,595,810.91	81,691,185.22
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	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收清算款		—	—
应收股利		—	—
应收申购款		749.23	39,421.24
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.5	—	—
资产总计		41,691,610.16	88,726,255.50
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 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	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付清算款		0.00	—
应付赎回款		60.40	—
应付管理人报酬		44,083.65	90,319.84

应付托管费		7,347.28	15,053.28
应付销售服务费		4,735.97	14,546.89
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	7.4.7.6	25,000.22	110,000.00
负债合计		81,227.52	229,920.01
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	40,861,048.48	90,916,464.97
未分配利润	7.4.7.8	749,334.16	-2,420,129.48
净资产合计		41,610,382.64	88,496,335.49
负债和净资产总计		41,691,610.16	88,726,255.50

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 40,861,048.48 份。其中国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A 基金份额净值 1.0211 元，基金份额总额 30,315,973.45 份；国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C 基金份额净值 1.0104 元，基金份额总额 10,545,075.03 份。

7.2 利润表

会计主体：国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-5,803,984.97	-2,749,444.78
1. 利息收入		24,516.03	18,732.23
其中：存款利息收入	7.4.7.9	24,516.03	18,732.23

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）		-5,525,482.87	-2,847,806.55
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-6,240,730.86	-3,365,292.40
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	7.4.7.11	279,575.38	-
股利收益	7.4.7.12	435,672.61	517,485.85
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	-329,642.57	40,567.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	26,624.44	39,061.94
减：二、营业总支出		1,017,682.91	1,424,645.01
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	716,562.12	962,316.88
2. 托管费	7.4.10.2.2	119,426.99	160,386.11
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	103,394.94	190,443.83
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		1,083.49	-

8. 其他费用	7. 4. 7. 15	77, 215. 37	111, 498. 19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6, 821, 667. 88	-4, 174, 089. 79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6, 821, 667. 88	-4, 174, 089. 79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-6, 821, 667. 88	-4, 174, 089. 79

7.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	90, 916, 464. 97	-2, 420, 129. 48	88, 496, 335. 49
二、本期期初净资产	90, 916, 464. 97	-2, 420, 129. 48	88, 496, 335. 49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-50, 055, 416. 49	3, 169, 463. 64	-46, 885, 952. 85
（一）、综合收益总额	-	-6, 821, 667. 88	-6, 821, 667. 88
（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, 055, 416. 49	9, 991, 131. 52	-40, 064, 284. 97
其中：1. 基金申购款	24, 929, 215. 60	-2, 493, 258. 33	22, 435, 957. 27
2. 基金赎回款	-74, 984, 632. 09	12, 484, 389. 85	-62, 500, 242. 24
（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）	-	0. 00	-
四、本期期末净资产	40, 861, 048. 48	749, 334. 16	41, 610, 382. 64
项 目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	20, 261, 654. 91	-776, 681. 29	19, 484, 973. 62
二、本期期初净资产	20, 261, 654. 91	-776, 681. 29	19, 484, 973. 62
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	70, 654, 810. 06	-1, 643, 448. 19	69, 011, 361. 87
（一）、综合收益总额	-	-4, 174, 089. 79	-4, 174, 089. 79
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以	70, 654, 810. 06	2, 530, 641. 60	73, 185, 451. 66

“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	92,320,281.89	2,449,137.41	94,769,419.30
2. 基金赎回款	-21,665,471.83	81,504.19	-21,583,967.64
(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	90,916,464.97	-2,420,129.48	88,496,335.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

陶耿

陶耿

王红莲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]2626号《关于准予国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金注册的批复》核准，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《国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币15,009,000.00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0947号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金基金合同》于2022年11月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为15,009,000.00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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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《国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金基金合同》，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。在投资者认购/申购时收取认购/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；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括内地依法发行上市的股票(含主板、创业板及其他依法发行、上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、政府支持机构债、政府支

持债券、可转换债券、可交换债券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，本基金可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终，扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；本基金投资于科技创新主题的股票不低于非现金基金资产的 80%。

本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业综合指数收益率*90%+中债新综合财富(总值)指数收益率*10%。

7.4.2 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》、本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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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，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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。对于已开放转换业务的基金，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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	834,423.98	702,397.76
等于： 本金	834,331.39	702,290.61
加： 应计利息	92.59	107.15
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	2,209,463.08	5,492,617.90
等于： 本金	2,209,401.29	5,492,314.92
加： 应计利息	61.79	302.98
减： 坏账准备	—	—
合计	3,043,887.06	6,195,015.66

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	37,980,339.11	—	37,595,810.91	— 384,528.20
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	37,980,339.11	—	37,595,810.91	—

				384,528.20
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日		
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	81,797,090.85	-	81,691,185.22	- 105,905.63
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	81,797,090.85	-	81,691,185.22	- 105,905.63

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 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 12 月 31 日				备注	
	合同/名义金 额	公允价值				
		资产	负债			
利率衍生工具	-	-	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	-	-	
权益衍生工具	1,202,300.00	-	-	-	-	
--股指期货	1,202,300.00	-	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	-	-	
合计	1,202,300.00	-	-	-	-	
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日				备注	
	合同/名义金 额	公允价值				
		资产	负债			
利率衍生工具	-	-	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	-	

7.4.7.3.2 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
IM2506	IM2506	1	1,151,280.00	-51,020.00
合计				-51,020.00
减: 可抵销期货暂收款				-51,020.00
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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位: 人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.22	-
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	-	-
预提审计费	25,000.00	-
预提费用	-	110,000.00

合计	25,000.22	110,000.00
----	-----------	------------

7.4.7.7 实收基金

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	55,905,576.15	55,905,576.15
本期申购	3,392,971.50	3,392,971.50
本期赎回(以“-”号填列)	-28,982,574.20	-28,982,574.20
本期末	30,315,973.45	30,315,973.45

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	35,010,888.82	35,010,888.82
本期申购	21,536,244.10	21,536,244.10
本期赎回(以“-”号填列)	-46,002,057.89	-46,002,057.89
本期末	10,545,075.03	10,545,075.03

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,973,403.83	600,547.54	-1,372,856.29
本期期初	-1,973,403.83	600,547.54	-1,372,856.29
本期利润	-2,177,601.67	269,083.18	-1,908,518.49
本期基金份额交易产生的变动数	4,530,649.28	-609,836.25	3,920,813.03
其中：基金申购款	-554,202.49	256,417.43	-297,785.06
基金赎回款	5,084,851.77	-866,253.68	4,218,598.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	379,643.78	259,794.47	639,438.25

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,419,646.07	372,372.88	-1,047,273.19
本期期初	-1,419,646.07	372,372.88	-1,047,273.19
本期利润	-4,314,423.64	-598,725.75	-4,913,149.39
本期基金份额交易产生的变动数	5,753,700.73	316,617.76	6,070,318.49
其中：基金申购款	-1,452,982.02	-742,491.25	-2,195,473.27
基金赎回款	7,206,682.75	1,059,109.01	8,265,791.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,631.02	90,264.89	109,895.91

7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	6,419.27	5,360.97
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	5,151.69	12,737.88
结算备付金利息收入	12,945.07	633.38
其他	-	-
合计	24,516.03	18,732.23

7.4.7.10 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	764,677,884.35	1,476,606,064.83
减：卖出股票成本总额	770,330,469.70	1,478,348,683.39
减：交易费用	588,145.51	1,622,673.84
买卖股票差价收入	-6,240,730.86	-3,365,292.40

7.4.7.11 衍生工具收益

7.4.7.11.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	290,220.00	-
减：其他衍生工具收益应缴纳 增值税	9,029.13	-
减：交易费用	1,615.49	-
合计	279,575.38	-

7.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	435,672.61	517,485.85
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	435,672.61	517,485.85

7.4.7.13 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-278,622.57	40,567.60
——股票投资	-278,622.57	40,567.60
——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	-51,020.00	-
——权证投资	-	-
期货投资	-51,020.00	-
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	-329,642.57	40,567.60

7.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	26,624.44	39,061.94
合计	26,624.44	39,061.94

7.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	25,000.00	30,000.00
信息披露费	50,000.00	80,000.00
证券出借违约金	—	—
银行汇划费	2,215.37	—
银行费用	—	1,098.19
其他费用	—	400.00
合计	77,215.37	111,498.19

7.4.7.16 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。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 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
中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君安证券”)	基金管理人的股东、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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 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	1,491,191,602.31	100.00%	3,018,957,043.43	100.00%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金报告期及上年度可比期间未有通过关联方单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 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	110,161.00	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 12 月 31 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	215,259.20	100.00%	0.00	0.00%

注: 1. 上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席位租用协议进行约定, 并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结算风险基金后的净额列示。

2. 该类席位租用协议服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》, 针对被动股票型基金佣金协议的服务范围不包括研究服务、流动性服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	716,562.12	962,316.88
其中: 应支付销售机构的客户维护费	146,757.82	142,897.53
应支付基金管理人的净管理费	569,804.30	819,419.35

注: 基金管理人报酬按前一日的基金资产净值的 1.20%的年费率计提。计算方法如下:

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

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	119,426.99	160,386.11

费		
---	--	--

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%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。

7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安科技创新精选 三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选 三个月持有股票发起 C	合计
国泰君安资管	-	70,319.19	70,319.19
国泰君安证券	-	27,480.97	27,480.97
合计	-	97,800.16	97,800.16
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安科技创新精选 三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选 三个月持有股票发起 C	合计
国泰君安资管	0	129,482.84	129,482.84
国泰君安证券	0	49,986.17	49,986.17
合计	0	179,469.01	179,469.01

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 0.50%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 $\times 0.50\% / \text{当年天数}$ 。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2022 年 11 月 16 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	29,671,766.69	10,009,000.00
报告期内申购/买入总份额	—	19,662,766.69
报告期内因拆分变动份额	—	—
减：报告期内赎回/卖出总份 额	19,662,766.69	—
报告期末持有的基金份额	10,009,000.00	29,671,766.69
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	33.02%	53.07%

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2022 年 11 月 16 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
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	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	47.42%	14.28%

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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰君安证券	2,209,463.08	5,151.69	5,492,617.90	12,737.88
中国建设银行	834,423.98	6,419.27	702,397.76	5,360.97

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国建设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。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2024 年 12 月 31 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）。

7.4.13.3 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在基金最短持有期到期日起（含当日）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 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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 7.4.12。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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	3,043,887.06	-	-	-	3,043,887.06
结算备付金	911,858.08	-	-	-	911,858.08
存出保证金	139,304.88	-	-	-	139,304.88
交易性金融资产	-	-	-	37,595,810.91	37,595,810.91
应收申购款	-	-	-	749.23	749.23
资产总计	4,095,050.02	-	-	37,596,560.14	41,691,610.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	60.40	60.40
应付管理人报酬	-	-	-	44,083.65	44,083.65
应付托管费	-	-	-	7,347.28	7,347.28
应付销售服务费	-	-	-	4,735.97	4,735.97
其他负债	-	-	-	25,000.22	25,000.22
负债总计	-	-	-	81,227.52	81,227.52
利率敏感度缺口	4,095,050.02	-	-	37,515,332.62	41,610,382.64
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	6,195,015.66	-	-	-	6,195,015.66
结算备付金	800,633.38	-	-	-	800,633.38
交易性金融资产	-	-	-	81,691,185.22	81,691,185.22
应收申购款	-	-	-	39,421.24	39,421.24
资产总计	6,995,649.04	-	-	81,730,606.46	88,726,255.50
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	90,319.84	90,319.84

应付托管费	-	-	-	15,053.28	15,053.28
应付销售服务费	-	-	-	14,546.89	14,546.89
其他负债	-	-	-	110,000.00	110,000.00
负债总计	-	-	-	229,920.01	229,920.01
利率敏感度缺口	6,995,649.04	-	-	81,500,686.45	88,496,335.49

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 12 月 31 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)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	37,595,810.91	90.35	81,691,185.22	92.31
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	37,595,810.91	90.35	81,691,185.22	92.31

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 7.4.1）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 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	2,539,052.93	5,081,987.72
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-2,539,052.93	-5,081,987.72

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	37,595,810.91	81,691,185.22
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	37,595,810.91	81,691,185.22

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	37,595,810.91	90.18
	其中：股票	37,595,810.91	90.18
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	3,955,745.14	9.49
8	其他各项资产	140,054.11	0.34
9	合计	41,691,610.16	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%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	21,168.00	0.05
C	制造业	28,959,075.47	69.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	51,035.00	0.12
E	建筑业	79,580.00	0.19
F	批发和零售业	408,186.00	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,113,158.30	14.69
J	金融业	450,767.00	1.08
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	96,433.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	925,962.14	2.23
N	水利、环境和公共设施管理业	49,040.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	377,555.00	0.91
R	文化、体育和娱乐业	63,851.00	0.15
S	综合	—	—
	合计	37,595,810.91	90.35

8.2.2 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。

8.3 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688981	中芯国际	17,170	1,624,625.40	3.90
2	688041	海光信息	7,978	1,195,024.62	2.87
3	688256	寒武纪	1,600	1,052,800.00	2.53
4	688008	澜起科技	11,928	809,911.20	1.95

5	688012	中微公司	3,758	710,863.28	1.71
6	300750	宁德时代	2,200	585,200.00	1.41
7	688111	金山办公	1,972	564,761.08	1.36
8	688469	芯联集成	106,000	543,780.00	1.31
9	688120	华海清科	2,930	477,560.70	1.15
10	688347	华虹公司	9,800	455,406.00	1.09
11	688223	晶科能源	59,967	426,365.37	1.02
12	688099	晶晨股份	5,970	410,019.60	0.99
13	688772	珠海冠宇	25,346	407,563.68	0.98
14	688396	华润微	8,616	406,589.04	0.98
15	688180	君实生物	13,847	378,438.51	0.91
16	688019	安集科技	2,379	331,537.44	0.80
17	688472	阿特斯	25,100	315,256.00	0.76
18	688158	优刻得	21,900	306,162.00	0.74
19	603986	兆易创新	2,800	299,040.00	0.72
20	688029	南微医学	4,400	297,396.00	0.71
21	688110	东芯股份	11,800	293,820.00	0.71
22	688107	安路科技	9,761	288,730.38	0.69
23	300433	蓝思科技	13,100	286,890.00	0.69
24	688798	艾为电子	4,100	286,262.00	0.69
25	688588	凌志软件	20,300	280,140.00	0.67
26	300502	新易盛	2,400	277,392.00	0.67
27	688009	中国通号	44,200	276,692.00	0.66
28	300015	爱尔眼科	20,100	266,325.00	0.64
29	688065	凯赛生物	6,707	260,231.60	0.63
30	688348	昱能科技	5,275	257,420.00	0.62
31	688161	威高骨科	9,917	250,106.74	0.60
32	688088	虹软科技	6,405	246,976.80	0.59
33	688425	铁建重工	55,400	243,760.00	0.59
34	300014	亿纬锂能	5,200	243,048.00	0.58
35	300628	亿联网络	6,000	231,600.00	0.56
36	301221	光庭信息	4,700	228,326.00	0.55
37	002475	立讯精密	5,600	228,256.00	0.55
38	688409	富创精密	4,300	221,751.00	0.53
39	601766	中国中车	26,300	220,394.00	0.53
40	688122	西部超导	5,101	218,424.82	0.52
41	301370	国科恒泰	20,200	218,160.00	0.52
42	688063	派能科技	5,300	212,265.00	0.51
43	300124	汇川技术	3,600	210,888.00	0.51
44	688126	沪硅产业	10,987	206,775.34	0.50
45	002273	水晶光电	9,200	204,424.00	0.49
46	002396	星网锐捷	10,600	201,294.00	0.48
47	688249	晶合集成	8,300	193,722.00	0.47

48	688538	和辉光电	83,327	193,318.64	0.46
49	688506	百利天恒	1,000	191,730.00	0.46
50	300079	数码视讯	35,300	190,973.00	0.46
51	688187	时代电气	3,900	186,888.00	0.45
52	688209	英集芯	10,546	186,347.82	0.45
53	000063	中兴通讯	4,600	185,840.00	0.45
54	300400	劲拓股份	11,400	184,908.00	0.44
55	688508	芯朋微	4,300	184,771.00	0.44
56	688128	中国电研	8,729	183,396.29	0.44
57	300579	数字认证	5,800	182,236.00	0.44
58	300648	星云股份	7,900	181,700.00	0.44
59	300398	飞凯材料	11,500	181,240.00	0.44
60	688083	中望软件	2,100	179,697.00	0.43
61	301318	维海德	6,000	177,120.00	0.43
62	300033	同花顺	600	172,500.00	0.41
63	688213	思特威	2,204	171,294.88	0.41
64	688509	正元地信	41,100	163,167.00	0.39
65	688070	纵横股份	4,600	162,380.00	0.39
66	688553	汇宇制药	10,638	161,697.60	0.39
67	601399	国机重装	52,400	161,392.00	0.39
68	688568	中科星图	3,100	158,193.00	0.38
69	300059	东方财富	6,000	154,920.00	0.37
70	688312	燕麦科技	4,900	150,920.00	0.36
71	688055	龙腾光电	36,244	149,687.72	0.36
72	300529	健帆生物	5,100	149,634.00	0.36
73	688271	联影医疗	1,159	146,497.60	0.35
74	300394	天孚通信	1,600	146,176.00	0.35
75	688385	复旦微电	3,800	145,882.00	0.35
76	688599	天合光能	7,532	145,367.60	0.35
77	688313	仕佳光子	8,846	144,985.94	0.35
78	300200	高盟新材	17,500	144,900.00	0.35
79	002414	高德红外	19,500	144,885.00	0.35
80	300274	阳光电源	1,900	140,277.00	0.34
81	300369	绿盟科技	19,200	138,048.00	0.33
82	600941	中国移动	1,100	129,976.00	0.31
83	688408	中信博	1,800	129,600.00	0.31
84	688015	交控科技	6,440	127,705.20	0.31
85	688200	华峰测控	1,200	125,400.00	0.30
86	688591	泰凌微	3,947	123,935.80	0.30
87	688578	艾力斯	2,035	121,896.50	0.29
88	000021	深科技	6,300	120,078.00	0.29
89	688005	容百科技	3,800	119,890.00	0.29
90	688105	诺唯赞	5,400	119,718.00	0.29

91	000977	浪潮信息	2,300	119,324.00	0.29
92	300215	电科院	20,000	118,600.00	0.29
93	601633	长城汽车	4,500	118,485.00	0.28
94	688208	道通科技	3,014	118,028.24	0.28
95	300533	冰川网络	5,900	116,584.00	0.28
96	603501	韦尔股份	1,100	114,851.00	0.28
97	688247	宣泰医药	11,400	114,684.00	0.28
98	300315	掌趣科技	20,800	114,400.00	0.27
99	688321	微芯生物	6,107	113,468.06	0.27
100	688652	京仪装备	2,300	112,930.00	0.27
101	300244	迪安诊断	9,800	111,230.00	0.27
102	688372	伟测科技	1,900	111,188.00	0.27
103	002230	科大讯飞	2,300	111,136.00	0.27
104	601096	宏盛华源	25,400	110,490.00	0.27
105	688017	绿的谐波	1,000	108,060.00	0.26
106	688131	皓元医药	3,003	107,207.10	0.26
107	002565	顺灏股份	35,100	106,704.00	0.26
108	600722	金牛化工	22,200	103,896.00	0.25
109	688278	特宝生物	1,400	102,718.00	0.25
110	688036	传音控股	1,078	102,410.00	0.25
111	300434	金石亚药	12,300	101,475.00	0.24
112	688702	盛科通信	1,200	100,800.00	0.24
113	688543	国科军工	2,000	100,240.00	0.24
114	300759	康龙化成	3,900	100,230.00	0.24
115	002916	深南电路	800	100,000.00	0.24
116	300726	宏达电子	3,200	99,520.00	0.24
117	300184	力源信息	10,400	97,032.00	0.23
118	688522	纳睿雷达	1,721	96,961.14	0.23
119	600887	伊利股份	3,200	96,576.00	0.23
120	300306	远方信息	8,100	93,960.00	0.23
121	688590	新致软件	5,800	92,974.00	0.22
122	688789	宏华数科	1,400	92,932.00	0.22
123	600517	国网英大	16,500	90,915.00	0.22
124	688658	悦康药业	6,300	90,783.00	0.22
125	688520	神州细胞	2,500	90,575.00	0.22
126	300424	航新科技	5,006	90,408.36	0.22
127	300757	罗博特科	400	90,128.00	0.22
128	300339	润和软件	1,800	90,054.00	0.22
129	688007	光峰科技	6,010	88,887.90	0.21
130	688248	南网科技	2,756	88,440.04	0.21
131	300018	中元股份	12,900	87,333.00	0.21
132	300445	康斯特	5,300	86,231.00	0.21
133	300054	鼎龙股份	3,300	85,866.00	0.21

134	688389	普门科技	5,700	84,873.00	0.20
135	300545	联得装备	2,700	84,591.00	0.20
136	002548	金新农	21,300	84,561.00	0.20
137	002249	大洋电机	14,100	82,767.00	0.20
138	688579	山大地纬	8,990	82,618.10	0.20
139	603259	药明康德	1,500	82,560.00	0.20
140	600050	中国联通	15,500	82,305.00	0.20
141	688337	普源精电	2,100	81,900.00	0.20
142	600703	三安光电	6,700	81,539.00	0.20
143	300346	南大光电	2,100	81,039.00	0.19
144	300039	上海凯宝	13,000	80,340.00	0.19
145	600667	太极实业	11,500	79,580.00	0.19
146	300281	金明精机	14,000	78,260.00	0.19
147	002371	北方华创	200	78,200.00	0.19
148	688612	威迈斯	3,300	77,682.00	0.19
149	688030	山石网科	4,998	77,469.00	0.19
150	300666	江丰电子	1,100	76,395.00	0.18
151	688617	惠泰医疗	200	74,466.00	0.18
152	300531	优博讯	5,100	71,145.00	0.17
153	300363	博腾股份	4,500	70,965.00	0.17
154	002027	分众传媒	10,000	70,300.00	0.17
155	688322	奥比中光	1,500	69,750.00	0.17
156	002241	歌尔股份	2,700	69,687.00	0.17
157	688728	格科微	5,126	68,893.44	0.17
158	300919	中伟股份	1,900	68,628.00	0.16
159	002938	鹏鼎控股	1,800	65,664.00	0.16
160	300373	扬杰科技	1,500	65,280.00	0.16
161	300115	长盈精密	4,000	64,960.00	0.16
162	688141	杰华特	2,105	64,434.05	0.15
163	301025	读客文化	6,700	63,851.00	0.15
164	300724	捷佳伟创	1,000	63,210.00	0.15
165	300357	我武生物	3,100	62,992.00	0.15
166	688306	均普智能	8,100	62,775.00	0.15
167	002578	闽发铝业	20,800	62,192.00	0.15
168	300722	新余国科	2,300	62,146.00	0.15
169	002459	晶澳科技	4,500	61,875.00	0.15
170	600570	恒生电子	2,200	61,578.00	0.15
171	002185	华天科技	5,300	61,533.00	0.15
172	000017	深中华 A	10,600	61,480.00	0.15
173	688432	有研硅	5,400	61,020.00	0.15
174	300505	川金诺	4,200	60,480.00	0.15
175	300207	欣旺达	2,700	60,237.00	0.14
176	688216	气派科技	2,747	59,829.66	0.14

177	688380	中微半导	2,000	59,800.00	0.14
178	300413	芒果超媒	2,200	59,158.00	0.14
179	300477	合纵科技	20,700	58,788.00	0.14
180	301112	信邦智能	2,500	58,425.00	0.14
181	301121	紫建电子	1,100	58,366.00	0.14
182	000725	京东方 A	13,100	57,509.00	0.14
183	300618	寒锐钴业	1,700	57,409.00	0.14
184	300459	汤姆猫	10,000	57,400.00	0.14
185	300142	沃森生物	4,700	56,776.00	0.14
186	688079	美迪凯	6,500	56,290.00	0.14
187	601106	中国一重	19,300	56,163.00	0.13
188	300002	神州泰岳	4,800	55,632.00	0.13
189	688067	爱威科技	3,300	55,176.00	0.13
190	603893	瑞芯微	500	55,030.00	0.13
191	688215	瑞晟智能	2,700	54,432.00	0.13
192	688663	新风光	2,500	54,275.00	0.13
193	601608	中信重工	12,900	54,180.00	0.13
194	688428	诺诚健华	4,400	54,032.00	0.13
195	688362	甬矽电子	1,594	53,685.92	0.13
196	300032	金龙机电	11,900	53,669.00	0.13
197	300250	初灵信息	3,800	53,580.00	0.13
198	688410	山外山	4,800	53,568.00	0.13
199	600096	云天化	2,400	53,520.00	0.13
200	600406	国电南瑞	2,100	52,962.00	0.13
201	002506	协鑫集成	19,800	52,866.00	0.13
202	688252	天德钰	2,200	52,690.00	0.13
203	002489	浙江永强	16,200	52,488.00	0.13
204	688521	芯原股份	1,000	52,430.00	0.13
205	300011	鼎汉技术	7,000	50,960.00	0.12
206	300988	津荣天宇	2,800	50,512.00	0.12
207	300735	光弘科技	1,800	50,382.00	0.12
208	000026	飞亚达	4,800	49,776.00	0.12
209	002549	凯美特气	8,000	49,040.00	0.12
210	688050	爱博医疗	534	48,610.02	0.12
211	300453	三鑫医疗	6,500	48,490.00	0.12
212	300080	易成新能	11,000	48,070.00	0.12
213	600031	三一重工	2,900	47,792.00	0.11
214	300645	正元智慧	3,200	47,008.00	0.11
215	300674	宇信科技	2,400	46,848.00	0.11
216	300978	东箭科技	4,300	46,827.00	0.11
217	600875	东方电气	2,900	46,081.00	0.11
218	688234	天岳先进	900	46,080.00	0.11
219	300341	麦克奥迪	2,600	45,526.00	0.11

220	301282	金禄电子	2,100	43,995.00	0.11
221	300598	诚迈科技	900	43,560.00	0.10
222	600550	保变电气	5,500	43,175.00	0.10
223	605117	德业股份	500	42,400.00	0.10
224	688233	神工股份	1,800	42,210.00	0.10
225	300438	鹏辉能源	1,500	42,165.00	0.10
226	000938	紫光股份	1,500	41,745.00	0.10
227	600482	中国动力	1,700	41,599.00	0.10
228	688662	富信科技	1,200	41,184.00	0.10
229	300661	圣邦股份	500	40,890.00	0.10
230	601138	工业富联	1,900	40,850.00	0.10
231	688363	华熙生物	800	40,832.00	0.10
232	688550	瑞联新材	1,300	40,677.00	0.10
233	688419	耐科装备	1,300	40,404.00	0.10
234	000100	TCL 科技	8,000	40,240.00	0.10
235	300672	国科微	600	40,050.00	0.10
236	688082	盛美上海	400	40,000.00	0.10
237	600812	华北制药	7,700	39,809.00	0.10
238	300812	易天股份	1,800	39,672.00	0.10
239	300601	康泰生物	2,300	39,445.00	0.09
240	300634	彩讯股份	1,800	39,240.00	0.09
241	605299	舒华体育	4,900	38,661.00	0.09
242	002164	宁波东力	7,700	38,577.00	0.09
243	300682	朗新集团	3,100	37,820.00	0.09
244	688148	芳源股份	7,500	37,125.00	0.09
245	002415	海康威视	1,200	36,840.00	0.09
246	688586	江航装备	3,800	36,366.00	0.09
247	601012	隆基绿能	2,300	36,133.00	0.09
248	600309	万华化学	500	35,675.00	0.09
249	688516	奥特维	800	34,648.00	0.08
250	300968	格林精密	2,100	34,608.00	0.08
251	300292	吴通控股	6,800	32,980.00	0.08
252	600536	中国软件	700	32,683.00	0.08
253	000509	华塑控股	9,800	32,634.00	0.08
254	688220	翱捷科技	600	32,454.00	0.08
255	603288	海天味业	700	32,130.00	0.08
256	300172	中电环保	6,300	31,815.00	0.08
257	300576	容大感光	700	31,626.00	0.08
258	688625	呈和科技	800	30,544.00	0.07
259	300581	晨曦航空	2,700	30,267.00	0.07
260	300507	苏奥传感	4,500	30,150.00	0.07
261	688607	康众医疗	2,186	28,964.50	0.07
262	688484	南芯科技	800	28,832.00	0.07

263	000768	中航西飞	1,000	28,240.00	0.07
264	600879	航天电子	3,100	27,776.00	0.07
265	601728	中国电信	3,800	27,436.00	0.07
266	301029	怡合达	1,100	27,192.00	0.07
267	600210	紫江企业	4,100	27,101.00	0.07
268	300766	每日互动	1,800	26,298.00	0.06
269	300541	先进数通	1,900	25,745.00	0.06
270	300567	精测电子	400	25,720.00	0.06
271	300447	全信股份	1,800	25,506.00	0.06
272	300760	迈瑞医疗	100	25,500.00	0.06
273	688722	同益中	2,000	25,500.00	0.06
274	002036	联创电子	2,700	25,380.00	0.06
275	300241	瑞丰光电	4,600	25,254.00	0.06
276	300729	乐歌股份	1,500	23,820.00	0.06
277	688518	联赢激光	1,500	23,760.00	0.06
278	002446	盛路通信	3,600	23,580.00	0.06
279	688123	聚辰股份	400	23,408.00	0.06
280	688351	微电生理	1,225	23,324.00	0.06
281	300696	爱乐达	1,500	23,295.00	0.06
282	002920	德赛西威	200	22,022.00	0.05
283	300409	道氏技术	1,600	21,776.00	0.05
284	301078	孩子王	1,900	21,622.00	0.05
285	002456	欧菲光	1,800	21,564.00	0.05
286	002361	神剑股份	3,900	21,255.00	0.05
287	601899	紫金矿业	1,400	21,168.00	0.05
288	300573	兴齐眼药	300	20,934.00	0.05
289	300699	光威复材	600	20,790.00	0.05
290	300160	秀强股份	3,700	20,128.00	0.05
291	688660	电气风电	2,200	19,800.00	0.05
292	600769	祥龙电业	2,000	19,220.00	0.05
293	300763	锦浪科技	300	18,321.00	0.04
294	688228	开普云	400	17,824.00	0.04
295	300781	因赛集团	300	17,709.00	0.04
296	688222	成都先导	1,400	17,248.00	0.04
297	300277	海联讯	1,500	16,905.00	0.04
298	300149	睿智医药	2,600	16,692.00	0.04
299	000166	申万宏源	3,100	16,585.00	0.04
300	301132	满坤科技	600	16,500.00	0.04
301	002204	大连重工	3,300	16,434.00	0.04
302	002151	北斗星通	600	15,924.00	0.04
303	000617	中油资本	2,300	15,847.00	0.04
304	601600	中国铝业	2,100	15,435.00	0.04
305	300259	新天科技	4,400	15,400.00	0.04

306	300546	雄帝科技	900	15,138.00	0.04
307	301205	联特科技	200	15,138.00	0.04
308	002008	大族激光	600	15,000.00	0.04
309	000419	通程控股	2,600	14,846.00	0.04
310	300570	太辰光	200	14,540.00	0.03
311	688609	九联科技	1,300	13,780.00	0.03
312	300632	光莆股份	1,200	13,308.00	0.03
313	603000	人民网	600	13,224.00	0.03
314	688661	和林微纳	400	13,204.00	0.03
315	000559	万向钱潮	2,100	12,915.00	0.03
316	688739	成大生物	500	12,890.00	0.03
317	002421	达实智能	3,600	12,348.00	0.03
318	000997	新大陆	600	11,970.00	0.03
319	301036	双乐股份	300	11,760.00	0.03
320	002180	纳思达	400	11,268.00	0.03
321	688496	清越科技	1,314	11,260.98	0.03
322	300821	东岳硅材	1,400	10,864.00	0.03
323	300558	贝达药业	200	10,786.00	0.03
324	601179	中国西电	1,400	10,626.00	0.03
325	001216	华瓷股份	800	10,200.00	0.02
326	300136	信维通信	400	10,176.00	0.02
327	300638	广和通	500	10,075.00	0.02
328	301312	智立方	200	9,720.00	0.02
329	600267	海正药业	1,100	9,130.00	0.02
330	300101	振芯科技	400	8,664.00	0.02
331	300662	科锐国际	400	8,424.00	0.02
332	300758	七彩化学	700	8,386.00	0.02
333	688066	航天宏图	400	8,160.00	0.02
334	688169	石头科技	37	8,113.73	0.02
335	688577	浙海德曼	200	7,836.00	0.02
336	002558	巨人网络	600	7,614.00	0.02
337	688100	威胜信息	200	7,240.00	0.02
338	300088	长信科技	1,100	7,194.00	0.02
339	600582	天地科技	1,100	6,798.00	0.02
340	300975	商络电子	600	6,750.00	0.02
341	603888	新华网	300	6,702.00	0.02
342	300381	溢多利	900	6,318.00	0.02
343	300004	南风股份	1,000	6,150.00	0.01
344	688002	睿创微纳	126	5,923.26	0.01
345	300454	深信服	100	5,740.00	0.01
346	688777	中控技术	47	2,334.49	0.01
347	688690	纳微科技	115	2,024.00	0.00
348	688699	明微电子	45	1,617.30	0.00

349	688133	泰坦科技	50	912.00	0.00
350	688010	福光股份	21	598.50	0.00
351	688371	菲沃泰	21	325.92	0.00
352	688403	汇成股份	36	322.56	0.00
353	688443	智翔金泰	10	250.90	0.00
354	688468	科美诊断	3	20.55	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	688041	海光信息	12,150,536.38	13.73
2	688981	中芯国际	10,106,327.31	11.42
3	688271	联影医疗	9,391,260.38	10.61
4	688111	金山办公	8,204,721.17	9.27
5	688008	澜起科技	6,783,972.33	7.67
6	688012	中微公司	6,462,547.79	7.30
7	600276	恒瑞医药	6,017,116.00	6.80
8	688187	时代电气	5,894,913.26	6.66
9	688036	传音控股	5,888,233.28	6.65
10	688099	晶晨股份	5,679,147.18	6.42
11	688772	珠海冠宇	5,675,128.73	6.41
12	300750	宁德时代	5,556,413.00	6.28
13	688590	新致软件	5,464,609.32	6.17
14	688472	阿特斯	4,893,398.05	5.53
15	688139	海尔生物	4,529,966.52	5.12
16	688599	天合光能	4,409,943.44	4.98
17	688223	晶科能源	4,388,595.27	4.96
18	688065	凯赛生物	4,357,150.01	4.92
19	688183	生益电子	4,320,766.64	4.88
20	688525	佰维存储	4,014,655.70	4.54
21	688222	成都先导	3,984,013.55	4.50
22	688578	艾力斯	3,958,156.01	4.47
23	688009	中国通号	3,877,798.96	4.38
24	688128	中国电研	3,844,249.90	4.34
25	688601	力芯微	3,730,695.37	4.22
26	688105	诺唯赞	3,685,096.12	4.16
27	688819	天能股份	3,606,141.48	4.07
28	688072	拓荆科技	3,533,304.66	3.99
29	688248	南网科技	3,487,737.72	3.94
30	688249	晶合集成	3,375,966.59	3.81

31	688778	厦钨新能	3,364,915.90	3.80
32	601766	中国中车	3,342,750.00	3.78
33	600050	中国联通	3,250,476.00	3.67
34	000725	京东方 A	3,249,946.00	3.67
35	688363	华熙生物	3,218,442.47	3.64
36	688362	甬矽电子	3,210,430.17	3.63
37	688169	石头科技	3,186,939.21	3.60
38	688561	奇安信	3,178,163.55	3.59
39	688408	中信博	3,139,625.40	3.55
40	688352	颀中科技	3,125,621.28	3.53
41	688088	虹软科技	3,032,780.03	3.43
42	688252	天德钰	2,981,509.04	3.37
43	688141	杰华特	2,945,312.04	3.33
44	688313	仕佳光子	2,911,221.59	3.29
45	688029	南微医学	2,862,592.39	3.23
46	688208	道通科技	2,830,709.80	3.20
47	688002	睿创微纳	2,828,581.52	3.20
48	688116	天奈科技	2,760,218.19	3.12
49	688050	爱博医疗	2,713,090.52	3.07
50	688389	普门科技	2,712,328.09	3.06
51	688018	乐鑫科技	2,696,487.63	3.05
52	688122	西部超导	2,650,920.86	3.00
53	688147	微导纳米	2,646,366.76	2.99
54	688146	中船特气	2,618,979.13	2.96
55	688779	五矿新能	2,602,689.80	2.94
56	688019	安集科技	2,493,661.72	2.82
57	603439	贵州三力	2,459,963.00	2.78
58	688166	博瑞医药	2,445,875.47	2.76
59	002938	鹏鼎控股	2,435,060.00	2.75
60	688372	伟测科技	2,407,982.21	2.72
61	688213	思特威	2,404,930.76	2.72
62	688289	圣湘生物	2,399,867.24	2.71
63	688126	沪硅产业	2,385,654.22	2.70
64	000963	华东医药	2,348,422.00	2.65
65	688403	汇成股份	2,318,817.88	2.62
66	300760	迈瑞医疗	2,316,392.00	2.62
67	300433	蓝思科技	2,313,350.00	2.61
68	688800	瑞可达	2,286,664.22	2.58
69	601633	长城汽车	2,274,830.00	2.57
70	688076	诺泰生物	2,262,398.14	2.56
71	300408	三环集团	2,217,110.00	2.51
72	688150	莱特光电	2,196,316.22	2.48
73	688123	聚辰股份	2,188,035.95	2.47

74	688336	三生国健	2,187,918.01	2.47
75	002241	歌尔股份	2,172,285.00	2.45
76	301165	锐捷网络	2,157,019.00	2.44
77	300308	中际旭创	2,156,359.00	2.44
78	688484	南芯科技	2,136,328.06	2.41
79	688281	华秦科技	2,134,334.19	2.41
80	688586	江航装备	2,104,376.39	2.38
81	688188	柏楚电子	2,092,432.59	2.36
82	603993	洛阳钼业	2,045,740.00	2.31
83	688003	天准科技	2,007,072.47	2.27
84	688439	振华风光	1,978,053.61	2.24
85	688510	航亚科技	1,977,650.66	2.23
86	688298	东方生物	1,970,886.10	2.23
87	688690	纳微科技	1,963,644.63	2.22
88	002475	立讯精密	1,962,969.00	2.22
89	688728	格科微	1,944,751.79	2.20
90	688579	山大地纬	1,888,272.66	2.13
91	300759	康龙化成	1,887,646.00	2.13
92	688007	光峰科技	1,867,257.63	2.11
93	688306	均普智能	1,843,385.69	2.08
94	603228	景旺电子	1,838,095.00	2.08
95	688687	凯因科技	1,833,990.51	2.07
96	688568	中科星图	1,827,571.45	2.07
97	603501	韦尔股份	1,814,319.00	2.05
98	600776	东方通信	1,801,103.00	2.04
99	688167	炬光科技	1,799,310.57	2.03
100	688120	华海清科	1,794,255.01	2.03
101	688253	英诺特	1,787,789.07	2.02
102	688106	金宏气体	1,785,159.38	2.02
103	688425	铁建重工	1,776,682.00	2.01

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关费用。

8.4.2 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	688041	海光信息	11,985,112.05	13.54
2	688981	中芯国际	10,745,474.63	12.14
3	688271	联影医疗	9,426,096.98	10.65
4	688111	金山办公	9,101,665.95	10.28
5	688187	时代电气	8,084,406.54	9.14
6	688012	中微公司	7,923,473.45	8.95

7	688008	澜起科技	7,257,968.46	8.20
8	688036	传音控股	6,435,412.88	7.27
9	600276	恒瑞医药	6,286,850.84	7.10
10	688099	晶晨股份	6,207,247.97	7.01
11	688772	珠海冠宇	5,885,375.95	6.65
12	688472	阿特斯	5,360,094.09	6.06
13	300750	宁德时代	5,287,155.55	5.97
14	688599	天合光能	5,252,836.29	5.94
15	688590	新致软件	5,227,110.69	5.91
16	688183	生益电子	4,957,274.60	5.60
17	688223	晶科能源	4,919,095.38	5.56
18	688009	中国通号	4,754,510.29	5.37
19	688139	海尔生物	4,497,577.53	5.08
20	688525	佰维存储	4,141,483.97	4.68
21	688601	力芯微	4,102,618.81	4.64
22	688819	天能股份	4,083,957.12	4.61
23	688065	凯赛生物	4,022,382.41	4.55
24	688222	成都先导	4,014,941.43	4.54
25	688578	艾力斯	4,009,508.47	4.53
26	688128	中国电研	3,894,044.74	4.40
27	688002	睿创微纳	3,733,863.37	4.22
28	688072	拓荆科技	3,638,744.48	4.11
29	688248	南网科技	3,561,643.36	4.02
30	688252	天德钰	3,522,645.94	3.98
31	688105	诺唯赞	3,503,464.90	3.96
32	601766	中国中车	3,469,478.00	3.92
33	688778	厦钨新能	3,415,684.54	3.86
34	688484	南芯科技	3,399,989.22	3.84
35	688385	复旦微电	3,365,629.66	3.80
36	688003	天准科技	3,271,046.47	3.70
37	000725	京东方 A	3,224,694.00	3.64
38	688249	晶合集成	3,203,472.63	3.62
39	688503	聚和材料	3,199,259.82	3.62
40	600050	中国联通	3,182,994.00	3.60
41	688362	甬矽电子	3,180,716.48	3.59
42	688389	普门科技	3,091,811.46	3.49
43	688169	石头科技	3,069,408.13	3.47
44	688363	华熙生物	3,060,190.68	3.46
45	688408	中信博	3,051,858.90	3.45
46	601633	长城汽车	3,045,749.00	3.44
47	688336	三生国健	3,026,943.48	3.42
48	688018	乐鑫科技	3,020,439.13	3.41
49	688561	奇安信	3,001,136.42	3.39

50	688475	萤石网络	2,990,946.23	3.38
51	688141	杰华特	2,914,600.20	3.29
52	688088	虹软科技	2,896,005.33	3.27
53	688313	仕佳光子	2,890,942.22	3.27
54	688050	爱博医疗	2,840,311.43	3.21
55	688396	华润微	2,785,219.21	3.15
56	688779	五矿新能	2,784,859.45	3.15
57	688116	天奈科技	2,735,086.70	3.09
58	688208	道通科技	2,733,159.75	3.09
59	688352	颀中科技	2,699,894.90	3.05
60	688586	江航装备	2,695,251.82	3.05
61	688122	西部超导	2,667,513.23	3.01
62	688166	博瑞医药	2,649,310.98	2.99
63	688707	振华新材	2,618,813.61	2.96
64	688146	中船特气	2,611,626.00	2.95
65	688147	微导纳米	2,603,413.62	2.94
66	002938	鹏鼎控股	2,571,667.00	2.91
67	688138	清溢光电	2,560,666.45	2.89
68	002558	巨人网络	2,519,536.00	2.85
69	688516	奥特维	2,507,323.42	2.83
70	688403	汇成股份	2,466,471.24	2.79
71	688289	圣湘生物	2,441,225.67	2.76
72	688029	南微医学	2,431,218.61	2.75
73	688800	瑞可达	2,429,097.36	2.74
74	688306	均普智能	2,407,256.02	2.72
75	300760	迈瑞医疗	2,388,648.00	2.70
76	603993	洛阳钼业	2,388,264.00	2.70
77	603439	贵州三力	2,367,844.00	2.68
78	000963	华东医药	2,353,756.00	2.66
79	688106	金宏气体	2,353,477.35	2.66
80	002916	深南电路	2,323,784.00	2.63
81	002241	歌尔股份	2,315,354.00	2.62
82	688213	思特威	2,313,999.34	2.61
83	688372	伟测科技	2,296,129.87	2.59
84	688126	沪硅产业	2,283,157.26	2.58
85	688439	振华风光	2,262,875.53	2.56
86	301165	锐捷网络	2,253,314.00	2.55
87	300433	蓝思科技	2,236,462.00	2.53
88	300408	三环集团	2,234,362.00	2.52
89	688123	聚辰股份	2,234,175.88	2.52
90	688076	诺泰生物	2,188,575.52	2.47
91	688150	莱特光电	2,186,608.91	2.47
92	688049	炬芯科技	2,152,735.20	2.43

93	688281	华秦科技	2,146,220.27	2.43
94	688019	安集科技	2,144,405.75	2.42
95	300558	贝达药业	2,101,343.00	2.37
96	688521	芯原股份	2,072,874.93	2.34
97	300308	中际旭创	2,050,564.84	2.32
98	688234	天岳先进	2,034,451.57	2.30
99	688298	东方生物	2,023,637.35	2.29
100	688510	航亚科技	2,006,474.26	2.27
101	688366	昊海生科	2,005,316.26	2.27
102	688568	中科星图	1,994,304.14	2.25
103	688569	铁科轨道	1,977,420.64	2.23
104	688188	柏楚电子	1,966,487.35	2.22
105	600776	东方通信	1,951,576.00	2.21
106	603228	景旺电子	1,936,806.00	2.19
107	688006	杭可科技	1,931,780.82	2.18
108	002913	奥士康	1,905,117.00	2.15
109	688690	纳微科技	1,897,488.29	2.14
110	688588	凌志软件	1,893,070.08	2.14
111	002475	立讯精密	1,892,486.00	2.14
112	688400	凌云光	1,891,720.05	2.14
113	300759	康龙化成	1,874,653.99	2.12
114	601600	中国铝业	1,849,487.00	2.09
115	600812	华北制药	1,846,143.00	2.09
116	688728	格科微	1,837,012.39	2.08
117	688253	英诺特	1,832,651.41	2.07
118	688579	山大地纬	1,795,544.20	2.03

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关费用。

8.4.3 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	726,513,717.96
卖出股票收入（成交）总额	764,677,884.35

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（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	139,304.88
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	749.23
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	140,054.11

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	213	142,328.51	10,009,000.00	33.02%	20,306,973.45	66.98%
国泰君安科技	118	89,365.04	7,569,138.35	71.78%	2,975,936.68	28.22%

创新精选三个 月持有股票发 起 C						
合计	331	123,447.2 8	17,578,138.3 5	43.02%	23,282,910.1 3	56.98%

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）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业 人员持有本基金	国泰君安科技创新精 选三个月持有股票发 起 A	2,659,975.51	8.7742%
	国泰君安科技创新精 选三个月持有股票发 起 C	56,146.57	0.5324%
	合计	2,716,122.08	6.6472%

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）。

9.3 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	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	>100
	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	>100
	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C	0

	合计	>100
--	----	------

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

9.4 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 持有限期
基金管理人固 有资金	15,009,000.0 0	36.73%	15,009,000.0 0	36.73%	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	180,865.96	0.44%	—	—	—
基金经理等人 员	1,073,088.26	2.63%	—	—	—
基金管理人股 东	—	—	—	—	—
其他	1,462,167.86	3.58%	—	—	—
合计	17,725,122.0 8	43.38%	15,009,000.0 0	36.73%	—

注：其他为公司普通员工持有份额，持有限期为不低于 6 个月。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安科技创新精选 三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选 三个月持有股票发起 C
基金合同生效日（2022 年 11 月 16 日）基金 份额总额	10,009,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	55,905,576.15	35,010,888.82
本报告期基金总申购份额	3,392,971.50	21,536,244.10
减：本报告期基金总赎回份额	28,982,574.20	46,002,057.89
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	30,315,973.45	10,545,075.03

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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》，由叶明同志代为履行首席信息官职责，朱晓力同志不再担任公司首席信息官职务，生效日期为 2024 年 2 月 26 日。

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》，陶耿同志兼任公司财务负责人，吕巍同志兼任公司首席风险官；叶明同志不再兼任财务负责人、首席风险官职务，生效日期为 2024 年 3 月 18 日。

2024 年 8 月 15 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》，吴楠同志和周诗宇同志不再担任公司副总裁职务，生效日期为 2024 年 8 月 13 日。

2024 年 9 月 7 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》，丁杰能同志担任公司副总裁职务，生效日期为 2024 年 9 月 5 日。

2、本报告期内本基金托管人重大人事变动如下：

经中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，蔡亚蓉女士不再担任中国建设银行资产托管业务部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

11.5 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于 2024-11-5 日改聘为其审计的会计师事务所。报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 25,000.00 元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为改聘日至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	2	1,491,191,602.31	100.00%	110,161.00	100.00%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

11.8 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	国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金 2023 年第 4 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	国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金 2023 年年度报告	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	上海证券报、中国证券报、证	2024-03-29

	限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	券时报、证券日报	
8	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 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	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（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
11	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（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
12	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 2024 年第 2 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-07-19
13	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年第 2 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	2024-07-19
14	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	2024-08-15
15	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 2024 年中期报告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024-08-15
16	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年中期报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024-08-30
17	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	2024-09-07
18	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 2024 年第 3 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-10-25
19	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年第 3 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	2024-10-25
20	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在国泰君安资管 APP 开通基金转换业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2024-10-31

21	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-11-06
22	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下部分基金在国泰君安资管 APP 转换业务费用计算方法、转换业务适用范围和规则的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2024-11-07
23	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（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	2024-11-15
24	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（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	2024-11-15
25	国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2024 年第 1 号）	证监会指定网站、公司官网	2024-11-15
26	在本报告期内刊登的其他公告	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240101-20241231	34,671,766.69	-	19,662,766.69	15,009,000.00	36.73%
个人	1	20240828-20241231	10,054,667.65	-	-	10,054,667.65	24.61%

产品特有风险

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

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

- (2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要, 则可能使基金资产净值受到不利影响, 影响基金的投资运作和收益水平;
- (3) 因基金净值精度计算问题, 或因赎回费收入归基金资产, 导致基金净值出现较大波动;
- (4) 基金资产规模过小, 可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;
- (5) 大额赎回导致基金资产规模过小, 不能满足存续的条件, 基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金注册的批复;
- 2、《国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金基金合同》;
- 3、《国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金托管协议》;
- 4、《国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金招募说明书》;
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照;
- 7、法律意见书;
- 8、中国证监会要求的其他文件。

13.2 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>。

13.3 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

二〇二五年三月三十一日