

国泰君安科创板量化选股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:中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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04月16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	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
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	13
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 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	22
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
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	64
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	64

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.....	64
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	64
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.....	66
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	67
§ 10 开放式基金份额变动.....	67
§ 11 重大事件揭示	68
11.1 基金份额持有人大会决议	68
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.....	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
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	69
11.8 其他重大事件.....	69
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	71
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.....	71

12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
§ 13 备查文件目录	71
13.1 备查文件目录.....	71
13.2 存放地点	72
13.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金	
基金简称	国泰君安科创板量化选股股票发起	
基金主代码	020698	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 04 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	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	59,129,393.94 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安科创板量化选股股票发起 A	国泰君安科创板量化选股股票发起 C
下属分级基金的交易代码	020698	020699
报告期末下属分级基金的份额总额	37,437,385.16 份	21,692,008.78 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资科创板上市企业，以数量化投资方法为基础，在严格控制风险的前提下，力求实现长期超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采用数量化投资策略建立投资模型，重点投资于科创板上市公司证券，在投资过程中严格遵守数量化投资纪律，将大类资产配置策略和个股优选策略相结合，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。 本基金其他主要投资策略包括：1、资产配置策略 2、量化选股策略 3、存托凭证投资策略 4、债券投资策略 5、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略 6、资产支持证券投资策略 7、股指期货交易策略 8、国债期货交易策略 9、股票期权投资策略 10、融资策略。
业绩比较基准	上证科创板 50 成份指数收益率*45%+上证科创板 100 指数收益率*45%+中债综合全价（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	中国光大银行股份有限公司

		限公司	
信息披露负责人	姓名	吕巍	王茵
	联系电话	021-38676022	010-63639180
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		95521	95595
传真		021-38871190	010-63639132
注册地址		上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		200120	100033
法定代表人		陶耿	吴利军

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	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
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 04 月 16 日（基金合同生效日）-2024 年 12 月 31 日	
	国泰君安科创板量化选股股票发起 A	国泰君安科创板量化选股股票发起 C
本期已实现收益	9,926,804.25	1,371,675.32
本期利润	4,238,051.94	6,439,845.09

加权平均基金份额本期利润	0.0878	0.1486
本期加权平均净值利润率	8.53%	15.04%
本期基金份额净值增长率	17.38%	17.04%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	
期末可供分配利润	6,507,795.86	3,696,346.67
期末可供分配基金份额利润	0.1738	0.1704
期末基金资产净值	43,945,181.02	25,388,355.45
期末基金份额净值	1.1738	1.1704
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	
基金份额累计净值增长率	17.38%	17.04%

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）。

（4）本基金于 2024 年 04 月 16 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

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

国泰君安科创板量化选股股票发起 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	7.02%	2.99%	7.87%	3.06%	-0.85%	-0.07%
过去六个月	24.30%	2.74%	28.07%	2.81%	-3.77%	-0.07%
自基金合同生 效起至今	17.38%	2.36%	22.07%	2.48%	-4.69%	-0.12%

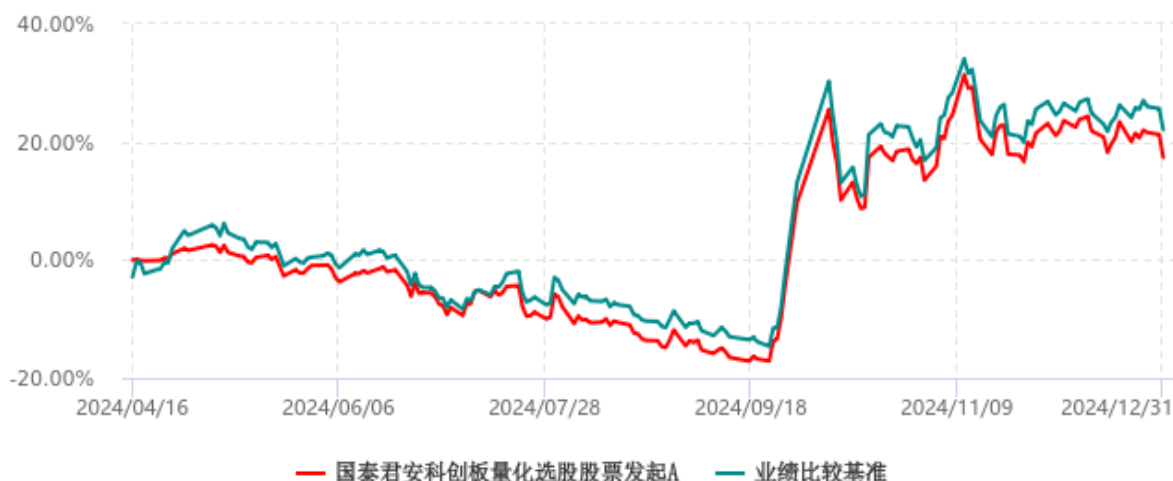
国泰君安科创板量化选股股票发起 C 净值表现

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	6.91%	2.99%	7.87%	3.06%	-0.96%	-0.07%
过去六个月	24.05%	2.74%	28.07%	2.81%	-4.02%	-0.07%
自基金合同生 效起至今	17.04%	2.36%	22.07%	2.48%	-5.03%	-0.12%

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

国泰君安科创板量化选股股票发起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

(2024年04月16日-2024年12月31日)

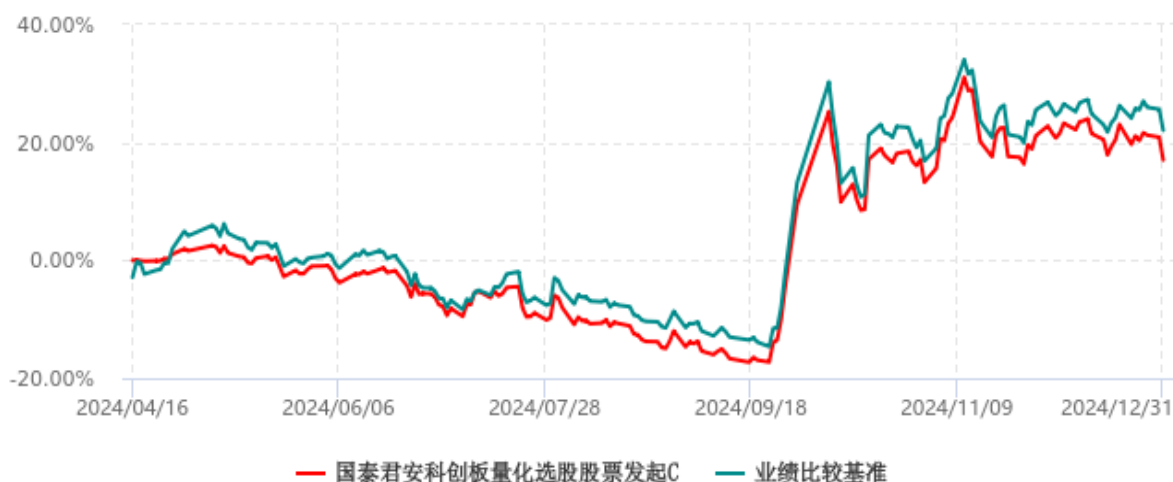


注：1、本基金于 2024 年 04 月 16 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

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

国泰君安科创板量化选股股票发起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

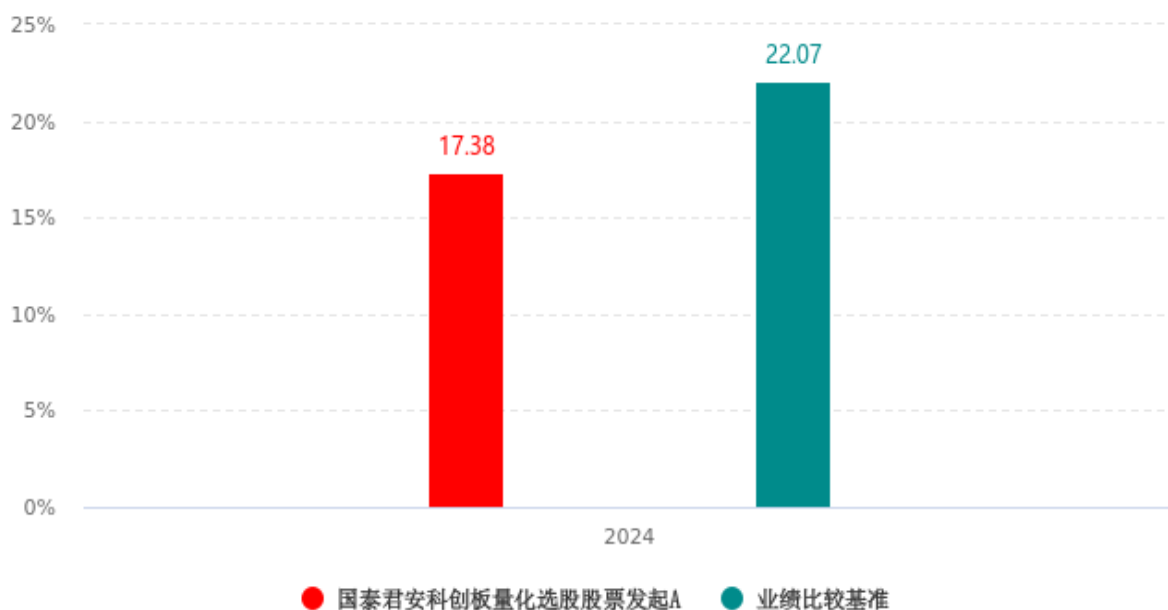
(2024年04月16日-2024年12月31日)



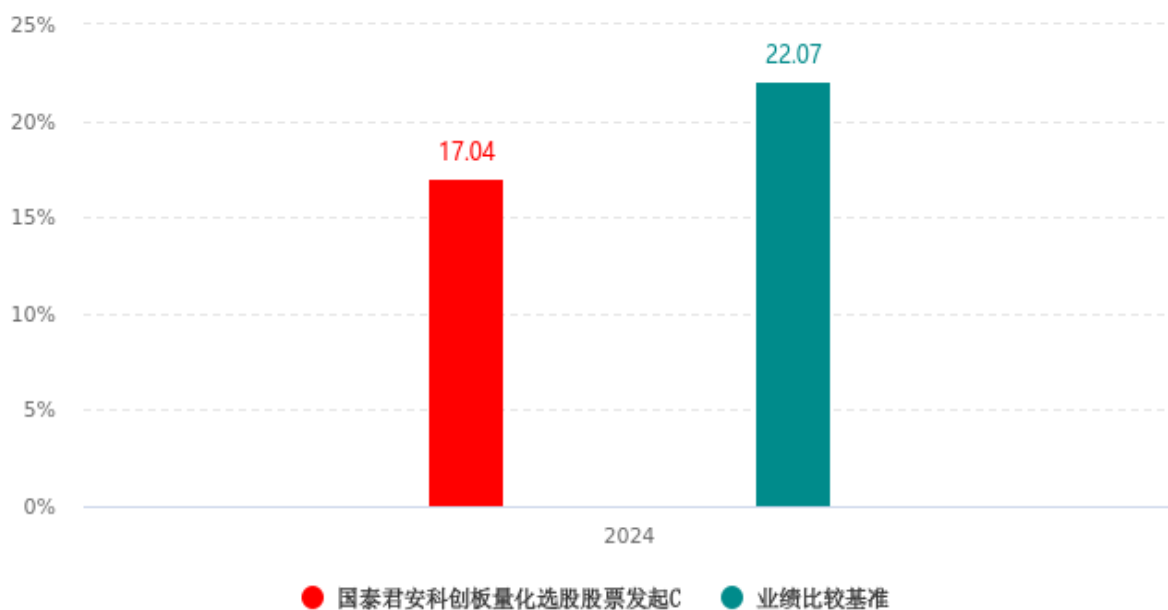
注：1、本基金于 2024 年 04 月 16 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

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

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 2024 年 04 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 2024 年 04 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	2024-04-16	-	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。

本基金聚焦科创板，特别是科创 50 和科创 100 的成分股，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“科技龙头”、“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（科创 50 和科创 100 等）的收益。

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 and 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创板量化选股股票发起 A 基金份额净值为 1.1738 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 17.38%，同期业绩比较基准收益率为 22.07%；截至报告期末国泰君安

科创板量化选股股票发起 C 基金份额净值为 1.1704 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 17.04%，同期业绩比较基准收益率为 22.07%。

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。本报告期内，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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽

责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金 2024 年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 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	毕马威华振审字第 2501285 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	国泰君安科创板量化选股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>我们审计了后附的国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，自 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的利润表、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中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处</p>

	理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间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（以下简称“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，我们独立于该基金，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	<p>该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“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，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，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>

<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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) 评价该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) 对该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，就可能导致对该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该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、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>我们与该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>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>虞京京 李博</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层</p>

审计报告日期	2025-03-26
--------	------------

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰君安科创板量化选股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
资 产：		
货币资金	7.4.7.1	5,598,669.91
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	64,965,705.70
其中：股票投资		64,965,705.70
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产	7.4.7.3	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		60,074.37
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.4	-

资产总计		70,624,449.98
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日
负 债:		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债		—
卖出回购金融资产款		—
应付清算款		—
应付赎回款		132,858.75
应付管理人报酬		785,287.54
应付托管费		130,881.29
应付销售服务费		121,858.93
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	7.4.7.5	120,027.00
负债合计		1,290,913.51
净资产:		
实收基金	7.4.7.6	59,129,393.94
未分配利润	7.4.7.7	10,204,142.53
净资产合计		69,333,536.47
负债和净资产总计		70,624,449.98

注：1、报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 59,129,393.94 份。其中国泰君安科创板

板量化选股股票发起 A 基金份额净值 1.1738 元，基金份额总额 37,437,385.16 份；国泰君安科创板量化选股股票发起 C 基金份额净值 1.1704 元，基金份额总额 21,692,008.78 份。

2、本基金于 2024 年 04 月 16 日成立，本财务报表的实际编制期间为 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止。

7.2 利润表

会计主体：国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		11,836,324.79
1. 利息收入		53,211.22
其中：存款利息收入	7.4.7.8	53,211.22
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）		12,091,563.40
其中：股票投资收益	7.4.7.9	11,369,564.17
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益	7.4.7.10	721,999.23
其他投资收益		-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.11	-620,582.54
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.12	312,132.71
减：二、营业总支出		1,158,427.76
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	785,287.54
2. 托管费	7.4.10.2.2	130,881.29
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	121,858.93
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	7.4.7.13	120,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,677,897.03
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,677,897.03
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		10,677,897.03

注：本基金于 2024 年 04 月 16 日成立，无上年度同期可比数据。

7.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	110,889,351.13	-	110,889,351.13

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-51,759,957.19	10,204,142.53	-41,555,814.66
（一）、综合收益总额	-	10,677,897.03	10,677,897.03
（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）	-51,759,957.19	-473,754.50	-52,233,711.69
其中：1. 基金申购款	71,839,796.63	14,560,047.00	86,399,843.63
2. 基金赎回款	-123,599,753.82	-15,033,801.50	-138,633,555.32
（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	59,129,393.94	10,204,142.53	69,333,536.47

注：本基金于 2024 年 04 月 16 日成立，无上年度同期可比数据。

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

国泰君安科创板量化选股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[2024] 62 号《关于准予国泰君安科创板量化选股股票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《国泰君安科创板量化选股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 110,862,735.13 元，业经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）毕马威华振验字第 2400134 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同》于 2024 年 4 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 110,889,351.13 份基金份额，其中认购资金利息折合 26,616.00 份基金份额。本基金的基金管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,010,801.80 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《国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同》，本基金根据是否收取认购费、申购费、销售服务费，将基金份额分为不同的类别。投资人在认购、申购时收取认购费、申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；投资人在认购、申购时不收取认购费、申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为依法发行上市的股票（含主板、创业板、科创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：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于科创板股票资产的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：上证科创板 50 成份指数收益率*45%+上证科创板 100 指数收益率*45%+中债综合全价（总值）指数收益率*10%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、自 2024 年 4 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自

2024 年 04 月 16 日(基金合同生效日)至 2024 年 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，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、基金投资、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等。

本基金通常根据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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无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。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同

现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

— 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

— 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无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。

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

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

— 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

– 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

– 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

– 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

– 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受

到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

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份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期

损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准：

(1) 各类基金份额之间由于是否收取销售服务费的不同将导致在可供分配利润上有所不同；本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，红利再投资增加的份额计入基金份额总规模，投资人可选择现金红利或将现金红利转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 法律、法规或中国证监会另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，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》，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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值或减值。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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号文《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号文《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号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部、税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

b) 对证券投资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，股权的股息、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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金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。

d) 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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
活期存款	2,385,695.59
等于：本金	2,384,914.11
加：应计利息	781.48
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	3,212,974.32
等于：本金	3,212,861.80
加：应计利息	112.52
减：坏账准备	-
合计	5,598,669.91

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		65,586,288.24	-	64,965,705.70	- 620,582.54
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		65,586,288.24	-	64,965,705.70	- 620,582.54

注：本基金于 2024 年 04 月 16 日成立，无上年度同期可比数据。

7.4.7.3 买入返售金融资产

7.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	27.00
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	90,000.00
预提审计费	30,000.00
合计	120,027.00

7.4.7.6 实收基金

国泰君安科创板量化选股股票发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	50,771,570.63	50,771,570.63
本期申购	52,484,535.11	52,484,535.11
本期赎回（以“-”号填列）	-65,818,720.58	-65,818,720.58
本期末	37,437,385.16	37,437,385.16

国泰君安科创板量化选股股票发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	60,117,780.50	60,117,780.50
本期申购	19,355,261.52	19,355,261.52
本期赎回（以“-”号填列）	-57,781,033.24	-57,781,033.24
本期末	21,692,008.78	21,692,008.78

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.7 未分配利润

国泰君安科创板量化选股股票发起 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	9,926,804.25	-5,688,752.31	4,238,051.94
本期基金份额交易产生的变动数	-3,144,864.21	5,414,608.13	2,269,743.92
其中：基金申购款	-2,232,263.76	13,641,471.82	11,409,208.06
基金赎回款	-912,600.45	-8,226,863.69	-9,139,464.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,781,940.04	-274,144.18	6,507,795.86

国泰君安科创板量化选股股票发起 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,371,675.32	5,068,169.77	6,439,845.09
本期基金份额交易产生的变动数	2,481,077.00	-5,224,575.42	-2,743,498.42
其中：基金申购款	542,409.80	2,608,429.14	3,150,838.94
基金赎回款	1,938,667.20	-7,833,004.56	-5,894,337.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,852,752.32	-156,405.65	3,696,346.67

7.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月
----	---

	31 日
活期存款利息收入	45,512.06
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	7,699.16
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	53,211.22

7.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	808,008,907.81
减：卖出股票成本总额	796,003,811.70
减：交易费用	635,531.94
买卖股票差价收入	11,369,564.17

7.4.7.10 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	721,999.23
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	721,999.23

7.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-620,582.54
——股票投资	-620,582.54
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-

3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-620,582.54

7.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日） 至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	312,132.71
合计	312,132.71

7.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日） 至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00
信息披露费	90,000.00
证券出借违约金	-
证券账户开户费	400.00
合计	120,400.00

7.4.7.14 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

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
中国光大银行股份有限公司(以下简称“光大银行”)	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 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券	1,669,599,007.75	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期末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

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

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 04 月 16 日（基金合同生效日）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	124,445.63	100.00%	-	-

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 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	785,287.54
其中：应支付销售机构的客户维护费	329,184.95
应支付基金管理人的净管理费	456,102.59

注：支付基金管理人国泰君安资管的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%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：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X1.20%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	130,881.29

注：支付基金托管人光大银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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：日托管费=前一日基金资产净值 X0.20%/当年天数。

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 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
----------------	--

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安科创板量化选股股票发起 A	国泰君安科创板量化选股股票发起 C	合计
国泰君安资管	-	16,542.31	16,542.31
国泰君安证券	-	99,973.68	99,973.68
合计	-	116,515.99	116,515.99

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国泰君安资管，再由国泰君安资管计算并支付给各基金销售机构。

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 X0.40%/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

本基金本报告期末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

国泰君安科创板量化选股股票发起 A

份额单位：份

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日） 至 2024 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2024 年 04 月 16 日）持有的基金份额	5,009,901.80
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	5,009,901.80
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.38%

国泰君安科创板量化选股股票发起 C

份额单位：份

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日） 至 2024 年 12 月 31 日
----	--

基金合同生效日（2024 年 04 月 16 日）持有的基金份额	5,000,900.00
报告期初持有的基金份额	—
报告期间申购/买入总份额	—
报告期间因拆分变动份额	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—
报告期末持有的基金份额	5,000,900.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	23.05%

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

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 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
光大银行	2,385,695.59	45,512.06
国泰君安证券	3,212,974.32	7,699.16

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国光大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

本基金本报告期末未进行利润分配。

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光大银行股份有限公司，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。

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。

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	5,598,669.91	-	-	-	5,598,669.91
交易性金融资产	-	-	-	64,965,705.70	64,965,705.70
应收申购款	-	-	-	60,074.37	60,074.37
资产总计	5,598,669.91	-	-	65,025,780.07	70,624,449.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	132,858.75	132,858.75
应付管理人报酬	-	-	-	785,287.54	785,287.54
应付托管费	-	-	-	130,881.29	130,881.29
应付销售服务费	-	-	-	121,858.93	121,858.93
其他负债	-	-	-	120,027.00	120,027.00
负债总计	-	-	-	1,290,913.51	1,290,913.51
利率敏感度缺口	5,598,669.91	-	-	63,734,866.56	69,333,536.47

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%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	64,965,705.70	93.70
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	64,965,705.70	93.70

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2024 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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
第一层次	64,965,705.70
第二层次	-
第三层次	-
合计	64,965,705.70

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	64,965,705.70	91.99
	其中：股票	64,965,705.70	91.99
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	5,598,669.91	7.93
8	其他各项资产	60,074.37	0.09
9	合计	70,624,449.98	100.00

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	—	—
C	制造业	51,700,342.73	74.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,845.00	0.05
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	523,027.00	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,279,937.59	14.83
J	金融业	68,900.00	0.10
K	房地产业	43,542.00	0.06
L	租赁和商务服务业	131,509.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	1,621,851.38	2.34
N	水利、环境和公共设施管理业	34,941.00	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	526,810.00	0.76
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	64,965,705.70	93.70

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	39,012	3,691,315.44	5.32
2	688041	海光信息	18,431	2,760,779.49	3.98
3	688256	寒武纪	3,600	2,368,800.00	3.42
4	688008	澜起科技	28,396	1,928,088.40	2.78
5	688012	中微公司	8,520	1,611,643.20	2.32
6	688111	金山办公	4,619	1,322,835.41	1.91
7	688120	华海清科	6,956	1,133,758.44	1.64
8	688469	芯联集成	205,800	1,055,754.00	1.52
9	688223	晶科能源	138,091	981,827.01	1.42
10	688099	晶晨股份	14,264	979,651.52	1.41
11	688180	君实生物	35,000	956,550.00	1.38
12	688347	华虹公司	20,072	932,745.84	1.35
13	688772	珠海冠宇	55,331	889,722.48	1.28
14	688396	华润微	16,813	793,405.47	1.14
15	688029	南微医学	11,682	789,586.38	1.14
16	688798	艾为电子	11,124	776,677.68	1.12
17	688009	中国通号	121,002	757,472.52	1.09
18	688472	阿特斯	59,464	746,867.84	1.08
19	688019	安集科技	5,237	729,828.32	1.05

20	688110	东芯股份	28,800	717,120.00	1.03
21	688126	沪硅产业	36,781	692,218.42	1.00
22	688348	昱能科技	14,160	691,008.00	1.00
23	688161	威高骨科	27,079	682,932.38	0.98
24	688107	安路科技	22,953	678,949.74	0.98
25	688425	铁建重工	147,900	650,760.00	0.94
26	688122	西部超导	14,306	612,582.92	0.88
27	688409	富创精密	11,300	582,741.00	0.84
28	688088	虹软科技	14,718	567,526.08	0.82
29	688538	和辉光电	229,445	532,312.40	0.77
30	688158	优刻得	36,972	516,868.56	0.75
31	688588	凌志软件	36,900	509,220.00	0.73
32	688249	晶合集成	21,600	504,144.00	0.73
33	688128	中国电研	23,326	490,079.26	0.71
34	688508	芯朋微	11,354	487,881.38	0.70
35	688209	英集芯	27,036	477,726.12	0.69
36	688568	中科星图	9,200	469,476.00	0.68
37	688187	时代电气	9,700	464,824.00	0.67
38	688065	凯赛生物	11,837	459,275.60	0.66
39	688055	龙腾光电	108,600	448,518.00	0.65
40	300433	蓝思科技	19,900	435,810.00	0.63
41	301370	国科恒泰	40,200	434,160.00	0.63
42	688553	汇宇制药	27,926	424,475.20	0.61
43	688271	联影医疗	3,349	423,313.60	0.61
44	688599	天合光能	21,500	414,950.00	0.60
45	688208	道通科技	10,302	403,426.32	0.58
46	688591	泰凌微	12,694	398,591.60	0.57
47	300398	飞凯材料	24,800	390,848.00	0.56
48	688063	派能科技	9,700	388,485.00	0.56
49	301221	光庭信息	7,900	383,782.00	0.55
50	688005	容百科技	12,014	379,041.70	0.55
51	300306	远方信息	31,500	365,400.00	0.53
52	688213	思特威	4,700	365,284.00	0.53
53	688509	正元地信	89,200	354,124.00	0.51
54	688312	燕麦科技	11,451	352,690.80	0.51
55	688070	纵横股份	9,960	351,588.00	0.51
56	688578	艾力斯	5,800	347,420.00	0.50
57	688385	复旦微电	8,900	341,671.00	0.49
58	688015	交控科技	17,161	340,302.63	0.49
59	300079	数码视讯	62,700	339,207.00	0.49
60	688389	普门科技	22,500	335,025.00	0.48
61	688506	百利天恒	1,700	325,941.00	0.47
62	688083	中望软件	3,800	325,166.00	0.47

63	688017	绿的谐波	3,000	324,180.00	0.47
64	300400	劲拓股份	19,600	317,912.00	0.46
65	300648	星云股份	13,700	315,100.00	0.45
66	688432	有研硅	27,600	311,880.00	0.45
67	688105	诺唯赞	14,034	311,133.78	0.45
68	002396	星网锐捷	15,800	300,042.00	0.43
69	688372	伟测科技	5,100	298,452.00	0.43
70	688516	奥特维	6,743	292,039.33	0.42
71	300015	爱尔眼科	20,400	270,300.00	0.39
72	300434	金石亚药	31,500	259,875.00	0.37
73	688543	国科军工	5,144	257,817.28	0.37
74	300244	迪安诊断	22,600	256,510.00	0.37
75	688036	传音控股	2,700	256,500.00	0.37
76	688200	华峰测控	2,400	250,800.00	0.36
77	688652	京仪装备	5,100	250,410.00	0.36
78	600722	金牛化工	51,900	242,892.00	0.35
79	300281	金明精机	43,100	240,929.00	0.35
80	002565	顺灏股份	78,600	238,944.00	0.34
81	688007	光峰科技	15,900	235,161.00	0.34
82	688321	微芯生物	12,643	234,906.94	0.34
83	688579	山大地纬	25,225	231,817.75	0.33
84	688590	新致软件	14,407	230,944.21	0.33
85	300014	亿纬锂能	4,800	224,352.00	0.32
86	603986	兆易创新	2,100	224,280.00	0.32
87	300453	三鑫医疗	29,900	223,054.00	0.32
88	002273	水晶光电	10,000	222,200.00	0.32
89	688079	美迪凯	25,430	220,223.80	0.32
90	300628	亿联网络	5,700	220,020.00	0.32
91	688313	仕佳光子	13,131	215,217.09	0.31
92	300039	上海凯宝	34,400	212,592.00	0.31
93	300200	高盟新材	25,600	211,968.00	0.31
94	301318	维海德	7,100	209,592.00	0.30
95	688363	华熙生物	4,000	204,160.00	0.29
96	688247	宣泰医药	20,050	201,703.00	0.29
97	002548	金新农	50,200	199,294.00	0.29
98	688380	中微半导	6,600	197,340.00	0.28
99	688131	皓元医药	5,524	197,206.80	0.28
100	688362	甬矽电子	5,745	193,491.60	0.28
101	688252	天德钰	7,893	189,037.35	0.27
102	688658	悦康药业	13,015	187,546.15	0.27
103	688248	南网科技	5,836	187,277.24	0.27
104	688408	中信博	2,600	187,200.00	0.27
105	688278	特宝生物	2,525	185,259.25	0.27

106	300978	东箭科技	17,000	185,130.00	0.27
107	688702	盛科通信	2,200	184,800.00	0.27
108	688410	山外山	16,445	183,526.20	0.26
109	688522	纳睿雷达	3,107	175,048.38	0.25
110	300533	冰川网络	8,700	171,912.00	0.25
111	688612	威迈斯	7,300	171,842.00	0.25
112	688337	普源精电	4,200	163,800.00	0.24
113	688550	瑞联新材	5,200	162,708.00	0.23
114	601399	国机重装	52,800	162,624.00	0.23
115	300545	联得装备	5,000	156,650.00	0.23
116	300054	鼎龙股份	6,000	156,120.00	0.23
117	300579	数字认证	4,800	150,816.00	0.22
118	300502	新易盛	1,300	150,254.00	0.22
119	688352	硕中科技	12,100	146,773.00	0.21
120	300215	电科院	24,500	145,285.00	0.21
121	300160	秀强股份	26,500	144,160.00	0.21
122	300445	康斯特	8,700	141,549.00	0.20
123	688141	杰华特	4,570	139,887.70	0.20
124	688789	宏华数科	2,100	139,398.00	0.20
125	600050	中国联通	26,000	138,060.00	0.20
126	300529	健帆生物	4,600	134,964.00	0.19
127	002578	闽发铝业	44,000	131,560.00	0.19
128	688728	格科微	9,500	127,680.00	0.18
129	688183	生益电子	3,238	127,123.88	0.18
130	688322	奥比中光	2,700	125,550.00	0.18
131	300363	博腾股份	7,700	121,429.00	0.18
132	300369	绿盟科技	16,600	119,354.00	0.17
133	300018	中元股份	17,100	115,767.00	0.17
134	688030	山石网科	7,238	112,189.00	0.16
135	688586	江航装备	11,604	111,050.28	0.16
136	688663	新风光	5,100	110,721.00	0.16
137	600267	海正药业	13,300	110,390.00	0.16
138	300477	合纵科技	38,800	110,192.00	0.16
139	000725	京东方 A	24,900	109,311.00	0.16
140	002535	林州重机	28,400	108,772.00	0.16
141	688050	爱博医疗	1,144	104,138.32	0.15
142	300357	我武生物	5,100	103,632.00	0.15
143	688234	天岳先进	2,000	102,400.00	0.15
144	600727	鲁北化工	13,500	100,035.00	0.14
145	300124	汇川技术	1,700	99,586.00	0.14
146	688177	百奥泰	5,100	98,838.00	0.14
147	688233	神工股份	4,189	98,232.05	0.14
148	300241	瑞丰光电	16,600	91,134.00	0.13

149	300032	金龙机电	19,800	89,298.00	0.13
150	688521	芯原股份	1,662	87,138.66	0.13
151	300402	宝色股份	5,900	87,025.00	0.13
152	688428	诺诚健华	7,050	86,574.00	0.12
153	603501	韦尔股份	800	83,528.00	0.12
154	300781	因赛集团	1,400	82,642.00	0.12
155	605299	舒华体育	10,200	80,478.00	0.12
156	002489	浙江永强	23,900	77,436.00	0.11
157	688609	九联科技	7,280	77,168.00	0.11
158	000026	飞亚达	7,400	76,738.00	0.11
159	688082	盛美上海	739	73,900.00	0.11
160	300341	麦克奥迪	4,200	73,542.00	0.11
161	688662	富信科技	2,102	72,140.64	0.10
162	688216	气派科技	3,311	72,113.58	0.10
163	688222	成都先导	5,833	71,862.56	0.10
164	000617	中油资本	10,000	68,900.00	0.10
165	688067	爱威科技	4,000	66,880.00	0.10
166	300988	津荣天宇	3,700	66,748.00	0.10
167	688148	芳源股份	13,200	65,340.00	0.09
168	300424	航新科技	3,600	65,016.00	0.09
169	300812	易天股份	2,900	63,916.00	0.09
170	002916	深南电路	500	62,500.00	0.09
171	688484	南芯科技	1,700	61,268.00	0.09
172	688220	翱捷科技	1,100	59,499.00	0.09
173	601096	宏盛华源	13,100	56,985.00	0.08
174	300968	格林精密	3,300	54,384.00	0.08
175	600812	华北制药	10,500	54,285.00	0.08
176	300729	乐歌股份	3,300	52,404.00	0.08
177	601633	长城汽车	1,900	50,027.00	0.07
178	688419	耐科装备	1,600	49,728.00	0.07
179	300505	川金诺	3,400	48,960.00	0.07
180	688351	微电生理	2,557	48,685.28	0.07
181	300666	江丰电子	700	48,615.00	0.07
182	301121	紫建电子	900	47,754.00	0.07
183	001216	华瓷股份	3,700	47,175.00	0.07
184	688123	聚辰股份	800	46,816.00	0.07
185	688625	呈和科技	1,200	45,816.00	0.07
186	688607	康众医疗	3,400	45,050.00	0.06
187	300004	南风股份	7,300	44,895.00	0.06
188	002920	德赛西威	400	44,044.00	0.06
189	000021	深科技	2,300	43,838.00	0.06
190	300917	特发服务	900	43,542.00	0.06
191	688660	电气风电	4,800	43,200.00	0.06

192	300573	兴齐眼药	600	41,868.00	0.06
193	002204	大连重工	8,300	41,334.00	0.06
194	300193	佳士科技	4,600	40,894.00	0.06
195	688722	同益中	3,169	40,404.75	0.06
196	300250	初灵信息	2,800	39,480.00	0.06
197	002164	宁波东力	7,700	38,577.00	0.06
198	300149	睿智医药	6,000	38,520.00	0.06
199	300531	优博讯	2,700	37,665.00	0.05
200	688228	开普云	800	35,648.00	0.05
201	300289	利德曼	7,200	35,280.00	0.05
202	002549	凯美特气	5,700	34,941.00	0.05
203	300172	中电环保	6,900	34,845.00	0.05
204	688215	瑞晟智能	1,700	34,272.00	0.05
205	600790	轻纺城	9,100	34,125.00	0.05
206	301327	华宝新能	400	30,684.00	0.04
207	002414	高德红外	4,100	30,463.00	0.04
208	300507	苏奥传感	4,400	29,480.00	0.04
209	300315	掌趣科技	5,200	28,600.00	0.04
210	300225	金力泰	4,300	27,778.00	0.04
211	688577	浙海德曼	700	27,426.00	0.04
212	300558	贝达药业	500	26,965.00	0.04
213	300546	雄帝科技	1,600	26,912.00	0.04
214	300661	圣邦股份	300	24,534.00	0.04
215	300151	昌红科技	1,400	23,800.00	0.03
216	600582	天地科技	3,600	22,248.00	0.03
217	688496	清越科技	2,556	21,904.92	0.03
218	688118	普元信息	995	20,924.85	0.03
219	600210	紫江企业	3,100	20,491.00	0.03
220	300567	精测电子	300	19,290.00	0.03
221	300724	捷佳伟创	300	18,963.00	0.03
222	300759	康龙化成	700	17,990.00	0.03
223	688066	航天宏图	826	16,850.40	0.02
224	300381	溢多利	2,400	16,848.00	0.02
225	688697	纽威数控	1,000	16,640.00	0.02
226	300632	光莆股份	1,500	16,635.00	0.02
227	688518	联赢激光	1,042	16,505.28	0.02
228	300722	新余国科	600	16,212.00	0.02
229	688468	科美诊断	2,259	15,474.15	0.02
230	688739	成大生物	599	15,442.22	0.02
231	300662	科锐国际	700	14,742.00	0.02
232	688659	元琛科技	2,100	14,175.00	0.02
233	688371	菲沃泰	844	13,098.88	0.02
234	688052	纳芯微	100	13,030.00	0.02

235	600367	红星发展	1,100	12,694.00	0.02
236	300184	力源信息	1,300	12,129.00	0.02
237	000931	中关村	2,400	11,424.00	0.02
238	688152	麒麟信安	200	10,408.00	0.02
239	688525	佰维存储	133	8,242.01	0.01
240	688169	石头科技	35	7,675.15	0.01
241	688235	百济神州	36	5,796.72	0.01
242	688114	华大智造	114	5,334.06	0.01
243	688503	聚和材料	114	5,049.06	0.01
244	688100	威胜信息	125	4,525.00	0.01
245	688661	和林微纳	104	3,433.04	0.00
246	688147	微导纳米	116	3,119.24	0.00
247	688010	福光股份	31	883.50	0.00
248	688416	恒烁股份	22	858.00	0.00
249	688561	奇安信	28	751.24	0.00
250	300641	正丹股份	30	745.20	0.00
251	688206	概伦电子	28	529.48	0.00
252	688443	智翔金泰	21	526.89	0.00
253	688567	孚能科技	41	475.60	0.00
254	688135	利扬芯片	17	341.19	0.00
255	688295	中复神鹰	14	279.02	0.00
256	688779	五矿新能	48	255.36	0.00
257	688387	信科移动	25	149.00	0.00
258	688565	力源科技	24	138.24	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	688981	中芯国际	14,753,848.64	21.28
2	688041	海光信息	12,973,836.30	18.71
3	688012	中微公司	9,749,621.13	14.06
4	688008	澜起科技	9,483,510.76	13.68
5	688036	传音控股	9,133,647.75	13.17
6	688578	艾力斯	8,898,811.58	12.83
7	688111	金山办公	8,127,904.29	11.72
8	688183	生益电子	7,769,150.94	11.21
9	300750	宁德时代	7,705,773.60	11.11
10	688271	联影医疗	7,155,676.71	10.32
11	688099	晶晨股份	6,918,597.66	9.98
12	688187	时代电气	6,899,644.86	9.95

13	688065	凯赛生物	6,842,842.15	9.87
14	688363	华熙生物	6,737,236.37	9.72
15	688050	爱博医疗	6,558,004.98	9.46
16	688772	珠海冠宇	6,426,935.95	9.27
17	688223	晶科能源	5,973,916.98	8.62
18	688525	佰维存储	5,857,333.94	8.45
19	688472	阿特斯	5,317,108.49	7.67
20	688009	中国通号	5,249,943.70	7.57
21	688120	华海清科	5,201,279.74	7.50
22	688608	恒玄科技	5,168,621.76	7.45
23	688249	晶合集成	5,063,090.40	7.30
24	688208	道通科技	5,017,469.34	7.24
25	688599	天合光能	4,974,505.70	7.17
26	688002	睿创微纳	4,937,437.90	7.12
27	688105	诺唯赞	4,897,604.09	7.06
28	688122	西部超导	4,887,982.61	7.05
29	688128	中国电研	4,788,183.93	6.91
30	688779	五矿新能	4,755,620.37	6.86
31	688019	安集科技	4,707,604.82	6.79
32	688213	思特威	4,690,449.75	6.77
33	688778	厦钨新能	4,576,772.44	6.60
34	688819	天能股份	4,562,565.83	6.58
35	688126	沪硅产业	4,541,864.36	6.55
36	688690	纳微科技	4,417,792.91	6.37
37	688222	成都先导	4,396,863.41	6.34
38	688516	奥特维	4,336,871.63	6.26
39	688389	普门科技	4,312,238.68	6.22
40	688362	甬矽电子	4,192,819.69	6.05
41	688313	仕佳光子	4,183,049.48	6.03
42	688617	惠泰医疗	4,171,050.20	6.02
43	688123	聚辰股份	4,130,272.52	5.96
44	688351	微电生理	4,009,353.90	5.78
45	688005	容百科技	3,962,243.77	5.71
46	688169	石头科技	3,922,068.85	5.66
47	688139	海尔生物	3,921,809.02	5.66
48	688425	铁建重工	3,871,854.57	5.58
49	688148	芳源股份	3,857,629.23	5.56
50	688017	绿的谐波	3,849,242.88	5.55
51	688348	昱能科技	3,824,715.47	5.52
52	688728	格科微	3,817,091.77	5.51
53	688007	光峰科技	3,797,530.53	5.48
54	688029	南微医学	3,737,670.21	5.39
55	688248	南网科技	3,709,556.02	5.35

56	688252	天德钰	3,641,524.60	5.25
57	600276	恒瑞医药	3,624,040.00	5.23
58	688798	艾为电子	3,579,409.54	5.16
59	688088	虹软科技	3,476,764.55	5.01
60	688408	中信博	3,448,774.98	4.97
61	688484	南芯科技	3,439,954.58	4.96
62	688586	江航装备	3,436,504.31	4.96
63	688076	诺泰生物	3,436,261.67	4.96
64	688107	安路科技	3,412,159.94	4.92
65	688409	富创精密	3,340,615.59	4.82
66	000725	京东方 A	3,299,272.00	4.76
67	688188	柏楚电子	3,296,480.51	4.75
68	688658	悦康药业	3,295,528.86	4.75
69	688289	圣湘生物	3,247,983.28	4.68
70	688336	三生国健	3,229,786.65	4.66
71	601633	长城汽车	3,209,126.00	4.63
72	688082	盛美上海	3,194,283.13	4.61
73	688371	菲沃泰	3,191,830.52	4.60
74	688306	均普智能	3,163,155.77	4.56
75	688521	芯原股份	3,131,046.08	4.52
76	688590	新致软件	3,078,252.97	4.44
77	688321	微芯生物	3,060,251.42	4.41
78	688166	博瑞医药	3,010,973.75	4.34
79	688380	中微半导	3,010,969.34	4.34
80	688055	龙腾光电	3,010,404.17	4.34
81	688161	威高骨科	2,968,848.30	4.28
82	688195	腾景科技	2,964,838.29	4.28
83	688150	莱特光电	2,912,622.17	4.20
84	688209	英集芯	2,864,140.56	4.13
85	688141	杰华特	2,831,045.62	4.08
86	601766	中国中车	2,829,977.00	4.08
87	688146	中船特气	2,781,146.89	4.01
88	688561	奇安信	2,711,098.50	3.91
89	600050	中国联通	2,672,057.00	3.85
90	688116	天奈科技	2,661,738.51	3.84
91	688400	凌云光	2,659,081.05	3.84
92	688579	山大地纬	2,595,352.52	3.74
93	688278	特宝生物	2,590,286.66	3.74
94	688543	国科军工	2,576,451.25	3.72
95	688776	国光电气	2,569,180.05	3.71
96	600267	海正药业	2,567,431.00	3.70
97	688385	复旦微电	2,546,038.53	3.67
98	688549	中巨芯	2,527,829.72	3.65

99	688378	奥来德	2,520,034.58	3.63
100	688253	英诺特	2,501,353.67	3.61
101	688508	芯朋微	2,493,495.54	3.60
102	688396	华润微	2,481,862.81	3.58
103	002001	新和成	2,450,474.00	3.53
104	600500	中化国际	2,412,487.00	3.48
105	688256	寒武纪	2,391,885.14	3.45
106	688016	心脉医疗	2,312,144.60	3.33
107	688131	皓元医药	2,290,214.32	3.30
108	601600	中国铝业	2,263,610.00	3.26
109	688352	硕中科技	2,231,927.69	3.22
110	688018	乐鑫科技	2,223,294.49	3.21
111	688789	宏华数科	2,211,658.22	3.19
112	002340	格林美	2,199,747.00	3.17
113	688147	微导纳米	2,176,826.38	3.14
114	688575	亚辉龙	2,169,118.76	3.13
115	603501	韦尔股份	2,169,114.00	3.13
116	688366	昊海生科	2,142,406.13	3.09
117	688510	航亚科技	2,140,754.39	3.09
118	688066	航天宏图	2,135,777.10	3.08
119	688739	成大生物	2,133,237.34	3.08
120	002241	歌尔股份	2,127,544.00	3.07
121	688777	中控技术	2,110,983.11	3.04
122	688568	中科星图	2,104,276.88	3.04
123	688097	博众精工	2,092,662.31	3.02
124	688588	凌志软件	2,085,083.93	3.01
125	688347	华虹公司	2,058,765.78	2.97
126	688239	航宇科技	2,049,292.84	2.96
127	688612	威迈斯	2,016,167.03	2.91
128	688553	汇宇制药	1,993,934.26	2.88
129	688247	宣泰医药	1,978,364.45	2.85
130	688219	会通股份	1,969,386.43	2.84
131	688102	斯瑞新材	1,949,550.32	2.81
132	688049	炬芯科技	1,946,529.11	2.81
133	600183	生益科技	1,932,481.00	2.79
134	688591	泰凌微	1,911,230.60	2.76
135	688372	伟测科技	1,898,287.19	2.74
136	688233	神工股份	1,888,859.59	2.72
137	300408	三环集团	1,888,037.00	2.72
138	688699	明微电子	1,873,799.87	2.70
139	688787	海天瑞声	1,832,695.84	2.64
140	688315	诺禾致源	1,827,711.93	2.64
141	688609	九联科技	1,826,867.34	2.63

142	688563	航材股份	1,805,509.35	2.60
143	688550	瑞联新材	1,784,658.00	2.57
144	688475	萤石网络	1,783,621.35	2.57
145	002414	高德红外	1,772,757.80	2.56
146	000963	华东医药	1,755,293.00	2.53
147	688281	华秦科技	1,734,798.62	2.50
148	688235	百济神州	1,734,486.53	2.50
149	300498	温氏股份	1,706,155.00	2.46
150	688601	力芯微	1,704,246.69	2.46
151	600812	华北制药	1,688,123.00	2.43
152	002455	百川股份	1,627,797.00	2.35
153	688566	吉贝尔	1,625,177.90	2.34
154	002468	申通快递	1,610,286.00	2.32
155	688766	普冉股份	1,607,531.46	2.32
156	300529	健帆生物	1,598,986.00	2.31
157	603676	卫信康	1,554,055.00	2.24
158	002292	奥飞娱乐	1,549,454.00	2.23
159	688106	金宏气体	1,533,264.88	2.21
160	688001	华兴源创	1,530,464.28	2.21
161	688506	百利天恒	1,510,102.30	2.18
162	300760	迈瑞医疗	1,506,890.00	2.17
163	688153	唯捷创芯	1,506,223.82	2.17
164	688083	中望软件	1,502,852.23	2.17
165	688582	芯动联科	1,498,900.12	2.16
166	688035	德邦科技	1,489,375.46	2.15
167	688685	迈信林	1,483,775.55	2.14
168	688127	蓝特光学	1,482,903.45	2.14
169	688383	新益昌	1,482,697.28	2.14
170	688439	振华风光	1,471,448.83	2.12
171	688468	科美诊断	1,462,298.66	2.11
172	601728	中国电信	1,461,956.00	2.11
173	300641	正丹股份	1,461,917.00	2.11
174	300735	光弘科技	1,455,484.00	2.10
175	688063	派能科技	1,445,515.22	2.08
176	688800	瑞可达	1,435,268.66	2.07
177	688079	美迪凯	1,429,951.74	2.06
178	688114	华大智造	1,423,496.18	2.05
179	688138	清溢光电	1,416,909.54	2.04
180	688180	君实生物	1,414,783.76	2.04
181	002180	纳思达	1,410,598.00	2.03
182	600332	白云山	1,402,910.00	2.02
183	300648	星云股份	1,392,855.00	2.01

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	688981	中芯国际	13,567,072.36	19.57
2	688041	海光信息	13,135,807.22	18.95
3	688036	传音控股	8,916,824.63	12.86
4	688008	澜起科技	8,764,027.08	12.64
5	688578	艾力斯	8,656,754.27	12.49
6	688012	中微公司	8,654,397.58	12.48
7	688183	生益电子	8,163,746.84	11.77
8	300750	宁德时代	7,979,752.00	11.51
9	688050	爱博医疗	6,865,218.35	9.90
10	688271	联影医疗	6,685,296.91	9.64
11	688187	时代电气	6,620,573.14	9.55
12	688111	金山办公	6,563,040.83	9.47
13	688363	华熙生物	6,343,247.28	9.15
14	688525	佰维存储	6,204,899.20	8.95
15	688065	凯赛生物	6,186,682.04	8.92
16	688099	晶晨股份	6,159,287.50	8.88
17	688772	珠海冠宇	5,804,927.26	8.37
18	688608	恒玄科技	5,258,527.90	7.58
19	688223	晶科能源	4,851,544.97	7.00
20	688002	睿创微纳	4,751,791.13	6.85
21	688213	思特威	4,739,955.32	6.84
22	688122	西部超导	4,729,411.71	6.82
23	688208	道通科技	4,661,344.74	6.72
24	688249	晶合集成	4,613,638.78	6.65
25	688472	阿特斯	4,549,083.52	6.56
26	688009	中国通号	4,545,344.07	6.56
27	688778	厦钨新能	4,504,082.85	6.50
28	688779	五矿新能	4,454,145.79	6.42
29	688105	诺唯赞	4,448,217.54	6.42
30	688362	甬矽电子	4,448,123.72	6.42
31	688690	纳微科技	4,406,392.24	6.36
32	688819	天能股份	4,373,870.47	6.31
33	688599	天合光能	4,358,875.25	6.29
34	688128	中国电研	4,337,769.51	6.26
35	688617	惠泰医疗	4,298,320.27	6.20
36	688313	仕佳光子	4,132,391.04	5.96
37	688126	沪硅产业	4,107,970.64	5.92
38	688123	聚辰股份	4,098,680.23	5.91

39	688222	成都先导	4,086,344.09	5.89
40	688120	华海清科	3,976,803.92	5.74
41	688351	微电生理	3,943,733.91	5.69
42	688019	安集科技	3,905,745.36	5.63
43	688389	普门科技	3,905,025.75	5.63
44	688005	容百科技	3,877,917.10	5.59
45	688139	海尔生物	3,826,187.37	5.52
46	688248	南网科技	3,785,972.83	5.46
47	688516	奥特维	3,757,404.01	5.42
48	688148	芳源股份	3,736,015.35	5.39
49	688728	格科微	3,672,187.29	5.30
50	688252	天德钰	3,642,120.35	5.25
51	600276	恒瑞医药	3,578,530.00	5.16
52	688521	芯原股份	3,537,818.77	5.10
53	688169	石头科技	3,443,847.62	4.97
54	688017	绿的谐波	3,395,644.60	4.90
55	688007	光峰科技	3,384,442.74	4.88
56	688484	南芯科技	3,380,802.38	4.88
57	688371	菲沃泰	3,337,045.76	4.81
58	688348	昱能科技	3,327,468.18	4.80
59	688289	圣湘生物	3,323,492.35	4.79
60	688306	均普智能	3,299,119.90	4.76
61	688408	中信博	3,298,257.14	4.76
62	688076	诺泰生物	3,228,983.79	4.66
63	688425	铁建重工	3,223,044.94	4.65
64	601633	长城汽车	3,211,555.00	4.63
65	688586	江航装备	3,188,108.92	4.60
66	688400	凌云光	3,174,024.84	4.58
67	688166	博瑞医药	3,167,665.79	4.57
68	688082	盛美上海	3,155,019.19	4.55
69	688141	杰华特	3,146,659.48	4.54
70	688658	悦康药业	3,130,580.82	4.52
71	000725	京东方 A	3,087,081.00	4.45
72	688798	艾为电子	3,077,461.64	4.44
73	688336	三生国健	3,031,201.20	4.37
74	688590	新致软件	3,022,197.22	4.36
75	688195	腾景科技	3,003,508.50	4.33
76	688188	柏楚电子	2,997,250.36	4.32
77	688146	中船特气	2,973,684.72	4.29
78	688088	虹软科技	2,924,683.71	4.22
79	688150	莱特光电	2,884,479.49	4.16
80	601766	中国中车	2,852,556.00	4.11
81	688055	龙腾光电	2,829,839.32	4.08

82	688380	中微半导	2,818,496.23	4.07
83	688029	南微医学	2,721,230.34	3.92
84	688549	中巨芯	2,711,614.24	3.91
85	688321	微芯生物	2,690,256.32	3.88
86	688107	安路科技	2,672,773.39	3.85
87	688209	英集芯	2,659,578.65	3.84
88	002001	新和成	2,627,855.00	3.79
89	688409	富创精密	2,617,266.68	3.77
90	688561	奇安信	2,610,356.18	3.76
91	688253	英诺特	2,565,945.67	3.70
92	688116	天奈科技	2,498,614.46	3.60
93	600050	中国联通	2,478,340.00	3.57
94	688776	国光电气	2,478,173.71	3.57
95	688016	心脉医疗	2,451,618.67	3.54
96	688385	复旦微电	2,441,284.31	3.52
97	600267	海正药业	2,425,166.00	3.50
98	688378	奥来德	2,418,421.27	3.49
99	688161	威高骨科	2,408,829.04	3.47
100	600500	中化国际	2,405,397.00	3.47
101	002241	歌尔股份	2,394,523.00	3.45
102	688131	皓元医药	2,354,455.09	3.40
103	688543	国科军工	2,326,411.51	3.36
104	688278	特宝生物	2,326,022.80	3.35
105	688579	山大地纬	2,320,976.82	3.35
106	688097	博众精工	2,264,881.71	3.27
107	688147	微导纳米	2,229,339.54	3.22
108	688018	乐鑫科技	2,222,787.93	3.21
109	688739	成大生物	2,217,250.03	3.20
110	688777	中控技术	2,210,608.45	3.19
111	601600	中国铝业	2,161,676.00	3.12
112	688366	昊海生科	2,158,549.34	3.11
113	688575	亚辉龙	2,157,716.94	3.11
114	688066	航天宏图	2,150,395.56	3.10
115	688510	航亚科技	2,141,679.24	3.09
116	002340	格林美	2,063,218.00	2.98
117	688789	宏华数科	2,061,851.51	2.97
118	688508	芯朋微	2,037,541.18	2.94
119	603501	韦尔股份	2,033,086.00	2.93
120	688102	斯瑞新材	2,025,028.35	2.92
121	688239	航宇科技	1,993,240.98	2.87
122	688352	颀中科技	1,986,465.44	2.87
123	688588	凌志软件	1,982,349.18	2.86
124	600183	生益科技	1,967,468.00	2.84

125	688247	宣泰医药	1,948,496.41	2.81
126	688049	炬芯科技	1,934,632.09	2.79
127	688219	会通股份	1,907,934.27	2.75
128	300408	三环集团	1,905,992.00	2.75
129	688699	明微电子	1,865,088.65	2.69
130	688315	诺禾致源	1,810,730.12	2.61
131	688568	中科星图	1,795,518.43	2.59
132	688787	海天瑞声	1,792,472.37	2.59
133	688612	威迈斯	1,774,677.82	2.56
134	000963	华东医药	1,771,799.00	2.56
135	688591	泰凌微	1,744,128.42	2.52
136	688475	萤石网络	1,742,123.53	2.51
137	688601	力芯微	1,729,024.79	2.49
138	688609	九联科技	1,724,987.45	2.49
139	688563	航材股份	1,718,005.09	2.48
140	002414	高德红外	1,692,415.00	2.44
141	688233	神工股份	1,679,045.41	2.42
142	002455	百川股份	1,664,765.00	2.40
143	688235	百济神州	1,642,984.39	2.37
144	688001	华兴源创	1,639,902.63	2.37
145	600812	华北制药	1,637,258.00	2.36
146	688281	华秦科技	1,635,987.04	2.36
147	688396	华润微	1,631,729.48	2.35
148	688550	瑞联新材	1,610,049.58	2.32
149	300498	温氏股份	1,609,636.26	2.32
150	688553	汇宇制药	1,567,750.91	2.26
151	688372	伟测科技	1,566,867.37	2.26
152	603676	卫信康	1,552,832.00	2.24
153	002468	申通快递	1,543,212.00	2.23
154	688582	芯动联科	1,534,861.94	2.21
155	688685	迈信林	1,530,920.59	2.21
156	688010	福光股份	1,527,696.36	2.20
157	688106	金宏气体	1,513,236.39	2.18
158	601728	中国电信	1,510,267.00	2.18
159	300641	正丹股份	1,509,832.10	2.18
160	688800	瑞可达	1,504,987.60	2.17
161	300760	迈瑞医疗	1,502,012.00	2.17
162	688127	蓝特光学	1,499,259.22	2.16
163	002180	纳思达	1,489,802.00	2.15
164	688035	德邦科技	1,486,420.19	2.14
165	688566	吉贝尔	1,485,674.63	2.14
166	002292	奥飞娱乐	1,481,267.00	2.14
167	002410	广联达	1,479,786.00	2.13

168	600789	鲁抗医药	1,476,539.00	2.13
169	688468	科美诊断	1,470,775.76	2.12
170	688114	华大智造	1,458,593.91	2.10
171	300735	光弘科技	1,454,925.00	2.10
172	688153	唯捷创芯	1,424,688.89	2.05
173	300529	健帆生物	1,419,843.00	2.05
174	688138	清溢光电	1,416,696.08	2.04
175	688439	振华风光	1,393,910.86	2.01
176	688766	普冉股份	1,388,846.08	2.00

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。

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	861,590,099.94
卖出股票收入（成交）总额	808,008,907.81

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。

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

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	60,074.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	60,074.37

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
国泰君安科创板量化 选股股票发起 A	312	119,991.62	10,564,974.33	28.22%	26,872,410.83	71.78%
国泰君安科创板量化 选股股票发起 C	643	33,735.63	7,218,688.91	33.28%	14,473,319.87	66.72%
合计	955	61,915.60	17,783,663.24	30.08%	41,345,730.70	69.92%

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	国泰君安科创板量化 选股股票发起 A	393,816.19	1.0519%
	国泰君安科创板量化 选股股票发起 C	58,527.50	0.2698%
	合计	452,343.69	0.7650%

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	国泰君安科创板量化选股股票发起 A	10~50
	国泰君安科创板量化选股股票发起 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安科创板量化选股股票发起 A	0
	国泰君安科创板量化选股股票发起 C	0
	合计	0

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	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,010,801.80	16.93%	10,010,801.80	16.93%	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	166,823.01	0.28%	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	285,520.68	0.48%	—	—	—
合计	10,463,145.49	17.69%	10,010,801.80	16.93%	—

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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安科创板量化选股股票发起 A	国泰君安科创板量化选股股票发起 C
基金合同生效日（2024 年 04 月 16 日）基金份额总额	50,771,570.63	60,117,780.50
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	52,484,535.11	19,355,261.52
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	65,818,720.58	57,781,033.24
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	37,437,385.16	21,692,008.78

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的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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没有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 30,000.00 元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为自合同生效日至今。

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	1,669,599,007.75	100.00%	124,445.63	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	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金托管协议	证监会指定网站、公司官网	2024-03-27

2	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同	证监会指定网站、公司官网	2024-03-27
3	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2024-03-27
4	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2024-03-27
5	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金招募说明书	证监会指定网站、公司官网	2024-03-27
6	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	上海证券报	2024-03-27
7	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金份额发售公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2024-03-27
8	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2024-04-17
9	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2024-06-28
10	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2024-06-28
11	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回和定期定额投资业务的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2024-07-15
12	国泰君安科创板量化选股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	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金 2024 年中期报告	证监会指定网站、公司官网	2024-08-30
16	上海国泰君安证券资产管理有限公司	上海证券报、中国证券报、证	2024-08-30

	限公司旗下基金 2024 年中期报告提示性公告	券时报、证券日报	
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	国泰君安科创板量化选股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
22	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

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。

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创板量化选股股票型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安科创板量化选股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