

# 国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金

## 2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人:上海国泰海通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 08 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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08月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年01月01日起至2025年06月30日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录 .....	1
1.1 重要提示 .....	1
1.2 目录 .....	2
§ 2 基金简介 .....	6
2.1 基金基本情况 .....	6
2.2 基金产品说明 .....	6
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	7
2.5 其他相关资料 .....	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现 .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	8
§ 4 管理人报告 .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
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 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	14

<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表 .....	15
6.2 利润表 .....	17
6.3 净资产变动表 .....	19
6.4 报表附注 .....	20
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注 .....	48

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	50
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件.....	52
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>54</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>54</b>
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55



## § 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	上海国泰海通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	50,408,910.57 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	23,313,838.18 份	27,095,072.39 份

注：2025 年 7 月 25 日，上海国泰君安证券资产管理有限公司变更名称为上海国泰海通证券资产管理有限公司。

### 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		上海国泰海通证券资产管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
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@ght.com	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		95521	95595
传真		021-38871190	010-63639132
注册地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层	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		上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		200011	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ghtzg.com
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上海国泰海通证券资产管理有限公司	上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 01 月 01 日-2025 年 06 月 30 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	2,182,119.09	1,957,116.28
本期利润	4,616,514.95	2,410,600.03
加权平均基金份额本期利润	0.1739	0.0784
本期加权平均净值利润率	14.08%	6.31%

本期基金份额净值增长率	12.14%	11.92%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	6,014,932.33	6,822,085.84
期末可供分配基金份额利润	0.2580	0.2518
期末基金资产净值	30,688,374.37	35,492,298.61
期末基金份额净值	1.3163	1.3099
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	31.63%	30.99%

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
过去一个月	6.79%	1.08%	4.39%	0.91%	2.40%	0.17%
过去三个月	4.79%	2.06%	0.56%	1.66%	4.23%	0.40%
过去六个月	12.14%	1.88%	6.87%	1.62%	5.27%	0.26%
过去一年	39.39%	2.36%	36.87%	2.31%	2.52%	0.05%
自基金合同生效起至今	31.63%	2.18%	30.46%	2.18%	1.17%	0.00%

##### 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
过去一个月	6.76%	1.08%	4.39%	0.91%	2.37%	0.17%
过去三个月	4.68%	2.06%	0.56%	1.66%	4.12%	0.40%
过去六个月	11.92%	1.88%	6.87%	1.62%	5.05%	0.26%
过去一年	38.83%	2.36%	36.87%	2.31%	1.96%	0.05%
自基金合同生效起至今	30.99%	2.18%	30.46%	2.18%	0.53%	0.00%

### 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



注：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。



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

## § 4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海国泰海通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，注册地址上海。

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理国泰君安现金管家货币市场基金、国泰君安 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、国泰君安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金、国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金、国泰君安君得明混合型证券投资基金、国泰君安东久新经济产业园封闭式基础设施证券投资基金、国泰君安君得利短债债券型证券投资基金、国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)、国泰君安 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安安弘六个月定期开放债券型证券投资基金、国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金等 61 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，国泰君安平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 指数增强基金经理，国泰君安	2024-04-16	-	14 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。现任本公司量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。

上证科创板综合价格指数增强基金经理。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。本报告期内，本基金无重大违法违规行为及违反基金合同、招募说明书约定的行为，无侵害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1 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

在市场方面，2025 年上半年 A 股市场呈现“政策驱动、情绪修复”主导的结构性行情。春节前市场情绪相对低迷，受特朗普关税政策预期及海外流动性收紧冲击，北向资金持续流出，指数超预期调整并伴随成交量萎靡。节后受 DeepSeek-v3、R1 发布影响，叠加春晚催化人形机器人主题投

资热潮，及“春季躁动”行情，科技板块领涨，推动市场情绪快速修复，并带动 H 股科技板块的资产重估，形成了 A、H 股联动上涨的格局。短期的科创过热致使 3 月后获利盘持续了结，市场再次下跌，进入缩量轮动阶段。4 月初，受美国“对等关税”政策冲击，全球资本市场动荡加剧，上证综指在 4 月 7 日单日大幅下挫 7.34%，市场风险偏好骤降。随后国内政策快速响应，人民日报发文强调增强应对关税冲击信心，中央汇金通过 ETF 市场维稳，叠加 4 月 18 日国务院常务会释放稳定股市信号，市场情绪逐步修复，指数开启估值驱动的快速反弹。进入 5 月，中美经贸高层会谈取得实质性进展，双方发布《日内瓦经贸会谈联合声明》暂停部分关税，叠加央行推出十项货币政策措施，市场风险偏好显著提升，上证综指单月上涨 2.09%。6 月 13 日，中东冲突引发全球资本市场普遍回调，投资者避险情绪提升，但随后中东协议停火，叠加制造业 PMI 回升及消费刺激政策等多重利好推动下，上证综指迎来快速修复，6 月末站上 3400 点创年内新高，上半年累计上涨 2.76%。上半年，科创 100 指数（涨幅 13.54%）和中证 1000 指数（涨幅 6.69%）表现出色，科创 50 指数（涨幅 1.46%）和创业板指（涨幅 0.53%）表现尚可，整体强于中证红利指数（跌幅 3.07%）和沪深 300 指数（涨幅 0.03%）。

从主要风险因子的走势来看，成长因子上半年表现强势。市值因子自年初以来持续走弱，但在 3 月底 4 月初出现小幅走高，随后持续走弱。从行业来看，各行业涨跌幅分化较大。有色金属是 2024 年四季度跌幅居前的行业，2025 年上半年在大宗商品、贵金属价格上涨的推动下重新走强。国防军工和银行板块上半年涨幅均超 10%；军工板块受政策、事件以及景气上行等因素影响表现强势，银行在政策呵护息差、高稳定属性的加持下取得了较好的涨幅。相较而言，受关税冲击或需求疲软影响，食品饮料板块在上半年则表现疲软；煤炭板块则因煤炭价格不断下跌，上半年跌幅达 12%。Alpha 表现方面，2025 上半年价量因子表现强势，整体上价量因子的表现优于基本面因子。过去一段时间内，受“对等关税”等政治事件影响，市场风险偏好急剧变化，维持超额收益稳定性的难度大幅提升，在短期内出现了较大波动。鉴于今年市场环境的复杂性，我们从中吸取经验，更加重视提升业绩稳定性，并根据市场的演化过程不断引入新的因子和改良原有的模型，并强化选股模型对不同风格的适应能力，在保持稳中求胜的风格下追求更好的超额收益率。

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战略新兴产业。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、中证科创新能和创业板指数等的行业分布，在半导体设备、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。从去年 924 行情以来，以科创板为主的科技板块的行情整体表现上乘，科技作为成长风格的典型代表，也带领着市场从过去两年多的价值行情迅速转向成长，虽然以科创板为主的科技相关指数从阶段性底部以来已经积累了较大涨幅，但是从中长期的角度依然具有较高的配置价值，原因有如下几点：1)、当前市场交投整体较为活跃，

为成长股的投资奠定了良好的资金面基础；2)、半导体设备、生物医药、新能源、高端装备等新兴产业，符合中国产业战略转型的方向，在“新质生产力”等产业红利和“科创板八条”等政策红利的双轮驱动下，硬科技属性持续强化，半导体设备、AI 算力、生物制造等领域的技术突破加速，为科技板块打开长期增长空间；3)、在中美科技博弈背景下，科技产业在自主可控的时代使命下发展壮大，俨然成为国内突破“卡脖子”技术的主力军，带领经济从“中国制造”到“中国创造”的产业升级；4)、以科创板为主的科技类相关公司的营收和利润增速显著高于 A 股整体表现，在半导体设备、AI 算力、创新药和智能汽车等赛道表现尤为亮眼，盈利增长动力强劲。本基金采取量化的方式开展科技创新型股票投资，其核心优势在于通过数据驱动的系统化框架，充分利用科技产业的高数据密度特性，通过系统化、纪律化的模型框架捕捉硬科技企业的成长特征，充分利用科技型股票高波动率的同时控制投资组合的整体风险，实现投资决策的标准化、实时化、纪律化和高效化，其底层投资框架采用管理人多年精心打造的量化投资体系，针对于科技类股票在子策略合成、多策略配置和投资组合管理等层面进行有针对性地改良。鉴于近些年市场环境的复杂性，我们更重视提升超额收益率的稳定性，在市场的演化过程不断引入新的因子和改良原有的模型，并通过多策略配置的形式来强化模型对不同风格的适应能力，在保持稳中求胜的风格下追求更好的超额收益率。

展望下半年，随着中东冲突逐步缓和，及中美共振降息的流动性宽松格局延续，A 股估值修复动力增强。盈利方面，虽仍面临关税压力，但在抢出口效应下，短期 A 股基本面仍有韧性支撑；估值方面，在全球市场风险偏好回暖和美国经济软着陆的预期下，全年仍有降息预期。而在国内人民币升值背景下，宽货币空间进一步打开，流动性宽松局面有望延续，驱动 A 股估值端进一步走强。整体而言，指数短期或面临阶段性调整压力，但尚未达到盈利承压最强的时候，因而每次调整都不剧烈，反而是流动性助推下，向上突破动力更强，指数持续有结构性做多机会。风险方面，仍需关注中美关税政策、地缘政治反复以及全球流动性收紧节奏，但监管层对资本市场改革的持续深化（如“国九条”落实）有望进一步稳定市场信心。

科技板块作为 A 股新质生产力的标杆，有望在 AI 模型持续突破和中美大国博弈的时间点上得到资金的青睐，我们努力追求突出科技创新属性的选股策略从中长期角度形成 Alpha 和 Beta 的双击。需要强调的是，量化投资策略是通过积少成多、以概率取胜的方式增厚投资收益，因此更需要投资者耐心持有，我们将努力通过科学的手段增强量化模型的超额收益率水平，以此不断为客户增厚投资收益，而对于高波动率的板块也建议投资者可以通过定投的方式来进一步优化持有体验。

#### 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 1.3163 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 12.14%，同期业绩比较基准收益率为 6.87%；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 1.3099 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为

11.92%，同期业绩比较基准收益率为 6.87%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

科创板企业以“硬科技”为核心，其盈利增长与产业政策、技术突破高度相关，下半年“新质生产力”战略深化，叠加全球 AI 竞赛升级，科创板在半导体、新能源、高端装备等领域的技术优势将转化为业绩动能，营收增速有望持续领跑 A 股；科创板综指上半年表现强势，尽管短期受科创过热后的获利了结影响出现波动，但长期来看板块估值（PB 分位数较低）与成长的匹配度仍具吸引力，政策红利与资金流入将支撑指数中枢上移；行业方面，半导体设备板块受益于晶圆厂扩产与设备国产化率提升，生物制造领域在合成生物学技术突破下应用场景持续拓展，高端装备中的机器人、航空航天板块受事件催化与订单增长驱动，景气度维持高位。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国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遵规守信、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 托管人对本中期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 2025 中期报告》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 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	3,818,027.01	5,598,669.91
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	62,063,103.44	64,965,705.70
其中：股票投资		62,063,103.44	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	6. 4. 7. 3	—	—
应收清算款		—	—
应收股利		—	—
应收申购款		619,658.77	60,074.37
递延所得税资产		—	—
其他资产	6. 4. 7. 4	—	—
资产总计		66,500,789.22	70,624,449.98
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 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		182,579.59	132,858.75
应付管理人报酬		61,148.45	785,287.54

应付托管费		10,191.41	130,881.29
应付销售服务费		10,927.34	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	6.4.7.5	55,269.45	120,027.00
负债合计		320,116.24	1,290,913.51
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.6	50,408,910.57	59,129,393.94
未分配利润	6.4.7.7	15,771,762.41	10,204,142.53
净资产合计		66,180,672.98	69,333,536.47
负债和净资产总计		66,500,789.22	70,624,449.98

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 50,408,910.57 份。其中国泰君安科创板量化选股股票发起 A 基金份额净值 1.3163 元，基金份额总额 23,313,838.18 份；国泰君安科创板量化选股股票发起 C 基金份额净值 1.3099 元，基金份额总额 27,095,072.39 份。

## 6.2 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：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 04 月 16 日（基金 合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		7,649,005.97	-5,821,932.10
1. 利息收入		11,496.10	35,478.48
其中：存款利息收入	6.4.7.8	9,251.36	35,478.48

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		2,244.74	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,696,867.49	-1,165,809.49
其中：股票投资收益	6.4.7.9	4,538,336.30	-1,643,180.12
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	6.4.7.10	158,531.19	477,370.63
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.11	2,887,879.61	-4,691,601.09
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	52,762.77	-
<b>减：二、营业总支出</b>		621,890.99	398,896.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	422,183.47	270,209.09
2. 托管费	6.4.10.2.2	70,363.93	45,034.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	74,795.62	48,821.60
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-

7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 13	54, 547. 97	34, 830. 63
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		7, 027, 114. 98	-6, 220, 828. 27
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		7, 027, 114. 98	-6, 220, 828. 27
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		7, 027, 114. 98	-6, 220, 828. 27

### 6.3 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：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	59, 129, 393. 94	10, 204, 142. 53	69, 333, 536. 47
二、本期期初净资产	59, 129, 393. 94	10, 204, 142. 53	69, 333, 536. 47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8, 720, 483. 37	5, 567, 619. 88	-3, 152, 863. 49
(一)、综合收益总额	-	7, 027, 114. 98	7, 027, 114. 98
(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）	-8, 720, 483. 37	-1, 459, 495. 10	-10, 179, 978. 47
其中：1. 基金申购款	36, 561, 475. 47	9, 830, 711. 71	46, 392, 187. 18
2. 基金赎回款	-45, 281, 958. 84	-11, 290, 206. 81	-56, 572, 165. 65
(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	50, 408, 910. 57	15, 771, 762. 41	66, 180, 672. 98
项目	上年度可比期间 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
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）	-	-6, 220, 828. 27	-6, 220, 828. 27

(一)、综合收益总额	-	-6,220,828.27	-6,220,828.27
(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)	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
(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	110,889,351.13	-6,220,828.27	104,668,522.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

陶耿

陶耿

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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,由上海国泰海通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海通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%。

#### 6.4.2 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 6.4.4 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。

#### 6.4.3 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 6.4.2 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的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 06 月 30 日的财务状况、2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日的经营成果和净资产变动情况。

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

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

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 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。

#### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
活期存款	2,115,532.92
等于： 本金	2,115,291.63
加： 应计利息	241.29
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	1,702,494.09
等于： 本金	1,702,463.69
加： 应计利息	30.40
减： 坏账准备	—

合计	3,818,027.01
----	--------------

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	59,795,806.37	-	62,063,103.44	2,267,297.07
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	59,795,806.37	-	62,063,103.44	2,267,297.07

#### 6.4.7.3 买入返售金融资产

##### 6.4.7.3.1 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。

##### 6.4.7.3.2 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。

#### 6.4.7.4 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	113.88
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	39,671.58
预提审计费	14,876.39
其他应付	607.60
合计	55,269.45

#### 6.4.7.6 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	37,437,385.16	37,437,385.16
本期申购	5,588,199.89	5,588,199.89
本期赎回(以“-”号填列)	-19,711,746.87	-19,711,746.87
本期末	23,313,838.18	23,313,838.18

##### 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	21,692,008.78	21,692,008.78
本期申购	30,973,275.58	30,973,275.58
本期赎回(以“-”号填列)	-25,570,211.97	-25,570,211.97
本期末	27,095,072.39	27,095,072.39

#### 6.4.7.7 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
上年度末	6,781,940.04	-274,144.18	6,507,795.86
本期期初	6,781,940.04	-274,144.18	6,507,795.86
本期利润	2,182,119.09	2,434,395.86	4,616,514.95
本期基金份额交易产生的变动数	-2,949,126.80	-800,647.82	-3,749,774.62
其中：基金申购款	1,259,619.83	77,281.54	1,336,901.37
基金赎回款	-4,208,746.63	-877,929.36	-5,086,675.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,014,932.33	1,359,603.86	7,374,536.19

## 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
上年度末	3,852,752.32	-156,405.65	3,696,346.67
本期期初	3,852,752.32	-156,405.65	3,696,346.67
本期利润	1,957,116.28	453,483.75	2,410,600.03
本期基金份额交易产生的变动数	1,012,217.24	1,278,062.28	2,290,279.52
其中：基金申购款	7,027,970.63	1,465,839.71	8,493,810.34
基金赎回款	-6,015,753.39	-187,777.43	6,203,530.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,822,085.84	1,575,140.38	8,397,226.22

## 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	7,688.55
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,562.81
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	9,251.36

## 6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	342,967,669.39
减：卖出股票成本总额	338,166,389.53
减：交易费用	262,943.56
买卖股票差价收入	4,538,336.30

## 6.4.7.10 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	158,531.19
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	158,531.19

#### 6.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,887,879.61
——股票投资	2,887,879.61
——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	2,887,879.61

#### 6.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	52,762.44
转换费收入	0.33
合计	52,762.77

#### 6.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	—
合计	54,547.97

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

基金管理人股东国泰海通证券股份有限公司于 2025 年 4 月 4 日发布《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，公司名称由国泰君安证券股份有限公司变更为国泰海通证券股份有限公司。

基金管理人上海国泰海通证券资产管理有限公司 2025 年 7 月 25 日发布《关于公司法定名称、住所变更的公告》，公司名称由上海国泰君安证券资产管理有限公司变更为上海国泰海通证券资产管理有限公司。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海国泰海通证券资产管理有限公司 (以下简称“国泰海通资管”)	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
国泰海通证券股份有限公司(以下简称“国泰海通证券”)	基金管理人的股东、代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 04 月 16 日 (基金合同生效日) 至 2024 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰海通证券	675,343,577.05	100.00%	552,356,516.13	100.00%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券	48,147.24	100.00%	0.00	0.00%
上年度可比期间 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日				
关联方名称	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
国泰海通证券	44,798.59	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管理费用管理规定》，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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	422,183.47	270,209.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	129,937.40	117,681.92
应支付基金管理人的净管理费	292,246.07	152,527.17

注：支付基金管理人国泰海通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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	70,363.93	45,034.85

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  $\times$  0.20% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安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
国泰海通资管	-	36,517.45	36,517.45
国泰海通证券	-	28,301.33	28,301.33
合计	-	64,818.78	64,818.78
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安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
国泰海通资管	-	4,065.29	4,065.29
国泰海通证券	-	43,651.27	43,651.27
合计	-	47,716.56	47,716.56

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，按月支付给国泰海通资管，再由国泰海通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  $\times$  0.40% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

## 国泰君安科创板量化选股股票发起 A

份额单位：份

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 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	5,009,901.80	—
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	5,009,901.80	5,009,901.80
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	21.49%	9.87%

## 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 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	5,000,900.00	—
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	5,000,900.00	5,000,900.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	18.46%	8.32%

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

## 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

## 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行	2,115,532.92	7,688.55	3,919,613.74	30,262.61
国泰海通证券	1,702,494.09	1,562.81	3,463,012.77	5,215.87

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海通证券保管，按协议约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须做说明的其他关联方交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2025 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

##### 6.4.12.2 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。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金的托管行中国光大银行股份有限公司，其他银行存款为国泰海通证券股份有限公司保证金，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 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2024 年 12 月 31 日：本基金未持有信用类债券）。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2025 年 6 月 30 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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风

险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

###### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,818,027.01	-	-	-	3,818,027.01
交易性金融资产	-	-	-	62,063,103.44	62,063,103.44
应收申购款	-	-	-	619,658.77	619,658.77
资产总计	3,818,027.01	-	-	62,682,762.21	66,500,789.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	182,579.59	182,579.59
应付管理人报酬	-	-	-	61,148.45	61,148.45
应付托管费	-	-	-	10,191.41	10,191.41
应付销售服务费	-	-	-	10,927.34	10,927.34
其他负债	-	-	-	55,269.45	55,269.45
负债总计	-	-	-	320,116.24	320,116.24
利率敏感度缺口	3,818,027.01	-	-	62,362,645.97	66,180,672.98
上年度末 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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例 0.00% (2024 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 (2024 年 12 月 31 日: 同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日		上年度末 2024 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	62,063,103.44	93.78	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	62,063,103.44	93.78	64,965,705.70	93.70

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	3,328,810.30	-
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-3,328,810.30	-

注: 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。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	62,063,103.44	64,965,705.70
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	62,063,103.44	64,965,705.70

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6. 4. 14. 3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6. 4. 14. 4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6. 4. 15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

### § 7 投资组合报告

#### 7. 1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	62,063,103.44	93.33
	其中：股票	62,063,103.44	93.33
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	3,818,027.01	5.74
8	其他各项资产	619,658.77	0.93
9	合计	66,500,789.22	100.00

#### 7. 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	289,367.00	0.44
B	采矿业	—	—
C	制造业	49,530,772.97	74.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	182,903.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	50,879.00	0.08
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,412,406.63	14.22
J	金融业	152,403.00	0.23
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	2,385,865.84	3.61
N	水利、环境和公共设施管理业	58,506.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	62,063,103.44	93.78

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	688041	海光信息	17,514	2,474,553.06	3.74
2	688981	中芯国际	24,712	2,178,857.04	3.29
3	688256	寒武纪	2,800	1,684,200.00	2.54
4	688008	澜起科技	16,162	1,325,284.00	2.00
5	688111	金山办公	3,519	985,495.95	1.49
6	688249	晶合集成	48,100	974,987.00	1.47
7	688183	生益电子	18,096	926,515.20	1.40
8	688469	芯联集成	191,291	912,458.07	1.38

9	688396	华润微	18,313	863,641.08	1.30
10	688347	华虹公司	14,300	785,213.00	1.19
11	688343	云天励飞	15,543	768,135.06	1.16
12	688660	电气风电	86,500	750,820.00	1.13
13	688146	中船特气	24,400	705,404.00	1.07
14	688158	优刻得	31,045	702,237.90	1.06
15	688403	汇成股份	66,300	688,857.00	1.04
16	688584	上海合晶	37,682	673,754.16	1.02
17	688512	慧智微	61,650	672,601.50	1.02
18	002414	高德红外	64,900	665,225.00	1.01
19	688518	联赢激光	32,497	662,613.83	1.00
20	688593	新相微	40,417	660,009.61	1.00
21	688222	成都先导	40,843	656,755.44	0.99
22	688602	康鹏科技	77,406	648,662.28	0.98
23	688141	杰华特	19,889	647,983.62	0.98
24	688595	芯海科技	17,212	643,556.68	0.97
25	688209	英集芯	34,436	636,032.92	0.96
26	688128	中国电研	25,666	628,817.00	0.95
27	688499	利元亨	14,916	620,654.76	0.94
28	688505	复旦张江	71,050	615,293.00	0.93
29	301260	格力博	30,400	599,488.00	0.91
30	688220	翱捷科技	7,618	596,489.40	0.90
31	688176	亚虹医药	65,026	576,780.62	0.87
32	688277	天智航	41,019	570,164.10	0.86
33	688351	微电生理	28,743	566,237.10	0.86
34	688428	诺诚健华	22,859	558,445.37	0.84
35	688549	中巨芯	69,200	535,608.00	0.81
36	688180	君实生物	15,673	532,568.54	0.80
37	688108	赛诺医疗	47,366	531,446.52	0.80
38	688661	和林微纳	13,362	531,406.74	0.80
39	688523	航天环宇	24,208	520,714.08	0.79
40	688387	信科移动	88,300	498,895.00	0.75
41	300869	康泰医学	33,900	486,126.00	0.73
42	688506	百利天恒	1,600	473,792.00	0.72
43	688380	中微半导	17,400	471,540.00	0.71
44	688400	凌云光	17,000	468,690.00	0.71
45	688275	万润新能	10,838	439,480.90	0.66
46	301526	国际复材	117,200	426,608.00	0.64
47	688012	中微公司	2,320	422,936.00	0.64
48	300879	大叶股份	10,600	416,368.00	0.63
49	688388	嘉元科技	20,600	413,648.00	0.63
50	300458	全志科技	10,290	408,410.10	0.62
51	688418	震有科技	15,400	407,484.00	0.62

52	688055	龙腾光电	109,798	406,252.60	0.61
53	002258	利尔化学	36,400	401,856.00	0.61
54	688819	天能股份	14,100	391,416.00	0.59
55	688262	国芯科技	14,600	389,382.00	0.59
56	300558	贝达药业	6,600	382,470.00	0.58
57	688271	联影医疗	2,949	376,705.26	0.57
58	688717	艾罗能源	6,893	371,050.19	0.56
59	300124	汇川技术	5,700	368,049.00	0.56
60	688552	航天南湖	9,000	359,190.00	0.54
61	600703	三安光电	28,700	356,454.00	0.54
62	688031	星环科技	7,610	354,854.30	0.54
63	688488	艾迪药业	25,418	352,039.30	0.53
64	688297	中无人机	6,416	342,614.40	0.52
65	688636	智明达	10,100	341,279.00	0.52
66	688181	八亿时空	10,800	336,096.00	0.51
67	688085	三友医疗	17,174	330,256.02	0.50
68	300043	星辉娱乐	67,600	327,184.00	0.49
69	688202	美迪西	9,049	325,130.57	0.49
70	688365	光云科技	21,070	320,685.40	0.48
71	688550	瑞联新材	7,400	318,274.00	0.48
72	688321	微芯生物	13,343	317,296.54	0.48
73	688122	西部超导	6,100	316,468.00	0.48
74	300393	中来股份	54,500	313,920.00	0.47
75	688685	迈信林	5,493	306,784.05	0.46
76	688716	中研股份	8,412	299,467.20	0.45
77	688334	西高院	17,400	298,932.00	0.45
78	600460	士兰微	12,000	297,840.00	0.45
79	688233	神工股份	9,300	295,461.00	0.45
80	688690	纳微科技	12,938	295,374.54	0.45
81	688079	美迪凯	29,400	295,176.00	0.45
82	688280	精进电动	40,555	294,834.85	0.45
83	688179	阿拉丁	22,885	291,097.20	0.44
84	688033	天宜新材	44,300	283,963.00	0.43
85	300456	赛微电子	16,500	283,635.00	0.43
86	688015	交控科技	13,488	281,089.92	0.42
87	688201	信安世纪	21,200	274,540.00	0.41
88	688373	盟科药业	43,594	273,334.38	0.41
89	002624	完美世界	17,800	270,026.00	0.41
90	688221	前沿生物	26,682	267,887.28	0.40
91	300830	金现代	27,300	249,249.00	0.38
92	688588	凌志软件	16,964	247,165.48	0.37
93	688090	瑞松科技	7,130	245,200.70	0.37
94	688182	灿勤科技	8,821	243,106.76	0.37

95	688579	山大地纬	21,605	241,759.95	0.37
96	688582	芯动联科	3,500	235,200.00	0.36
97	600521	华海药业	12,300	229,149.00	0.35
98	688381	帝奥微	10,100	218,766.00	0.33
99	300102	乾照光电	18,900	218,673.00	0.33
100	002786	银宝山新	23,400	215,748.00	0.33
101	688425	铁建重工	52,571	214,489.68	0.32
102	688001	华兴源创	8,246	208,376.42	0.31
103	300489	光智科技	4,700	207,552.00	0.31
104	300967	晓鸣股份	11,200	207,200.00	0.31
105	688022	瀚川智能	13,891	205,864.62	0.31
106	688030	山石网科	12,789	204,496.11	0.31
107	688665	四方光电	4,500	201,240.00	0.30
108	688590	新致软件	9,500	195,130.00	0.29
109	688702	盛科通信	3,174	193,867.92	0.29
110	688036	传音控股	2,400	191,280.00	0.29
111	688131	皓元医药	3,837	185,518.95	0.28
112	301558	三态股份	20,300	182,903.00	0.28
113	300289	利德曼	34,900	181,480.00	0.27
114	301165	锐捷网络	2,900	178,234.00	0.27
115	002151	北斗星通	6,200	177,878.00	0.27
116	688238	和元生物	27,900	172,980.00	0.26
117	688286	敏芯股份	2,400	169,656.00	0.26
118	300825	阿尔特	15,500	167,555.00	0.25
119	688586	江航装备	14,800	166,500.00	0.25
120	688261	东微半导	3,931	162,153.75	0.25
121	688668	鼎通科技	2,500	156,150.00	0.24
122	300746	汉嘉设计	9,900	155,133.00	0.23
123	300206	理邦仪器	12,800	153,856.00	0.23
124	300185	通裕重工	53,400	152,724.00	0.23
125	601628	中国人寿	3,700	152,403.00	0.23
126	688020	方邦股份	4,000	151,480.00	0.23
127	300750	宁德时代	600	151,332.00	0.23
128	300420	五洋自控	43,300	148,952.00	0.23
129	300562	乐心医疗	9,900	146,025.00	0.22
130	688629	华丰科技	2,549	145,802.80	0.22
131	688739	成大生物	5,376	141,926.40	0.21
132	300739	明阳电路	9,500	140,980.00	0.21
133	688248	南网科技	4,200	132,132.00	0.20
134	300631	久吾高科	5,100	125,256.00	0.19
135	688458	美芯晟	2,535	119,550.60	0.18
136	300510	金冠股份	25,600	117,248.00	0.18
137	688327	云从科技	8,197	113,036.63	0.17

138	688711	宏微科技	6,000	105,540.00	0.16
139	688213	思特威	1,000	102,220.00	0.15
140	300548	博创科技	1,500	100,155.00	0.15
141	300241	瑞丰光电	16,600	94,620.00	0.14
142	688102	斯瑞新材	7,000	94,360.00	0.14
143	688553	汇宇制药	5,700	92,853.00	0.14
144	688147	微导纳米	3,054	92,169.72	0.14
145	688560	明冠新材	6,000	91,020.00	0.14
146	300221	银禧科技	10,700	88,810.00	0.13
147	002107	沃华医药	15,500	88,660.00	0.13
148	300231	银信科技	7,200	88,632.00	0.13
149	688270	臻镭科技	1,900	88,464.00	0.13
150	300358	楚天科技	11,300	88,140.00	0.13
151	688443	智翔金泰	3,150	87,381.00	0.13
152	300549	优德精密	4,700	85,963.00	0.13
153	301281	科源制药	2,600	84,188.00	0.13
154	688722	同益中	3,929	83,569.83	0.13
155	301087	可孚医疗	2,500	83,000.00	0.13
156	300014	亿纬锂能	1,800	82,458.00	0.12
157	688585	上纬新材	10,385	80,795.30	0.12
158	688468	科美诊断	10,413	76,639.68	0.12
159	688597	煜邦电力	9,740	76,264.20	0.12
160	688225	亚信安全	3,700	75,443.00	0.11
161	688018	乐鑫科技	501	73,196.10	0.11
162	301282	金禄电子	2,800	69,412.00	0.10
163	301509	金凯生科	1,800	68,022.00	0.10
164	688591	泰凌微	1,386	66,389.40	0.10
165	301536	星宸科技	1,100	66,330.00	0.10
166	688558	国盛智科	2,600	65,624.00	0.10
167	301248	杰创智能	2,500	62,200.00	0.09
168	688150	莱特光电	2,516	62,195.52	0.09
169	300187	永清环保	11,400	58,140.00	0.09
170	688571	杭华股份	7,400	57,054.00	0.09
171	688733	壹石通	2,900	54,926.00	0.08
172	688667	菱电电控	985	52,411.85	0.08
173	688298	东方生物	1,900	51,965.00	0.08
174	300496	中科创达	900	51,498.00	0.08
175	600106	重庆路桥	8,300	50,879.00	0.08
176	688185	康希诺	839	50,029.57	0.08
177	300039	上海凯宝	8,200	49,692.00	0.08
178	300160	秀强股份	8,800	49,456.00	0.07
179	600268	国电南自	6,300	49,266.00	0.07
180	300473	德尔股份	1,500	48,825.00	0.07

181	600685	中船防务	1,700	46,223.00	0.07
182	300498	温氏股份	2,600	44,408.00	0.07
183	301055	张小泉	2,100	44,268.00	0.07
184	688603	天承科技	1,000	44,200.00	0.07
185	300224	正海磁材	3,100	43,865.00	0.07
186	688510	航亚科技	1,800	43,524.00	0.07
187	002491	通鼎互联	7,600	43,168.00	0.07
188	300054	鼎龙股份	1,500	43,020.00	0.07
189	300400	劲拓股份	2,500	42,100.00	0.06
190	301318	维海德	1,200	40,608.00	0.06
191	300606	金太阳	2,000	39,440.00	0.06
192	688800	瑞可达	800	39,360.00	0.06
193	688653	康希通信	3,200	39,200.00	0.06
194	688538	和辉光电	16,559	38,748.06	0.06
195	600354	敦煌种业	6,100	37,759.00	0.06
196	300026	红日药业	10,100	37,269.00	0.06
197	300320	海达股份	3,400	33,796.00	0.05
198	688360	德马科技	1,700	31,535.00	0.05
199	688379	华光新材	900	31,194.00	0.05
200	600819	耀皮玻璃	4,800	27,936.00	0.04
201	300768	迪普科技	1,600	27,440.00	0.04
202	688362	甬矽电子	900	26,802.00	0.04
203	688173	希荻微	1,800	24,588.00	0.04
204	688252	天德钰	1,000	24,380.00	0.04
205	300579	数字认证	700	24,157.00	0.04
206	688508	芯朋微	430	24,002.60	0.04
207	688177	百奥泰	796	19,947.76	0.03
208	002249	大洋电机	2,300	15,134.00	0.02
209	600389	江山股份	700	13,020.00	0.02
210	300602	飞荣达	600	12,726.00	0.02
211	688235	百济神州	33	7,710.12	0.01
212	688088	虹软科技	108	5,211.00	0.01
213	688208	道通科技	125	3,825.00	0.01
214	688135	利扬芯片	149	3,085.79	0.00
215	688049	炬芯科技	22	1,331.00	0.00
216	688472	阿特斯	116	1,061.40	0.00
217	301199	迈赫股份	40	1,020.80	0.00
218	688046	药康生物	42	631.68	0.00
219	688600	皖仪科技	26	611.00	0.00
220	300787	海能实业	40	554.00	0.00
221	688247	宣泰医药	49	506.17	0.00
222	688005	容百科技	21	468.72	0.00
223	300932	三友联众	40	458.00	0.00

224	688728	格科微	28	431.20	0.00
225	688057	金达莱	30	366.00	0.00
226	688216	气派科技	11	252.23	0.00
227	688009	中国通号	27	138.78	0.00
228	688475	萤石网络	3	94.56	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688041	海光信息	4,737,176.96	6.83
2	688981	中芯国际	3,873,903.29	5.59
3	688008	澜起科技	2,865,369.23	4.13
4	688280	精进电动	2,843,567.37	4.10
5	688256	寒武纪	2,704,536.26	3.90
6	688141	杰华特	2,594,205.00	3.74
7	688111	金山办公	2,434,217.00	3.51
8	688183	生益电子	2,372,717.78	3.42
9	688584	上海合晶	2,360,057.67	3.40
10	688249	晶合集成	2,355,625.00	3.40
11	688277	天智航	2,307,770.83	3.33
12	688158	优刻得	2,238,103.57	3.23
13	688591	泰凌微	2,195,865.01	3.17
14	688235	百济神州	2,057,792.96	2.97
15	688343	云天励飞	2,013,931.44	2.90
16	688327	云从科技	2,011,601.57	2.90
17	688717	艾罗能源	1,992,669.22	2.87
18	688661	和林微纳	1,973,093.83	2.85
19	688472	阿特斯	1,866,247.89	2.69
20	688222	成都先导	1,804,421.56	2.60
21	688099	晶晨股份	1,776,673.29	2.56
22	688702	盛科通信	1,753,051.25	2.53
23	688385	复旦微电	1,726,123.01	2.49
24	301260	格力博	1,708,131.00	2.46
25	688553	汇宇制药	1,648,791.18	2.38
26	688443	智翔金泰	1,604,479.40	2.31
27	688660	电气风电	1,572,335.63	2.27
28	688065	凯赛生物	1,558,860.46	2.25
29	688161	威高骨科	1,551,106.85	2.24
30	688114	华大智造	1,541,347.97	2.22

31	688728	格科微	1,535,605.24	2.21
32	688549	中巨芯	1,531,574.50	2.21
33	688322	奥比中光	1,526,066.63	2.20
34	688432	有研硅	1,501,732.81	2.17
35	688347	华虹公司	1,483,562.00	2.14
36	688508	芯朋微	1,453,165.35	2.10
37	688396	华润微	1,446,469.51	2.09
38	688082	盛美上海	1,415,554.26	2.04
39	688403	汇成股份	1,414,375.00	2.04
40	688208	道通科技	1,412,066.10	2.04
41	688387	信科移动	1,394,851.78	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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688981	中芯国际	5,210,867.12	7.52
2	688041	海光信息	4,714,675.93	6.80
3	688008	澜起科技	3,799,132.15	5.48
4	688256	寒武纪	3,119,092.00	4.50
5	688099	晶晨股份	2,905,172.33	4.19
6	688591	泰凌微	2,778,687.04	4.01
7	688158	优刻得	2,677,250.70	3.86
8	688280	精进电动	2,613,369.58	3.77
9	688111	金山办公	2,612,072.08	3.77
10	688012	中微公司	2,476,032.20	3.57
11	688472	阿特斯	2,344,326.45	3.38
12	688327	云从科技	2,316,692.40	3.34
13	688161	威高骨科	2,250,465.23	3.25
14	688385	复旦微电	2,182,742.87	3.15
15	688141	杰华特	2,157,592.06	3.11
16	688065	凯赛生物	2,134,611.37	3.08
17	688235	百济神州	2,107,221.62	3.04
18	688120	华海清科	2,061,226.51	2.97
19	688208	道通科技	2,059,187.32	2.97
20	688508	芯朋微	1,998,616.02	2.88
21	688553	汇宇制药	1,923,310.07	2.77
22	688183	生益电子	1,896,530.54	2.74
23	688110	东芯股份	1,875,918.88	2.71
24	688432	有研硅	1,805,984.10	2.60

25	688180	君实生物	1,749,546.63	2.52
26	688277	天智航	1,747,421.05	2.52
27	688249	晶合集成	1,747,165.04	2.52
28	688584	上海合晶	1,729,388.27	2.49
29	688772	珠海冠宇	1,727,726.41	2.49
30	688223	晶科能源	1,724,798.31	2.49
31	688122	西部超导	1,714,337.38	2.47
32	688009	中国通号	1,700,987.51	2.45
33	688717	艾罗能源	1,668,639.68	2.41
34	688322	奥比中光	1,658,697.63	2.39
35	688088	虹软科技	1,654,520.88	2.39
36	688661	和林微纳	1,653,347.28	2.38
37	688728	格科微	1,643,214.92	2.37
38	688347	华虹公司	1,639,344.11	2.36
39	688443	智翔金泰	1,554,462.67	2.24
40	688114	华大智造	1,511,101.80	2.18
41	688082	盛美上海	1,509,510.79	2.18
42	688177	百奥泰	1,470,839.45	2.12
43	688107	安路科技	1,440,363.74	2.08
44	688702	盛科通信	1,430,972.54	2.06
45	688425	铁建重工	1,419,804.00	2.05
46	688396	华润微	1,405,977.59	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。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	332,375,907.66
卖出股票收入（成交）总额	342,967,669.39

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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金持有的前十名证券发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	619,658.77
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	619,658.77

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国泰君安科创板量化选股股票发起 A	445	52,390.65	6,104,617.93	26.18%	17,209,220.25	73.82%
国泰君安科创板量化选股股票发起 C	671	40,380.14	13,685,273.96	50.51%	13,409,798.43	49.49%
合计	1,116	45,169.27	19,789,891.89	39.26%	30,619,018.68	60.74%

注：分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母

采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国泰君安科创板量化选股股票发起 A	422,003.96	1.8101%
	国泰君安科创板量化选股股票发起 C	108,698.40	0.4012%
	合计	530,702.36	1.0528%

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

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国泰君安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。

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,010,801.80	19.86%	10,010,801.80	19.86%	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	0.33%	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	363,879.35	0.72%	-	-	-
合计	10,541,504.16	20.91%	10,010,801.80	19.86%	-

注：其他为公司普通员工持有份额，持有期限为不低于 6 个月。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安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
本报告期期初基金份额总额	37,437,385.16	21,692,008.78
本报告期基金总申购份额	5,588,199.89	30,973,275.58
减：本报告期基金总赎回份额	19,711,746.87	25,570,211.97
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	23,313,838.18	27,095,072.39

注：基金总申购份额含红利再投资及转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2025 年 4 月 26 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》，陶耿同志担任公司董事长，谢乐斌同志不再担任公司董事长，生效日期为 2025 年 4 月 25 日。

2、本报告期内本基金托管人重大人事变动如下：

2025 年 1 月，中国光大银行股份有限公司聘任贾光华先生担任资产托管部总经理职务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
国泰海通 证券股份 有限公司	2	675,343,577.0 5	100.00%	48,147.2 4	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。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰君安科创板量化选股股票	证监会指定网站、公司官网	2025-01-22

	型发起式证券投资基金 2024 年第四季度报告		
2	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年 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	2025-01-22
3	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分开放式证券投资基金在直销柜台开通基金转换业务的公告	上海证券报、中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2025-02-19
4	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	证监会指定网站、公司官网	2025-03-29
5	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025-03-31
6	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	证监会指定网站、公司官网	2025-03-31
7	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	2025-04-15
8	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	2025-04-15
9	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（更新）（2025 年第一次）	证监会指定网站、公司官网	2025-04-15
10	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-04-22
11	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年 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	2025-04-22
12	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	2025-04-26
13	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蚂蚁财富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	2025-04-30
14	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于办公地址变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指	2025-04-30

	告	定网站、公司官网、上交所	
15	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	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	2025-06-11
16	在本报告期内刊登的其他公告	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20250220, 20250526-20250629	10,010,801.80	-	-	10,010,801.80	19.86%

#### 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2025 年 7 月 25 日, 本基金管理人发布了《上海国泰海通证券资产管理有限公司关于基金管理人法定名称、住所变更的公告》, 其中公司中文名称由“上海国泰君安证券资产管理有限公司”变更为“上海国泰海通证券资产管理有限公司”, 公司住所由“上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室”变更为“上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层”, 生效日期为 2025 年 7 月 25 日。

## § 12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予国泰君安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。

## 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站  
<https://www.gthtzg.com>。

## 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

上海国泰海通证券资产管理有限公司  
二〇二五年八月二十九日