

国泰君安量化选股混合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:中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年08月26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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14

§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	70
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	71
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	71
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	71
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	71
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
7.12 投资组合报告附注	71

§ 8 基金份额持有人信息	72
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
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	73
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	74
§ 9 开放式基金份额变动	74
§ 10 重大事件揭示	74
10.1 基金份额持有人大会决议	75
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	75
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
10.4 基金投资策略的改变	75
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
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	75
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
10.8 其他重大事件	76
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	77
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	77
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§ 12 备查文件目录	77
12.1 备查文件目录	77
12.2 存放地点	78
12.3 查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金		
基金简称	国泰君安量化选股混合发起		
基金主代码	016466		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2022 年 08 月 18 日		
基金管理人	上海国泰海通证券资产管理有限公司		
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	767,108,702.69 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	国泰君安量化选股混合发起 A	国泰君安量化选股混合发起 C	国泰君安量化选股混合发起 D
下属分级基金的交易代码	016466	016467	018963
报告期末下属分级基金的份额总额	374,414,790.48 份	143,387,134.07 份	249,306,778.14 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	本基金通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金依据宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，重点关注包括 GDP 增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势，同时强调金融市场投资者行为分析，关注资本市场资金供求关系变化等因素，在深入分析基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度，形成资产配置方案。 本基金的投资策略还包括股票投资策略、债券投资策略、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中证全指指数收益率*80%+中债综合全价指数收益率*20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海国泰海通证券资产管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	张立学
	联系电话	021-38676022	010-68858113
	电子邮箱	zgxxpl@gtht.com	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		95521	95580
传真		021-38871190	010-68858120
注册地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层	北京市西城区金融大街 3 号
办公地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码		200011	100808
法定代表人		陶耿	郑国雨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gthtzg.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

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）		
	国泰君安量化选股混合发起 A	国泰君安量化选股混合发起 C	国泰君安量化选股混合发起 D
本期已实现收益	23,804,995.35	7,416,653.85	12,200,751.62
本期利润	48,848,269.16	19,533,170.36	22,527,579.59
加权平均基金份额本期利润	0.1339	0.1190	0.0783

本期加权平均净值利润率	11.71%	10.55%	6.91%
本期基金份额净值增长率	10.75%	10.52%	10.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）		
期末可供分配利润	56,514,249.77	19,768,787.57	35,470,158.47
期末可供分配基金份额利润	0.1509	0.1379	0.1423
期末基金资产净值	458,444,183.68	173,576,196.28	302,975,289.09
期末基金份额净值	1.2244	1.2105	1.2153
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）		
基金份额累计净值增长率	22.44%	21.05%	10.06%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰君安量化选股混合发起 A 净值表现

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去一个月	6.36%	0.91%	3.25%	0.59%	3.11%	0.32%
过去三个月	5.90%	1.61%	2.44%	1.13%	3.46%	0.48%
过去六个月	10.75%	1.42%	3.57%	1.02%	7.18%	0.40%
过去一年	32.18%	1.59%	18.90%	1.28%	13.28%	0.31%
自基金合同生 效起至今	22.44%	1.32%	-3.02%	1.00%	25.46%	0.32%

国泰君安量化选股混合发起 C 净值表现

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去一个月	6.31%	0.91%	3.25%	0.59%	3.06%	0.32%
过去三个月	5.79%	1.61%	2.44%	1.13%	3.35%	0.48%
过去六个月	10.52%	1.42%	3.57%	1.02%	6.95%	0.40%
过去一年	31.65%	1.59%	18.90%	1.28%	12.75%	0.31%
自基金合同生 效起至今	21.05%	1.32%	-3.02%	1.00%	24.07%	0.32%

国泰君安量化选股混合发起 D 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	6.33%	0.91%	3.25%	0.59%	3.08%	0.32%
过去三个月	5.80%	1.61%	2.44%	1.13%	3.36%	0.48%
过去六个月	10.53%	1.42%	3.57%	1.02%	6.96%	0.40%
过去一年	31.65%	1.59%	18.90%	1.28%	12.75%	0.31%
自基金合同生 效起至今	10.06%	1.48%	1.61%	1.11%	8.45%	0.37%

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

国泰君安量化选股混合发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2022年08月18日-2025年06月30日)



国泰君安量化选股混合发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年08月18日-2025年06月30日)



国泰君安量化选股混合发起D累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2023年08月07日-2025年06月30日)



注：本基金于 2022 年 8 月 18 日成立，D 类份额于 2023 年 8 月 7 日首次申购确认，D 类份额当期的相关数据和指标按实际存续期（即 2023 年 8 月 7 日至 2025 年 06 月 30 日）计算。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海国泰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）	2022-08-18	-	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。

	总经理。				
--	------	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 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%）、中证 1000 指数（涨幅 6.69%）表现较好，而中证红利指数表现较弱（跌幅 3.07%）。

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。

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，A 股市场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。

本基金充分发挥管理人在多基准、多策略上长期布局的优势，在复杂多变的市场环境下一方面对每一个基准的策略做精做细，另一方面强化管理人的量化策略配置能力。在单个策略层面，我们通过挖掘有投资逻辑的 Alpha 因子，不断改进底层量化模型以及定期监控策略的表现等方式来增强每一个策略表现，我们一直坚守一贯的投资体系和理念，并尽可能以此来稳定投资者对我们超额收益率的预期。在策略配置层面，尽量追求高风险偏好的科技成长 and 低风险偏好的红利价值的动态均衡，并通过适当配置全市场最大化 Alpha 策略和中小市值指数增强策略来达到持仓在大中小市值上的均衡，以此进一步增强投资者的持有体验。作为全市场选股的量化基金，相比于通过控制仓位来

做择时操作，我们一方面通过较稳定的仓位运行来最大程度的兑现我们稳定的 Alpha 能力，另一方面主要通过调整风格迥异的策略配置比例来尽量协调波动和收益的关系。值得一提的是，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，因此更需要投资者长期耐心持有。我们认为当前市场整体估值依然处于历史低估阶段，未来上涨的空间依然大于下跌的空间，我们将努力通过科学的手段强化量化模型的超额收益率水平，以此不断为客户增厚投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安量化选股混合发起 A 基金份额净值为 1.2244 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 10.75%，同期业绩比较基准收益率为 3.57%；截至报告期末国泰君安量化选股混合发起 C 基金份额净值为 1.2105 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 10.52%，同期业绩比较基准收益率为 3.57%；截至报告期末国泰君安量化选股混合发起 D 基金份额净值为 1.2153 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 10.53%，同期业绩比较基准收益率为 3.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全市场选股策略需兼顾不同板块对经济周期的敏感度，下半年经济复苏呈现“结构分化”特征，科技成长受益于政策红利，价值蓝筹受益于盈利修复，中小盘股受益于流动性宽松，为多策略均衡配置提供基础；市场风格从“单一主线”转向“多元机会”，科技成长与红利价值的动态平衡成为关键，本基金通过多基准策略覆盖大中小市值，在控制波动的同时捕捉跨风格超额收益，适合长期布局；行业走势上，科技（AI、半导体）、周期（有色、化工）、消费（可选消费）、金融（银行）等板块轮动特征显著，其中科技成长的长期逻辑与红利价值的防御属性形成互补，地缘政治与关税政策的变化将影响板块轮动节奏，需通过量化模型动态调整行业暴露。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金

报告截止日：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
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	70,019,313.25	112,252,222.74
结算备付金		8,190,999.62	2,938,970.17

存出保证金		1,977,868.80	1,925,860.80
交易性金融资产	6.4.7.2	859,966,181.98	936,832,140.23
其中：股票投资		859,966,181.98	936,832,140.23
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,594,936.30	1,444,248.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		941,749,299.95	1,055,393,442.18
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		5,658,276.43	26,424,421.21

应付管理人报酬		727,024.80	1,005,065.55
应付托管费		109,053.73	150,759.85
应付销售服务费		134,839.50	256,074.47
应付投资顾问费		—	—
应交税费		3,853.18	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.6	120,583.26	171,649.01
负债合计		6,753,630.90	28,007,970.09
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	767,108,702.69	933,195,587.71
未分配利润	6.4.7.8	167,886,966.36	94,189,884.38
净资产合计		934,995,669.05	1,027,385,472.09
负债和净资产总计		941,749,299.95	1,055,393,442.18

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 767,108,702.69 份。其中国泰君安量化选股混合发起 A 基金份额净值 1.2244 元，基金份额总额 374,414,790.48 份；国泰君安量化选股混合发起 C 基金份额净值 1.2105 元，基金份额总额 143,387,134.07 份；国泰君安量化选股混合发起 D 基金份额净值 1.2153 元，基金份额总额 249,306,778.14 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金
 本报告期：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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
一、营业总收入		97,308,390.29	-247,029,545.31
1. 利息收入		170,870.62	426,201.29

其中：存款利息收入	6.4.7.9	166,286.92	426,201.29
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		4,583.70	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		48,851,300.22	-225,164,690.20
其中：股票投资收益	6.4.7.10	42,478,421.75	-235,056,037.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.11	-163,902.89	-4,642,553.97
股利收益	6.4.7.12	6,536,781.36	14,533,900.77
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	47,486,618.29	-26,236,023.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	799,601.16	3,944,967.20
减：二、营业总支出		6,399,371.18	12,897,654.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,608,318.15	9,320,107.50
2. 托管费	6.4.10.2.2	691,247.77	1,398,016.20
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,015,502.70	2,094,995.38
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-

7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 15	84, 302. 56	84, 535. 36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		90, 909, 019. 11	-259, 927, 199. 75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		90, 909, 019. 11	-259, 927, 199. 75
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		90, 909, 019. 11	-259, 927, 199. 75

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金

本报告期：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	933, 195, 587. 71	94, 189, 884. 38	1, 027, 385, 472. 09
二、本期期初净资产	933, 195, 587. 71	94, 189, 884. 38	1, 027, 385, 472. 09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-166, 086, 885. 02	73, 697, 081. 98	-92, 389, 803. 04
（一）、综合收益总额	-	90, 909, 019. 11	90, 909, 019. 11
（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）	-166, 086, 885. 02	-17, 211, 937. 13	-183, 298, 822. 15
其中：1. 基金申购款	458, 271, 235. 76	64, 427, 146. 31	522, 698, 382. 07
2. 基金赎回款	-624, 358, 120. 78	-81, 639, 083. 44	-705, 997, 204. 22
（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	767, 108, 702. 69	167, 886, 966. 36	934, 995, 669. 05
项 目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2, 554, 263, 232. 70	70, 682, 456. 17	2, 624, 945, 688. 87
二、本期期初净资产	2, 554, 263, 232. 70	70, 682, 456. 17	2, 624, 945, 688. 87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1, 235, 055, 583. 21	-171, 337, 560. 49	-1, 406, 393, 143. 70
（一）、综合收益总额	-	-259, 927, 199. 75	-259, 927, 199. 75

(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）	- 1, 235, 055, 583. 21	88, 589, 639. 26	- 1, 146, 465, 943. 95
其中：1. 基金申购款	839, 946, 932. 05	-35, 809, 899. 05	804, 137, 033. 00
2. 基金赎回款	- 2, 075, 002, 515. 26	124, 399, 538. 31	- 1, 950, 602, 976. 95
(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	1, 319, 207, 649. 49	-100, 655, 104. 32	1, 218, 552, 545. 17

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

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

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

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

根据《国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》，本基金根据认购/申购费用与

销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取申购费用的基金份额，称为 D 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，本基金可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票(含存托凭证)资产占基金资产的 60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率×80%+中债综合全价指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 中期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 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等有关信息。

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

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

估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收

入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
活期存款	22,087,455.06
等于：本金	22,081,654.98
加：应计利息	5,800.08
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	47,931,858.19
等于：本金	47,931,106.15
加：应计利息	752.04
减：坏账准备	-
合计	70,019,313.25

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		832,593,240.76	-	859,966,181.98	27,372,941.22
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		832,593,240.76	-	859,966,181.98	27,372,941.22

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	16,237,586.67	-	-	-
一股指期货	16,237,586.67	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	16,237,586.67	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2507	IC2507	4	4,693,920.00	14,800.00
IC2508	IC2508	4	4,660,320.00	125,413.33
IC2512	IC2512	3	3,393,360.00	17,600.00
IM2508	IM2508	3	3,734,640.00	86,840.00

合计				244,653.33
减：可抵销期货暂收款				244,653.33
净额				0.00

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,884.11
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	24,795.19
其他应付	31,396.59
合计	120,583.26

6.4.7.7 实收基金

国泰君安量化选股混合发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 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	358,709,206.33	358,709,206.33
本期申购	215,235,055.25	215,235,055.25
本期赎回（以“-”号填列）	-199,529,471.10	-199,529,471.10
本期末	374,414,790.48	374,414,790.48

国泰君安量化选股混合发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 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	201,995,901.44	201,995,901.44
本期申购	70,284,617.92	70,284,617.92
本期赎回（以“-”号填列）	-128,893,385.29	-128,893,385.29
本期末	143,387,134.07	143,387,134.07

国泰君安量化选股混合发起 D

金额单位：人民币元

项目	本期 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	372,490,479.94	372,490,479.94
本期申购	172,751,562.59	172,751,562.59
本期赎回（以“-”号填列）	-295,935,264.39	-295,935,264.39
本期末	249,306,778.14	249,306,778.14

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

国泰君安量化选股混合发起 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34,970,103.79	2,911,061.39	37,881,165.18
本期期初	34,970,103.79	2,911,061.39	37,881,165.18
本期利润	23,804,995.35	25,043,273.81	48,848,269.16
本期基金份额交易产生的变动数	-2,260,849.37	-439,191.77	-2,700,041.14
其中：基金申购款	23,318,944.56	3,944,297.89	27,263,242.45
基金赎回款	-25,579,793.93	-4,383,489.66	-29,963,283.59
本期已分配利润	-	-	-

本期末	56,514,249.77	27,515,143.43	84,029,393.20
-----	---------------	---------------	---------------

国泰君安量化选股混合发起 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,625,985.20	1,617,094.23	19,243,079.43
本期期初	17,625,985.20	1,617,094.23	19,243,079.43
本期利润	7,416,653.85	12,116,516.51	19,533,170.36
本期基金份额交易产生的变动数	-5,273,851.48	-3,313,336.10	-8,587,187.58
其中：基金申购款	7,744,259.13	2,127,695.68	9,871,954.81
基金赎回款	-13,018,110.61	-5,441,031.78	-18,459,142.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,768,787.57	10,420,274.64	30,189,062.21

国泰君安量化选股混合发起 D

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	34,056,389.21	3,009,250.56	37,065,639.77
本期期初	34,056,389.21	3,009,250.56	37,065,639.77
本期利润	12,200,751.62	10,326,827.97	22,527,579.59
本期基金份额交易产生的变动数	-10,786,982.36	4,862,273.95	-5,924,708.41
其中：基金申购款	20,009,031.25	7,282,917.80	27,291,949.05
基金赎回款	-30,796,013.61	-2,420,643.85	-33,216,657.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,470,158.47	18,198,352.48	53,668,510.95

6.4.7.9 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	113,995.35
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	20,026.27
结算备付金利息收入	32,265.30
其他	-
合计	166,286.92

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	5,597,477,140.45
减：卖出股票成本总额	5,550,707,170.01
减：交易费用	4,291,548.69
买卖股票差价收入	42,478,421.75

6.4.7.11 衍生工具收益

6.4.7.11.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	-126,535.04
减：交易费用	37,367.85
合计	-163,902.89

6.4.7.12 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	6,536,781.36
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	6,536,781.36

6.4.7.13 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	47,054,796.43
——股票投资	47,054,796.43
——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	435,675.04
——权证投资	-
——期货投资	435,675.04
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	3,853.18
合计	47,486,618.29

6.4.7.14 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	799,599.31
转换费收入	1.85
合计	799,601.16

6.4.7.15 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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	84,302.56

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
中国邮政储蓄银行股份有限公司(以 下简称“中国邮政储蓄银行”)	基金托管人
国泰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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰海通证券	11,023,158,938.04	100.00%	25,717,409,659.49	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	785,899.76	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券	1,858,755.95	100.00%	0.00	0.00%

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

风险基金后的净额列示。

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

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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,608,318.15	9,320,107.50
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,325,940.79	2,631,750.02
应支付基金管理人的净管理费	3,282,377.36	6,688,357.48

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	691,247.77	1,398,016.20

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
--------------	---------------------------------------

名称	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	国泰君安量化 选股混合发起 A	国泰君安量化 选股混合发起 C	国泰君安量化 选股混合发起 D	合计
国泰海通资管直销	-	15,464.11	319,522.85	334,986.96
国泰海通证券	-	164,638.27	-	164,638.27
合计	-	180,102.38	319,522.85	499,625.23
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	国泰君安量化 选股混合发起 A	国泰君安量化 选股混合发起 C	国泰君安量化 选股混合发起 D	合计
国泰海通资管直销	-	64,378.26	818,209.47	882,587.73
国泰海通证券	-	292,891.45	-	292,891.45
合计	-	357,269.71	818,209.47	1,175,479.18

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

$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$
H 为 C/D 类份额每日应计提的销售服务费
E 为 C/D 类份额前一日基金资产净值
销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国泰君安量化选股混合发起 A

份额单位：份

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	10,009,000.00	10,009,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,009,000.00	10,009,000.00
报告期末持有的基金份额占基	2.67%	1.61%

金总份额比例		
--------	--	--

国泰君安量化选股混合发起 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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	5,010,000.00	5,010,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,010,000.00	5,010,000.00
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	3.49%	1.51%

国泰君安量化选股混合发起 D

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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	0.00	35,071,750.28
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	-	7,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	28,071,750.28
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	0.00%	7.67%

注：1. 基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。2. 报告期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 01 月 01 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
中国邮政储蓄银行	22,087,455.06	113,995.35	77,301,965.18	281,581.77

国泰海通证券	47,931,858.19	20,026.27	62,351,339.39	66,966.33
--------	---------------	-----------	---------------	-----------

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金的其他存款由基金结算机构国泰海通证券保管，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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301458	钧崴电子	2025 年 01 月 02 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	10.40	34.11	701	7,290.40	23,911.11	-
301275	汉朔科技	2025 年 03 月 04 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	27.50	56.19	397	10,917.50	22,307.43	-
688583	思看科技	2025 年 01 月 08 日	1-6 个月（含）	科创板打新限售	33.46	79.68	227	5,855.50	18,087.36	-
301678	新恒汇	2025 年 06 月 13 日	1-6 个月（含）	创业板打新限售	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-

		日	)	售						
301602	超研股份	2025 年 01 月 15 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301501	恒鑫生活	2025 年 03 月 11 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	39.92	45.22	349	9,620.72	15,781.78	-
001388	信通电子	2025 年 06 月 24 日	5 个交易日	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 06 月 24 日	1-6 个月 (含)	深交所打新限售	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
301479	弘景光电	2025 年 03 月 06 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	41.90	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
688757	胜科纳米	2025 年 03 月 18 日	1-6 个月 (含)	科创板打新限售	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025 年 01 月 02 日	1-6 个月 (含)	科创板打新限售	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	1-6 个月 (含)	股票流通受限	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
301662	宏工科技	2025 年 04 月 10 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301601	惠通科技	2025 年 01 月 08 日	1-6 个月 (含)	创业板打新限售	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
001356	富岭股份	2025 年 01 月 16 日	1-6 个月 (含)	股票流通受限	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-

		日	)							
301590	优优绿能	2025年05月28日	1-6个月(含)	创业板打新限售	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301665	泰禾股份	2025年04月02日	1-6个月(含)	创业板打新限售	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
001382	新亚电缆	2025年03月13日	1-6个月(含)	股票流通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
603014	威高血净	2025年05月12日	1-6个月(含)	股票流通受限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
301636	泽润新能	2025年04月30日	1-6个月(含)	创业板打新限售	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301595	太力科技	2025年05月12日	1-6个月(含)	创业板打新限售	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301560	众捷汽车	2025年04月17日	1-6个月(含)	创业板打新限售	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
603210	泰鸿万立	2025年04月01日	1-6个月(含)	股票流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603271	永杰新材	2025年03月04日	1-6个月(含)	股票流通受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603124	江南新材	2025年03月12日	1-6个月(含)	股票流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
001390	古麒绒材	2025年05月21日	1-6个月(含)	股票流通受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-

		日	)							
603400	华之杰	2025 年 06 月 12 日	1-6 个月 (含)	股票流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603382	海阳科技	2025 年 06 月 05 日	1-6 个月 (含)	股票流通受限	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603120	肯特催化	2025 年 04 月 09 日	1-6 个月 (含)	股票流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-

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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025-06-30	重大资产重组	38.05	2025-07-11	39.98	9,200	296,277.31	350,060.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金的托管行中国邮政储蓄银行股份有限公司，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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此

本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金、结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	70,019,313.25	-	-	-	70,019,313.25
结算备付金	8,190,999.62	-	-	-	8,190,999.62
存出保证金	1,977,868.80	-	-	-	1,977,868.80
交易性金融 资产	-	-	-	859,966,181.98	859,966,181.98
应收申购款	-	-	-	1,594,936.30	1,594,936.30
资产总计	80,188,181.67	-	-	861,561,118.28	941,749,299.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,658,276.43	5,658,276.43
应付管理人 报酬	-	-	-	727,024.80	727,024.80
应付托管费	-	-	-	109,053.73	109,053.73
应付销售服 务费	-	-	-	134,839.50	134,839.50
应交税费	-	-	-	3,853.18	3,853.18
其他负债	-	-	-	120,583.26	120,583.26
负债总计	-	-	-	6,753,630.90	6,753,630.90
利率敏感度 缺口	80,188,181.67	-	-	854,807,487.38	934,995,669.05
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	112,252,222.74	-	-	-	112,252,222.74
结算备付金	2,938,970.17	-	-	-	2,938,970.17
存出保证金	1,925,860.80	-	-	-	1,925,860.80
交易性金融 资产	-	-	-	936,832,140.23	936,832,140.23
应收申购款	-	-	-	1,444,248.24	1,444,248.24
资产总计	117,117,053.7	-	-	938,276,388.4	1,055,393,442.1

	1			7	8
负债					
应付赎回款	-	-	-	26,424,421.21	26,424,421.21
应付管理人报酬	-	-	-	1,005,065.55	1,005,065.55
应付托管费	-	-	-	150,759.85	150,759.85
应付销售服务费	-	-	-	256,074.47	256,074.47
其他负债	-	-	-	171,649.01	171,649.01
负债总计	-	-	-	28,007,970.09	28,007,970.09
利率敏感度缺口	117,117,053.71	-	-	910,268,418.38	1,027,385,472.09

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	859,966,181.98	91.98	936,832,140.23	91.19
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	859,966,181.98	91.98	936,832,140.23	91.19

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 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 7.4.1)上升 5%	57,310,086.61	65,497,176.62
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-57,310,086.61	-65,497,176.62

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	859,326,858.55	936,290,837.20
第二层次	365,445.54	27,736.50
第三层次	273,877.89	513,566.53
合计	859,966,181.98	936,832,140.23

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	859,966,181.98	91.32
	其中：股票	859,966,181.98	91.32
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	78,210,312.87	8.30
8	其他各项资产	3,572,805.10	0.38
9	合计	941,749,299.95	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	8,149,221.80	0.87
B	采矿业	17,019,496.00	1.82
C	制造业	589,311,906.53	63.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,280,514.00	1.42
E	建筑业	6,503,603.21	0.70
F	批发和零售业	16,442,412.55	1.76
G	交通运输、仓储和邮政业	20,321,238.40	2.17
H	住宿和餐饮业	143,888.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	89,833,679.45	9.61
J	金融业	52,692,371.00	5.64
K	房地产业	2,763,943.00	0.30
L	租赁和商务服务业	2,792,091.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	26,537,641.87	2.84
N	水利、环境和公共设施管理业	2,619,500.00	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	252,500.00	0.03
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	10,321,450.17	1.10
S	综合	980,725.00	0.10
	合计	859,966,181.98	91.98

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	300750	宁德时代	88,400	22,296,248.00	2.38
2	688981	中芯国际	102,302	9,019,967.34	0.96
3	002258	利尔化学	714,200	7,884,768.00	0.84
4	688158	优刻得	275,126	6,223,350.12	0.67
5	301260	格力博	312,616	6,164,787.52	0.66
6	300124	汇川技术	91,300	5,895,241.00	0.63
7	300231	银信科技	474,600	5,842,326.00	0.62
8	688222	成都先导	357,124	5,742,553.92	0.61
9	300059	东方财富	240,900	5,572,017.00	0.60
10	300879	大叶股份	139,200	5,467,776.00	0.58
11	688512	慧智微	489,869	5,344,470.79	0.57
12	688403	汇成股份	503,416	5,230,492.24	0.56
13	300043	星辉娱乐	1,074,100	5,198,644.00	0.56
14	300548	博创科技	76,000	5,074,520.00	0.54
15	688660	电气风电	577,562	5,013,238.16	0.54
16	688079	美迪凯	487,505	4,894,550.20	0.52
17	300602	飞荣达	230,200	4,882,542.00	0.52
18	688334	西高院	279,163	4,796,020.34	0.51
19	300570	太辰光	48,700	4,693,706.00	0.50
20	601398	工商银行	616,900	4,682,271.00	0.50
21	688602	康鹏科技	551,829	4,624,327.02	0.49
22	300320	海达股份	458,700	4,559,478.00	0.49
23	301165	锐捷网络	73,980	4,546,810.80	0.49
24	300308	中际旭创	30,900	4,507,074.00	0.48
25	300739	明阳电路	303,300	4,500,972.00	0.48
26	300489	光智科技	100,000	4,416,000.00	0.47
27	300102	乾照光电	374,700	4,335,279.00	0.46
28	300558	贝达药业	74,800	4,334,660.00	0.46
29	688183	生益电子	84,339	4,318,156.80	0.46
30	301526	国际复材	1,184,900	4,313,036.00	0.46
31	688469	芯联集成	898,795	4,287,252.15	0.46

32	688275	万润新能	103,888	4,212,658.40	0.45
33	601857	中国石油	491,800	4,204,890.00	0.45
34	300473	德尔股份	129,100	4,202,205.00	0.45
35	300224	正海磁材	292,000	4,131,800.00	0.44
36	601818	光大银行	985,900	4,091,485.00	0.44
37	300393	中来股份	692,900	3,991,104.00	0.43
38	300358	楚天科技	492,400	3,840,720.00	0.41
39	688518	联赢激光	185,996	3,792,458.44	0.41
40	601997	贵阳银行	606,800	3,786,432.00	0.40
41	300476	胜宏科技	28,000	3,762,640.00	0.40
42	688343	云天励飞	74,831	3,698,148.02	0.40
43	300299	富春股份	475,600	3,652,608.00	0.39
44	300825	阿尔特	335,200	3,623,512.00	0.39
45	300869	康泰医学	252,600	3,622,284.00	0.39
46	688595	芯海科技	94,904	3,548,460.56	0.38
47	300026	红日药业	945,200	3,487,788.00	0.37
48	002414	高德红外	339,200	3,476,800.00	0.37
49	688008	澜起科技	41,465	3,400,130.00	0.36
50	688685	迈信林	60,007	3,351,390.95	0.36
51	300768	迪普科技	194,600	3,337,390.00	0.36
52	300206	理邦仪器	269,400	3,238,188.00	0.35
53	300830	金现代	341,200	3,115,156.00	0.33
54	301230	泓博医药	88,700	3,053,054.00	0.33
55	300185	通裕重工	1,062,100	3,037,606.00	0.32
56	002151	北斗星通	105,600	3,029,664.00	0.32
57	301509	金凯生科	79,600	3,008,084.00	0.32
58	600267	海正药业	321,400	2,972,950.00	0.32
59	300709	精研科技	76,100	2,971,705.00	0.32
60	601077	渝农商行	410,800	2,933,112.00	0.31
61	300498	温氏股份	171,600	2,930,928.00	0.31
62	300039	上海凯宝	477,978	2,896,546.68	0.31
63	300579	数字认证	83,200	2,871,232.00	0.31
64	688552	航天南湖	71,141	2,839,237.31	0.30
65	688365	光云科技	185,217	2,819,002.74	0.30
66	300562	乐心医疗	191,100	2,818,725.00	0.30
67	601101	昊华能源	389,100	2,817,084.00	0.30
68	300221	银禧科技	339,200	2,815,360.00	0.30
69	002249	大洋电机	427,200	2,810,976.00	0.30
70	688661	和林微纳	70,352	2,797,899.04	0.30
71	600619	海立股份	245,000	2,795,450.00	0.30
72	601009	南京银行	239,600	2,784,152.00	0.30
73	300014	亿纬锂能	60,500	2,771,505.00	0.30
74	601225	陕西煤业	143,200	2,755,168.00	0.29

75	600016	民生银行	579,500	2,752,625.00	0.29
76	600019	宝钢股份	416,400	2,744,076.00	0.29
77	600268	国电南自	350,200	2,738,564.00	0.29
78	688499	利元亨	65,638	2,731,197.18	0.29
79	688201	信安世纪	209,200	2,709,140.00	0.29
80	688249	晶合集成	133,315	2,702,295.05	0.29
81	688141	杰华特	82,536	2,689,022.88	0.29
82	688280	精进电动	365,866	2,659,845.82	0.28
83	688388	嘉元科技	132,142	2,653,411.36	0.28
84	300746	汉嘉设计	167,600	2,626,292.00	0.28
85	301281	科源制药	80,800	2,616,304.00	0.28
86	601298	青岛港	300,600	2,612,214.00	0.28
87	601169	北京银行	382,400	2,611,792.00	0.28
88	688716	中研股份	72,565	2,583,314.00	0.28
89	600410	华胜天成	267,700	2,567,243.00	0.27
90	600717	天津港	557,000	2,539,920.00	0.27
91	301248	杰创智能	101,800	2,532,784.00	0.27
92	002786	银宝山新	273,200	2,518,904.00	0.27
93	300274	阳光电源	36,700	2,487,159.00	0.27
94	300420	五洋自控	720,100	2,477,144.00	0.26
95	688590	新致软件	120,284	2,470,633.36	0.26
96	688347	华虹公司	44,800	2,459,968.00	0.26
97	300232	洲明科技	336,900	2,439,156.00	0.26
98	603189	网达软件	140,300	2,437,011.00	0.26
99	600011	华能国际	339,900	2,426,886.00	0.26
100	301318	维海德	71,580	2,422,267.20	0.26
101	603687	大胜达	323,500	2,403,605.00	0.26
102	301282	金禄电子	96,600	2,394,714.00	0.26
103	601186	中国铁建	298,600	2,391,786.00	0.26
104	601898	中煤能源	217,600	2,380,544.00	0.25
105	300967	晓鸣股份	127,300	2,355,050.00	0.25
106	600703	三安光电	188,500	2,341,170.00	0.25
107	600106	重庆路桥	380,200	2,330,626.00	0.25
108	688128	中国电研	94,860	2,324,070.00	0.25
109	002349	精华制药	322,100	2,315,899.00	0.25
110	688505	复旦张江	262,800	2,275,848.00	0.24
111	300424	航新科技	128,900	2,232,548.00	0.24
112	300502	新易盛	17,400	2,210,148.00	0.24
113	000919	金陵药业	323,200	2,200,992.00	0.24
114	000501	武商集团	252,200	2,184,052.00	0.23
115	300760	迈瑞医疗	9,700	2,180,075.00	0.23
116	301055	张小泉	103,200	2,175,456.00	0.23
117	300458	全志科技	54,700	2,171,043.00	0.23

118	000063	中兴通讯	66,600	2,163,834.00	0.23
119	301558	三态股份	235,300	2,120,053.00	0.23
120	300017	网宿科技	196,600	2,107,552.00	0.23
121	300871	回盛生物	99,500	2,079,550.00	0.22
122	301183	东田微	40,400	2,069,692.00	0.22
123	002174	游族网络	170,000	2,062,100.00	0.22
124	300456	赛微电子	119,100	2,047,329.00	0.22
125	688584	上海合晶	113,237	2,024,677.56	0.22
126	600736	苏州高新	377,400	2,019,090.00	0.22
127	600521	华海药业	108,300	2,017,629.00	0.22
128	688256	寒武纪	3,343	2,010,814.50	0.22
129	600188	兖矿能源	164,800	2,005,616.00	0.21
130	300788	中信出版	62,100	1,992,168.00	0.21
131	601018	宁波港	538,500	1,970,910.00	0.21
132	688209	英集芯	105,919	1,956,323.93	0.21
133	300900	广联航空	80,300	1,948,881.00	0.21
134	300241	瑞丰光电	341,800	1,948,260.00	0.21
135	300009	安科生物	232,100	1,942,677.00	0.21
136	600460	士兰微	78,200	1,940,924.00	0.21
137	000726	鲁泰 A	305,900	1,939,406.00	0.21
138	600004	白云机场	210,100	1,911,910.00	0.20
139	300400	劲拓股份	113,400	1,909,656.00	0.20
140	002491	通鼎互联	331,100	1,880,648.00	0.20
141	601988	中国银行	333,200	1,872,584.00	0.20
142	301205	联特科技	19,500	1,869,270.00	0.20
143	300702	天宇股份	80,300	1,867,778.00	0.20
144	601107	四川成渝	309,500	1,863,190.00	0.20
145	300257	开山股份	184,800	1,860,936.00	0.20
146	688523	航天环宇	85,877	1,847,214.27	0.20
147	600959	江苏有线	535,100	1,840,744.00	0.20
148	688181	八亿时空	58,458	1,819,212.96	0.19
149	300041	回天新材	192,400	1,812,408.00	0.19
150	000725	京东方 A	452,500	1,805,475.00	0.19
151	600396	华电辽能	612,000	1,805,400.00	0.19
152	688233	神工股份	56,824	1,805,298.48	0.19
153	002107	沃华医药	314,900	1,801,228.00	0.19
154	600742	富维股份	188,200	1,789,782.00	0.19
155	002455	百川股份	238,400	1,783,232.00	0.19
156	300148	天舟文化	350,400	1,773,024.00	0.19
157	600628	新世界	240,900	1,763,388.00	0.19
158	688321	微芯生物	72,652	1,727,664.56	0.18
159	600015	华夏银行	218,000	1,724,380.00	0.18
160	688588	凌志软件	118,336	1,724,155.52	0.18

161	002783	凯龙股份	198,000	1,708,740.00	0.18
162	300803	指南针	21,100	1,701,926.00	0.18
163	688373	盟科药业	269,310	1,688,573.70	0.18
164	688277	天智航	119,915	1,666,818.50	0.18
165	002378	章源钨业	210,000	1,661,100.00	0.18
166	688179	阿拉丁	129,434	1,646,400.48	0.18
167	300433	蓝思科技	73,568	1,640,566.40	0.18
168	300365	恒华科技	247,000	1,627,730.00	0.17
169	002523	天桥起重	443,700	1,619,505.00	0.17
170	601678	滨化股份	387,300	1,603,422.00	0.17
171	688286	敏芯股份	22,635	1,600,068.15	0.17
172	002303	美盈森	448,700	1,597,372.00	0.17
173	300187	永清环保	312,100	1,591,710.00	0.17
174	688146	中船特气	54,701	1,581,405.91	0.17
175	300510	金冠股份	343,800	1,574,604.00	0.17
176	002686	亿利达	235,600	1,533,756.00	0.16
177	300512	中亚股份	178,200	1,528,956.00	0.16
178	000823	超声电子	129,000	1,528,650.00	0.16
179	002758	浙农股份	170,875	1,525,913.75	0.16
180	000651	格力电器	33,300	1,495,836.00	0.16
181	300696	爱乐达	66,200	1,494,796.00	0.16
182	300539	横河精密	106,900	1,463,461.00	0.16
183	600746	江苏索普	185,600	1,449,536.00	0.16
184	000901	航天科技	116,600	1,449,338.00	0.16
185	301251	威尔高	36,700	1,439,007.00	0.15
186	601229	上海银行	134,900	1,431,289.00	0.15
187	300496	中科创达	25,000	1,430,500.00	0.15
188	600887	伊利股份	51,200	1,427,456.00	0.15
189	002626	金达威	69,700	1,426,062.00	0.15
190	300479	神思电子	64,300	1,419,101.00	0.15
191	301216	万凯新材	113,500	1,415,345.00	0.15
192	600216	浙江医药	94,200	1,393,218.00	0.15
193	300222	科大智能	136,700	1,392,973.00	0.15
194	301221	光庭信息	26,800	1,392,796.00	0.15
195	600812	华北制药	225,200	1,391,736.00	0.15
196	002825	纳尔股份	138,900	1,386,222.00	0.15
197	300425	中建环能	263,900	1,382,836.00	0.15
198	601668	中国建筑	239,300	1,380,761.00	0.15
199	002624	完美世界	90,800	1,377,436.00	0.15
200	300733	西菱动力	77,600	1,375,848.00	0.15
201	002728	特一药业	163,200	1,372,512.00	0.15
202	000009	中国宝安	154,200	1,369,296.00	0.15
203	600819	耀皮玻璃	235,200	1,368,864.00	0.15

204	300434	金石亚药	141,900	1,365,078.00	0.15
205	603386	骏亚科技	107,800	1,363,670.00	0.15
206	600482	中国动力	58,900	1,358,823.00	0.15
207	601116	三江购物	124,400	1,354,716.00	0.14
208	300666	江丰电子	18,200	1,348,620.00	0.14
209	601138	工业富联	62,800	1,342,664.00	0.14
210	688041	海光信息	9,501	1,342,396.29	0.14
211	002004	华邦健康	321,800	1,341,906.00	0.14
212	000021	深科技	71,600	1,341,784.00	0.14
213	301119	正强股份	37,600	1,329,536.00	0.14
214	601600	中国铝业	188,500	1,327,040.00	0.14
215	688131	皓元医药	27,313	1,320,583.55	0.14
216	300382	斯莱克	86,700	1,318,707.00	0.14
217	600699	均胜电子	75,300	1,313,232.00	0.14
218	688033	天宜新材	203,000	1,301,230.00	0.14
219	688202	美迪西	35,516	1,276,089.88	0.14
220	301396	宏景科技	20,500	1,273,255.00	0.14
221	300238	冠昊生物	78,000	1,265,940.00	0.14
222	601326	秦港股份	390,500	1,261,315.00	0.13
223	300170	汉得信息	72,100	1,240,841.00	0.13
224	688176	亚虹医药	139,299	1,235,582.13	0.13
225	002761	浙江建投	139,100	1,233,817.00	0.13
226	688593	新相微	75,467	1,232,376.11	0.13
227	000570	苏常柴 A	212,300	1,229,217.00	0.13
228	002329	皇氏集团	348,600	1,227,072.00	0.13
229	600218	全柴动力	134,800	1,209,156.00	0.13
230	600104	上汽集团	75,000	1,203,750.00	0.13
231	300066	三川智慧	271,600	1,200,472.00	0.13
232	600305	恒顺醋业	154,800	1,196,604.00	0.13
233	001965	招商公路	99,500	1,194,000.00	0.13
234	603901	永创智能	112,700	1,187,858.00	0.13
235	688400	凌云光	42,800	1,179,996.00	0.13
236	601628	中国人寿	28,400	1,169,796.00	0.13
237	600582	天地科技	194,400	1,164,456.00	0.12
238	600550	保变电气	135,000	1,161,000.00	0.12
239	601328	交通银行	144,900	1,159,200.00	0.12
240	000930	中粮科技	206,500	1,152,270.00	0.12
241	600269	赣粤高速	227,700	1,152,162.00	0.12
242	688690	纳微科技	50,400	1,150,632.00	0.12
243	300978	东箭科技	103,000	1,149,480.00	0.12
244	601766	中国中车	163,100	1,148,224.00	0.12
245	300088	长信科技	192,500	1,147,300.00	0.12
246	301536	星宸科技	19,000	1,145,700.00	0.12

247	600909	华安证券	195,300	1,138,599.00	0.12
248	688055	龙腾光电	305,900	1,131,830.00	0.12
249	301256	华融化学	106,800	1,131,012.00	0.12
250	601698	中国卫通	55,000	1,125,850.00	0.12
251	601985	中国核电	120,200	1,120,264.00	0.12
252	688220	翱捷科技	14,298	1,119,533.40	0.12
253	688015	交控科技	53,692	1,118,941.28	0.12
254	002293	罗莱生活	128,000	1,118,720.00	0.12
255	002248	华东数控	126,000	1,102,500.00	0.12
256	300160	秀强股份	195,500	1,098,710.00	0.12
257	688488	艾迪药业	77,789	1,077,377.65	0.12
258	002201	九鼎新材	163,640	1,071,842.00	0.11
259	300133	华策影视	142,700	1,071,677.00	0.11
260	601228	广州港	326,800	1,055,564.00	0.11
261	600352	浙江龙盛	103,400	1,050,544.00	0.11
262	000100	TCL 科技	241,700	1,046,561.00	0.11
263	600336	澳柯玛	153,300	1,045,506.00	0.11
264	600479	千金药业	100,200	1,042,080.00	0.11
265	002284	亚太股份	94,100	1,039,805.00	0.11
266	002823	凯中精密	73,600	1,032,608.00	0.11
267	002772	众兴菌业	132,200	1,032,482.00	0.11
268	300407	凯发电气	97,400	1,029,518.00	0.11
269	601928	凤凰传媒	92,101	1,028,768.17	0.11
270	300380	安硕信息	20,600	1,026,704.00	0.11
271	601989	中国重工	220,400	1,022,656.00	0.11
272	688018	乐鑫科技	6,867	1,003,268.70	0.11
273	300582	英飞特	77,100	988,422.00	0.11
274	600519	贵州茅台	700	986,664.00	0.11
275	600389	江山股份	52,535	977,151.00	0.10
276	002228	合兴包装	276,800	977,104.00	0.10
277	601963	重庆银行	89,200	968,712.00	0.10
278	002912	中新赛克	40,500	965,925.00	0.10
279	600035	楚天高速	226,300	959,512.00	0.10
280	002829	星网宇达	43,900	957,898.00	0.10
281	300421	力星股份	63,400	949,732.00	0.10
282	688221	前沿生物	94,270	946,470.80	0.10
283	600299	安迪苏	97,400	939,910.00	0.10
284	601860	紫金银行	309,500	928,500.00	0.10
285	600795	国电电力	191,800	928,312.00	0.10
286	300891	惠云钛业	96,400	927,368.00	0.10
287	002350	北京科锐	134,600	923,356.00	0.10
288	688428	诺诚健华	37,739	921,963.77	0.10
289	601991	大唐发电	289,200	916,764.00	0.10

290	600601	方正科技	167,600	894,984.00	0.10
291	000878	云南铜业	70,300	894,216.00	0.10
292	600295	鄂尔多斯	102,300	891,033.00	0.10
293	600873	梅花生物	83,300	890,477.00	0.10
294	603779	威龙股份	119,500	887,885.00	0.09
295	600805	悦达投资	177,100	878,416.00	0.09
296	000166	申万宏源	173,600	871,472.00	0.09
297	688636	智明达	25,549	863,300.71	0.09
298	600997	开滦股份	146,300	861,707.00	0.09
299	000019	深粮控股	129,100	859,806.00	0.09
300	601665	齐鲁银行	134,100	847,512.00	0.09
301	600704	物产中大	160,800	847,416.00	0.09
302	300828	锐新科技	51,000	843,030.00	0.09
303	600774	汉商集团	98,600	836,128.00	0.09
304	600621	华鑫股份	54,000	826,740.00	0.09
305	601811	新华文轩	56,700	826,119.00	0.09
306	000936	华西股份	119,700	823,536.00	0.09
307	001219	青岛食品	60,400	822,648.00	0.09
308	300620	光库科技	17,200	810,292.00	0.09
309	300048	合康新能	137,820	809,003.40	0.09
310	688111	金山办公	2,871	804,023.55	0.09
311	600635	大众公用	203,500	793,650.00	0.08
312	600354	敦煌种业	128,100	792,939.00	0.08
313	601019	山东出版	83,700	792,639.00	0.08
314	301112	信邦智能	21,800	791,340.00	0.08
315	601566	九牧王	92,500	789,950.00	0.08
316	603682	锦和商管	139,000	788,130.00	0.08
317	300146	汤臣倍健	69,700	783,428.00	0.08
318	600320	振华重工	178,600	780,482.00	0.08
319	600273	嘉化能源	91,600	774,936.00	0.08
320	002881	美格智能	16,700	774,880.00	0.08
321	003816	中国广核	212,700	774,228.00	0.08
322	601669	中国电建	158,400	771,408.00	0.08
323	301289	国缆检测	15,800	771,040.00	0.08
324	601899	紫金矿业	39,500	770,250.00	0.08
325	000531	穗恒运 A	123,900	761,985.00	0.08
326	301199	迈赫股份	29,660	756,923.20	0.08
327	300699	光威复材	23,900	756,913.00	0.08
328	301069	凯盛新材	46,300	745,893.00	0.08
329	000705	浙江震元	88,000	743,600.00	0.08
330	300735	光弘科技	29,600	742,960.00	0.08
331	688022	瀚川智能	49,958	740,377.56	0.08
332	301270	汉仪股份	15,500	738,730.00	0.08

333	301380	挖金客	20,100	737,268.00	0.08
334	300341	麦克奥迪	45,200	731,336.00	0.08
335	000001	平安银行	60,400	729,028.00	0.08
336	688579	山大地纬	64,900	726,231.00	0.08
337	603013	亚普股份	42,000	725,760.00	0.08
338	688582	芯动联科	10,800	725,760.00	0.08
339	603270	金帝股份	28,200	724,458.00	0.08
340	300306	远方信息	56,000	723,520.00	0.08
341	688380	中微半导	26,552	719,559.20	0.08
342	688553	汇宇制药	44,074	717,965.46	0.08
343	603118	共进股份	63,400	714,518.00	0.08
344	600098	广州发展	114,300	714,375.00	0.08
345	600918	中泰证券	110,900	713,087.00	0.08
346	002403	爱仕达	50,500	708,010.00	0.08
347	688418	震有科技	26,700	706,482.00	0.08
348	300484	蓝海华腾	31,400	702,418.00	0.08
349	601002	晋亿实业	141,900	699,567.00	0.07
350	601126	四方股份	42,600	693,102.00	0.07
351	000783	长江证券	99,800	691,614.00	0.07
352	603396	金辰股份	26,800	683,400.00	0.07
353	688180	君实生物	19,910	676,541.80	0.07
354	300964	本川智能	16,200	676,026.00	0.07
355	301036	双乐股份	18,000	673,560.00	0.07
356	301025	读客文化	61,000	671,000.00	0.07
357	001379	腾达科技	32,200	667,184.00	0.07
358	300817	双飞集团	28,100	664,284.00	0.07
359	600050	中国联通	122,000	651,480.00	0.07
360	600105	永鼎股份	80,500	651,245.00	0.07
361	300538	同益股份	40,700	643,874.00	0.07
362	301316	慧博云通	14,900	641,892.00	0.07
363	300624	万兴科技	10,300	639,115.00	0.07
364	002815	崇达技术	56,100	635,613.00	0.07
365	300994	久祺股份	40,600	634,984.00	0.07
366	003022	联泓新科	39,900	631,617.00	0.07
367	301017	漱玉平民	49,200	631,236.00	0.07
368	600613	神奇制药	97,100	627,266.00	0.07
369	002576	通达动力	38,100	626,745.00	0.07
370	300509	新美星	72,500	620,600.00	0.07
371	300353	东土科技	29,000	619,150.00	0.07
372	301507	民生健康	42,500	616,675.00	0.07
373	603278	大业股份	67,300	612,430.00	0.07
374	300805	电声股份	55,600	611,600.00	0.07
375	600007	中国国贸	29,700	611,226.00	0.07

376	301518	长华化学	28,200	609,966.00	0.07
377	002725	跃岭股份	46,000	606,280.00	0.06
378	603858	步长制药	37,300	605,752.00	0.06
379	301226	祥明智能	22,100	605,098.00	0.06
380	688668	鼎通科技	9,586	598,741.56	0.06
381	600282	南钢股份	141,900	595,980.00	0.06
382	000900	现代投资	139,550	590,296.50	0.06
383	688502	茂莱光学	2,046	588,552.36	0.06
384	600685	中船防务	21,600	587,304.00	0.06
385	600517	国网英大	113,900	580,890.00	0.06
386	002660	茂硕电源	61,400	577,160.00	0.06
387	300850	新强联	16,100	576,702.00	0.06
388	603101	汇嘉时代	76,100	570,750.00	0.06
389	300684	中石科技	23,900	570,732.00	0.06
390	603168	莎普爱思	77,200	570,508.00	0.06
391	002661	克明食品	56,700	567,567.00	0.06
392	002885	京泉华	40,100	567,415.00	0.06
393	301076	新瀚新材	16,300	566,914.00	0.06
394	002561	徐家汇	66,900	565,305.00	0.06
395	600928	西安银行	143,900	564,088.00	0.06
396	300968	格林精密	38,500	562,870.00	0.06
397	002913	奥士康	19,100	561,731.00	0.06
398	600189	泉阳泉	77,200	558,928.00	0.06
399	000513	丽珠集团	15,500	558,620.00	0.06
400	002233	塔牌集团	75,200	556,480.00	0.06
401	002666	德联集团	109,300	556,337.00	0.06
402	600875	东方电气	32,900	550,746.00	0.06
403	002931	锋龙股份	34,500	550,275.00	0.06
404	002953	日丰股份	52,900	549,102.00	0.06
405	300399	天利科技	15,000	549,000.00	0.06
406	003025	思进智能	40,440	547,557.60	0.06
407	688090	瑞松科技	15,887	546,353.93	0.06
408	000990	诚志股份	72,195	545,794.20	0.06
409	603083	剑桥科技	11,500	543,950.00	0.06
410	601288	农业银行	92,300	542,724.00	0.06
411	300153	科泰电源	16,000	541,600.00	0.06
412	688425	铁建重工	132,500	540,600.00	0.06
413	600719	大连热电	83,000	537,840.00	0.06
414	605218	伟时电子	24,000	537,120.00	0.06
415	301365	矩阵股份	31,300	536,482.00	0.06
416	300550	和仁科技	39,300	534,087.00	0.06
417	000937	冀中能源	92,500	531,875.00	0.06
418	688031	星环科技	11,344	528,970.72	0.06

419	300821	东岳硅材	67,000	526,620.00	0.06
420	600757	长江传媒	56,600	525,248.00	0.06
421	002908	德生科技	51,300	519,669.00	0.06
422	002695	煌上煌	54,700	514,180.00	0.05
423	688351	微电生理	26,069	513,559.30	0.05
424	300418	昆仑万维	15,100	507,813.00	0.05
425	000045	深纺织 A	45,400	503,486.00	0.05
426	002787	华源控股	61,600	503,272.00	0.05
427	300824	北鼎股份	42,100	502,253.00	0.05
428	600662	外服控股	98,200	501,802.00	0.05
429	002863	今飞凯达	98,200	497,874.00	0.05
430	600989	宝丰能源	30,700	495,498.00	0.05
431	001319	铭科精技	18,900	494,802.00	0.05
432	000058	深赛格	59,000	490,290.00	0.05
433	002593	日上集团	100,300	488,461.00	0.05
434	002835	同为股份	26,000	488,020.00	0.05
435	688443	智翔金泰	17,582	487,724.68	0.05
436	603639	海利尔	34,700	487,535.00	0.05
437	300902	国安达	25,900	487,438.00	0.05
438	002267	陕天然气	64,300	486,751.00	0.05
439	300314	戴维医疗	38,300	486,410.00	0.05
440	688382	益方生物	14,700	482,454.00	0.05
441	603116	红蜻蜓	82,000	482,160.00	0.05
442	603881	数据港	18,800	480,340.00	0.05
443	603511	爱慕股份	31,200	480,168.00	0.05
444	000789	万年青	87,100	475,566.00	0.05
445	300643	万通智控	22,200	474,636.00	0.05
446	000977	浪潮信息	9,300	473,184.00	0.05
447	301238	瑞泰新材	24,500	470,890.00	0.05
448	600062	华润双鹤	25,200	470,232.00	0.05
449	002722	物产金轮	28,700	461,783.00	0.05
450	002419	天虹股份	85,800	459,888.00	0.05
451	688387	信科移动	81,332	459,525.80	0.05
452	601231	环旭电子	31,200	456,456.00	0.05
453	301149	隆华新材	39,800	455,312.00	0.05
454	002386	天原股份	91,500	453,840.00	0.05
455	300703	创源股份	21,300	450,708.00	0.05
456	002340	格林美	69,800	443,230.00	0.05
457	300154	瑞凌股份	49,200	442,800.00	0.05
458	002454	松芝股份	56,400	435,408.00	0.05
459	600315	上海家化	20,600	434,042.00	0.05
460	600071	凤凰光学	20,000	427,200.00	0.05
461	600721	百花医药	57,500	418,025.00	0.04

462	301161	唯万密封	18,400	417,496.00	0.04
463	002275	桂林三金	29,000	414,990.00	0.04
464	300690	双一科技	17,100	413,991.00	0.04
465	300556	丝路视觉	20,800	413,296.00	0.04
466	002083	孚日股份	85,000	410,550.00	0.04
467	600839	四川长虹	42,100	409,212.00	0.04
468	603095	越剑智能	24,840	408,121.20	0.04
469	300351	永贵电器	25,600	407,552.00	0.04
470	603267	鸿远电子	8,100	407,187.00	0.04
471	301489	思泉新材	7,080	407,029.20	0.04
472	002562	兄弟科技	83,100	405,528.00	0.04
473	601318	中国平安	7,300	405,004.00	0.04
474	600391	航发科技	13,700	400,040.00	0.04
475	002669	康达新材	34,400	399,040.00	0.04
476	600027	华电国际	72,500	396,575.00	0.04
477	301348	蓝箭电子	16,800	395,304.00	0.04
478	600961	株冶集团	35,300	394,654.00	0.04
479	300691	联合光电	20,600	394,490.00	0.04
480	002434	万里扬	53,800	394,354.00	0.04
481	603500	祥和实业	42,900	392,964.00	0.04
482	301387	光大同创	10,100	392,890.00	0.04
483	688665	四方光电	8,784	392,820.48	0.04
484	300079	数码视讯	66,900	391,365.00	0.04
485	300563	神宇股份	9,600	389,376.00	0.04
486	300054	鼎龙股份	13,500	387,180.00	0.04
487	601995	中金公司	10,900	385,424.00	0.04
488	300608	思特奇	33,100	385,284.00	0.04
489	600557	康缘药业	25,800	381,324.00	0.04
490	603199	九华旅游	10,500	380,520.00	0.04
491	301258	富士莱	12,600	380,394.00	0.04
492	301041	金百泽	14,800	380,360.00	0.04
493	002202	金风科技	37,100	380,275.00	0.04
494	002655	共达电声	29,300	379,728.00	0.04
495	600985	淮北矿业	33,100	375,354.00	0.04
496	600897	厦门空港	25,700	374,963.00	0.04
497	301001	凯淳股份	11,800	374,414.00	0.04
498	601519	大智慧	36,200	368,878.00	0.04
499	600585	海螺水泥	17,100	367,137.00	0.04
500	603520	司太立	37,400	366,520.00	0.04
501	301087	可孚医疗	11,000	365,200.00	0.04
502	600987	航民股份	51,600	364,812.00	0.04
503	601595	上海电影	12,300	364,572.00	0.04
504	600941	中国移动	3,200	360,160.00	0.04

505	601390	中国中铁	63,200	354,552.00	0.04
506	600036	招商银行	7,700	353,815.00	0.04
507	600594	益佰制药	91,600	352,660.00	0.04
508	300802	矩子科技	18,600	350,424.00	0.04
509	000983	山西焦煤	54,700	350,080.00	0.04
510	688313	仕佳光子	9,200	350,060.00	0.04
511	300549	优德精密	18,900	345,681.00	0.04
512	300247	融捷健康	88,500	345,150.00	0.04
513	002206	海利得	67,400	344,414.00	0.04
514	603160	汇顶科技	4,800	340,944.00	0.04
515	688322	奥比中光	5,739	338,658.39	0.04
516	002290	禾盛新材	10,800	337,500.00	0.04
517	603085	天成自控	29,100	334,941.00	0.04
518	000959	首钢股份	98,200	333,880.00	0.04
519	002339	积成电子	41,900	331,848.00	0.04
520	600488	津药药业	78,600	327,762.00	0.04
521	301063	海锅股份	11,000	327,580.00	0.04
522	002095	生意宝	16,100	326,508.00	0.03
523	301110	青木科技	5,800	324,742.00	0.03
524	002170	芭田股份	31,400	321,850.00	0.03
525	300908	仲景食品	10,600	319,166.00	0.03
526	300598	诚迈科技	7,500	319,125.00	0.03
527	688510	航亚科技	13,175	318,571.50	0.03
528	300559	佳发教育	26,900	317,420.00	0.03
529	300631	久吾高科	12,900	316,824.00	0.03
530	600063	皖维高新	68,900	315,562.00	0.03
531	600741	华域汽车	17,800	314,170.00	0.03
532	300885	海昌新材	22,400	313,824.00	0.03
533	688135	利扬芯片	15,000	310,650.00	0.03
534	000672	上峰水泥	39,300	310,470.00	0.03
535	601939	建设银行	32,800	309,632.00	0.03
536	603586	金麒麟	16,800	307,776.00	0.03
537	000421	南京公用	46,600	306,162.00	0.03
538	600728	佳都科技	56,000	305,200.00	0.03
539	300573	兴齐眼药	5,800	300,382.00	0.03
540	300905	宝丽迪	9,400	300,330.00	0.03
541	300583	赛托生物	17,400	299,976.00	0.03
542	605136	丽人丽妆	27,900	299,925.00	0.03
543	301317	鑫磊股份	9,700	299,148.00	0.03
544	000551	创元科技	23,200	298,120.00	0.03
545	002600	领益智造	34,200	293,778.00	0.03
546	603027	千禾味业	25,300	293,733.00	0.03
547	300230	永利股份	59,800	292,422.00	0.03

548	002698	博实股份	18,800	292,152.00	0.03
549	688381	帝奥微	13,400	290,244.00	0.03
550	000715	中兴商业	50,160	287,416.80	0.03
551	300034	钢研高纳	17,200	286,036.00	0.03
552	003016	欣贺股份	38,000	285,000.00	0.03
553	300279	和晶科技	41,100	284,823.00	0.03
554	300018	中元股份	35,700	283,815.00	0.03
555	000737	北方铜业	26,000	282,360.00	0.03
556	600880	博瑞传播	51,900	277,665.00	0.03
557	300412	迦南科技	54,600	277,368.00	0.03
558	601921	浙版传媒	34,400	277,264.00	0.03
559	600630	龙头股份	33,700	276,340.00	0.03
560	601088	中国神华	6,800	275,672.00	0.03
561	603221	爱丽家居	25,100	275,096.00	0.03
562	300339	润和软件	5,400	274,482.00	0.03
563	300925	法本信息	10,900	274,462.00	0.03
564	300771	智莱科技	21,400	272,422.00	0.03
565	688210	统联精密	11,900	271,320.00	0.03
566	000601	韶能股份	55,600	270,216.00	0.03
567	002026	山东威达	22,000	267,300.00	0.03
568	002054	德美化工	38,500	264,880.00	0.03
569	603739	蔚蓝生物	19,800	263,736.00	0.03
570	300694	蠡湖股份	17,700	263,022.00	0.03
571	000858	五粮液	2,200	261,580.00	0.03
572	600874	创业环保	43,500	259,695.00	0.03
573	002556	辉隆股份	43,600	259,420.00	0.03
574	300214	日科化学	38,200	259,378.00	0.03
575	688208	道通科技	8,466	259,059.60	0.03
576	688396	华润微	5,492	259,002.72	0.03
577	301320	豪江智能	13,400	257,280.00	0.03
578	002479	富春环保	51,300	257,013.00	0.03
579	603312	西典新能	7,000	256,690.00	0.03
580	600458	时代新材	18,700	256,564.00	0.03
581	002100	天康生物	40,900	253,171.00	0.03
582	301298	东利机械	15,300	252,756.00	0.03
583	600237	铜峰电子	34,800	252,300.00	0.03
584	605055	迎丰股份	34,600	252,234.00	0.03
585	002395	双象股份	14,200	251,340.00	0.03
586	002545	东方铁塔	28,200	250,698.00	0.03
587	300606	金太阳	12,700	250,444.00	0.03
588	002849	威星智能	16,000	249,600.00	0.03
589	688108	赛诺医疗	22,100	247,962.00	0.03
590	002448	中原内配	29,300	245,241.00	0.03

591	600668	尖峰集团	17,300	244,795.00	0.03
592	600021	上海电力	27,700	243,483.00	0.03
593	688185	康希诺	4,062	242,217.06	0.03
594	600160	巨化股份	8,400	240,912.00	0.03
595	000812	陕西金叶	50,700	237,783.00	0.03
596	300989	蕾奥规划	13,800	235,566.00	0.03
597	600724	宁波富达	51,600	234,780.00	0.03
598	688585	上纬新材	29,900	232,622.00	0.02
599	300615	欣天科技	17,200	229,964.00	0.02
600	002351	漫步者	17,500	229,600.00	0.02
601	300913	兆龙互连	4,900	229,418.00	0.02
602	603109	神驰机电	8,200	229,108.00	0.02
603	002730	电光科技	13,400	226,594.00	0.02
604	002056	横店东磁	15,800	223,570.00	0.02
605	300654	世纪天鸿	21,000	220,080.00	0.02
606	002396	星网锐捷	9,800	220,010.00	0.02
607	000962	东方钽业	13,400	219,894.00	0.02
608	688711	宏微科技	12,481	219,540.79	0.02
609	002603	以岭药业	15,500	218,550.00	0.02
610	300296	利亚德	35,700	217,770.00	0.02
611	601369	陕鼓动力	24,800	217,496.00	0.02
612	002941	新疆交建	19,500	217,230.00	0.02
613	688062	迈威生物	7,633	215,861.24	0.02
614	300882	万胜智能	12,000	215,280.00	0.02
615	688327	云从科技	15,600	215,124.00	0.02
616	601187	厦门银行	31,600	214,564.00	0.02
617	300140	节能环境	34,600	213,482.00	0.02
618	600598	北大荒	14,700	211,974.00	0.02
619	003015	日久光电	12,300	210,945.00	0.02
620	300616	尚品宅配	16,000	210,720.00	0.02
621	002069	獐子岛	54,300	210,684.00	0.02
622	300101	振芯科技	9,300	210,459.00	0.02
623	002613	北玻股份	56,900	209,961.00	0.02
624	002066	瑞泰科技	17,400	209,148.00	0.02
625	301028	东亚机械	17,000	208,930.00	0.02
626	600540	新赛股份	41,600	208,000.00	0.02
627	002933	新兴装备	5,800	207,176.00	0.02
628	301229	纽泰格	10,800	207,036.00	0.02
629	600398	海澜之家	29,700	206,712.00	0.02
630	603916	苏博特	22,800	206,568.00	0.02
631	600749	西藏旅游	17,400	206,538.00	0.02
632	300251	光线传媒	10,100	204,727.00	0.02
633	301337	亚华电子	7,000	204,470.00	0.02

634	603501	豪威集团	1,600	204,240.00	0.02
635	600359	新农开发	28,200	204,168.00	0.02
636	002876	三利谱	8,100	204,039.00	0.02
637	600838	上海九百	25,100	203,059.00	0.02
638	002982	湘佳股份	13,320	202,996.80	0.02
639	300317	珈伟新能	48,900	202,446.00	0.02
640	300174	元力股份	12,400	202,120.00	0.02
641	603259	药明康德	2,900	201,695.00	0.02
642	003041	真爱美家	7,300	201,553.00	0.02
643	300394	天孚通信	2,500	199,600.00	0.02
644	600288	大恒科技	19,200	197,376.00	0.02
645	300634	彩讯股份	7,200	195,120.00	0.02
646	300235	方直科技	17,700	194,877.00	0.02
647	688379	华光新材	5,622	194,858.52	0.02
648	600596	新安股份	23,900	193,590.00	0.02
649	000425	徐工机械	24,900	193,473.00	0.02
650	603090	宏盛股份	7,900	192,523.00	0.02
651	301062	上海艾录	22,200	191,808.00	0.02
652	301336	趣睡科技	3,400	191,760.00	0.02
653	601577	长沙银行	19,200	190,848.00	0.02
654	601916	浙商银行	56,200	190,518.00	0.02
655	688549	中巨芯	24,422	189,026.28	0.02
656	002407	多氟多	15,440	188,213.60	0.02
657	605001	威奥股份	26,000	186,940.00	0.02
658	603696	安记食品	17,000	186,490.00	0.02
659	600783	鲁信创投	14,900	186,250.00	0.02
660	600558	大西洋	35,800	186,160.00	0.02
661	600597	光明乳业	22,100	185,861.00	0.02
662	603048	浙江黎明	9,400	184,804.00	0.02
663	002861	瀛通通讯	12,000	184,320.00	0.02
664	600196	复星医药	7,300	183,157.00	0.02
665	601788	光大证券	10,100	181,598.00	0.02
666	300223	北京君正	2,600	179,920.00	0.02
667	301313	凡拓数创	7,400	179,820.00	0.02
668	600351	亚宝药业	29,300	177,851.00	0.02
669	002391	长青股份	30,300	177,558.00	0.02
670	688722	同益中	8,273	175,966.71	0.02
671	300628	亿联网络	5,000	173,800.00	0.02
672	002905	金逸影视	18,600	172,608.00	0.02
673	605337	李子园	13,400	171,520.00	0.02
674	300401	花园生物	11,200	170,352.00	0.02
675	603993	洛阳钼业	20,100	169,242.00	0.02
676	600584	长电科技	5,000	168,450.00	0.02

677	002636	金安国纪	17,600	166,848.00	0.02
678	688089	嘉必优	6,600	165,990.00	0.02
679	600028	中国石化	29,400	165,816.00	0.02
680	301171	易点天下	6,200	165,726.00	0.02
681	002926	华西证券	18,500	165,390.00	0.02
682	605258	协和电子	5,300	165,095.00	0.02
683	600755	厦门国贸	26,900	162,745.00	0.02
684	002587	奥拓电子	25,100	161,895.00	0.02
685	002888	惠威科技	8,800	159,632.00	0.02
686	002802	洪汇新材	11,400	159,486.00	0.02
687	600901	江苏金租	26,200	158,772.00	0.02
688	300176	鸿特科技	22,800	158,688.00	0.02
689	300493	润欣科技	7,400	157,398.00	0.02
690	600212	绿能慧充	18,600	156,984.00	0.02
691	601918	新集能源	23,900	154,394.00	0.02
692	002446	盛路通信	20,900	154,242.00	0.02
693	600771	广誉远	7,500	151,200.00	0.02
694	688550	瑞联新材	3,500	150,535.00	0.02
695	600350	山东高速	14,100	150,306.00	0.02
696	002328	新朋股份	25,800	150,156.00	0.02
697	600686	金龙汽车	11,900	147,560.00	0.02
698	002489	浙江永强	40,300	147,498.00	0.02
699	300738	奥飞数据	6,900	144,417.00	0.02
700	002186	全聚德	13,600	143,888.00	0.02
701	603038	华立股份	9,800	143,276.00	0.02
702	002243	力合科创	17,500	142,800.00	0.02
703	688717	艾罗能源	2,622	141,142.26	0.02
704	603329	上海雅仕	12,500	140,625.00	0.02
705	300605	恒锋信息	9,400	140,248.00	0.01
706	603811	诚意药业	15,100	139,373.00	0.01
707	603306	华懋科技	3,200	139,200.00	0.01
708	000576	甘化科工	13,000	136,630.00	0.01
709	601866	中远海发	55,300	136,591.00	0.01
710	002532	天山铝业	16,400	136,284.00	0.01
711	002404	嘉欣丝绸	20,900	135,223.00	0.01
712	002245	蔚蓝锂芯	10,500	134,715.00	0.01
713	002230	科大讯飞	2,800	134,064.00	0.01
714	300939	秋田微	4,400	133,760.00	0.01
715	600730	中国高科	21,200	132,500.00	0.01
716	600865	百大集团	14,700	132,153.00	0.01
717	002286	保龄宝	11,500	130,295.00	0.01
718	002879	长缆科技	8,500	129,540.00	0.01
719	603726	朗迪集团	8,000	129,520.00	0.01

720	300655	晶瑞电材	12,900	129,129.00	0.01
721	603617	君禾股份	17,900	128,343.00	0.01
722	600392	盛和资源	9,700	127,749.00	0.01
723	600499	科达制造	13,000	127,400.00	0.01
724	000779	甘咨询	13,700	126,999.00	0.01
725	300447	全信股份	8,100	126,927.00	0.01
726	002796	世嘉科技	10,700	126,260.00	0.01
727	600283	钱江水利	12,300	125,706.00	0.01
728	300644	南京聚隆	4,700	125,537.00	0.01
729	603456	九洲药业	8,200	124,722.00	0.01
730	300113	顺网科技	6,300	124,488.00	0.01
731	600616	金枫酒业	21,800	123,388.00	0.01
732	002224	三力士	26,900	122,664.00	0.01
733	600262	北方股份	5,300	120,840.00	0.01
734	300192	科德教育	8,000	120,000.00	0.01
735	300800	力合科技	10,800	119,772.00	0.01
736	688147	微导纳米	3,956	119,392.08	0.01
737	688362	甬矽电子	4,000	119,120.00	0.01
738	600690	海尔智家	4,800	118,944.00	0.01
739	000969	安泰科技	9,200	118,496.00	0.01
740	601555	东吴证券	13,500	118,125.00	0.01
741	600908	无锡银行	18,600	117,366.00	0.01
742	002692	远程股份	23,700	117,078.00	0.01
743	002646	天佑德酒	12,400	115,072.00	0.01
744	002777	久远银海	6,300	115,038.00	0.01
745	600906	财达证券	16,700	113,894.00	0.01
746	300508	维宏股份	4,000	113,560.00	0.01
747	002746	仙坛股份	19,200	111,744.00	0.01
748	600963	岳阳林纸	24,800	109,864.00	0.01
749	301136	招标股份	8,700	108,228.00	0.01
750	603011	合锻智能	6,900	107,502.00	0.01
751	002599	盛通股份	12,900	107,457.00	0.01
752	002708	光洋股份	9,700	106,991.00	0.01
753	002037	保利联合	11,700	106,938.00	0.01
754	688244	永信至诚	4,000	105,280.00	0.01
755	002706	良信股份	11,600	103,356.00	0.01
756	000532	华金资本	6,700	102,309.00	0.01
757	688629	华丰科技	1,766	101,015.20	0.01
758	601800	中国交建	11,300	100,457.00	0.01
759	002901	大博医疗	2,700	97,848.00	0.01
760	301335	天元宠物	2,800	97,300.00	0.01
761	002852	道道全	10,100	96,556.00	0.01
762	605006	山东玻纤	14,300	96,096.00	0.01

763	002803	吉宏股份	6,700	95,542.00	0.01
764	300378	鼎捷数智	2,600	95,160.00	0.01
765	688143	长盈通	2,400	93,600.00	0.01
766	002238	天威视讯	10,600	93,386.00	0.01
767	301511	德福科技	4,500	93,150.00	0.01
768	300664	鹏鹞环保	16,800	92,064.00	0.01
769	600578	京能电力	20,500	92,045.00	0.01
770	603237	五芳斋	5,500	91,905.00	0.01
771	603229	奥翔药业	10,500	91,560.00	0.01
772	301329	信音电子	4,700	91,556.00	0.01
773	600660	福耀玻璃	1,600	91,216.00	0.01
774	301339	通行宝	5,300	90,789.00	0.01
775	000978	桂林旅游	14,600	89,498.00	0.01
776	600377	宁沪高速	5,800	88,972.00	0.01
777	600388	龙净环保	7,400	88,800.00	0.01
778	002281	光迅科技	1,800	88,776.00	0.01
779	002916	深南电路	820	88,404.20	0.01
780	002782	可立克	6,800	88,264.00	0.01
781	002701	奥瑞金	14,800	88,060.00	0.01
782	600096	云天化	4,000	87,880.00	0.01
783	603004	鼎龙科技	4,000	87,560.00	0.01
784	688733	壹石通	4,568	86,517.92	0.01
785	688360	德马科技	4,649	86,238.95	0.01
786	603607	京华激光	3,500	86,135.00	0.01
787	300258	精锻科技	6,200	85,684.00	0.01
788	600919	江苏银行	7,100	84,774.00	0.01
789	301330	熵基科技	3,100	83,793.00	0.01
790	600785	新华百货	7,100	83,283.00	0.01
791	301486	致尚科技	1,200	82,884.00	0.01
792	002616	长青集团	13,900	82,566.00	0.01
793	000153	丰原药业	13,300	82,061.00	0.01
794	600153	建发股份	7,900	81,923.00	0.01
795	002019	亿帆医药	6,300	81,837.00	0.01
796	600825	新华传媒	12,000	81,600.00	0.01
797	300488	恒锋工具	2,500	81,550.00	0.01
798	002952	亚世光电	3,600	81,288.00	0.01
799	301066	万事利	5,200	81,016.00	0.01
800	301208	中亦科技	1,800	78,804.00	0.01
801	300184	力源信息	7,900	77,578.00	0.01
802	002903	宇环数控	3,900	76,401.00	0.01
803	605255	天普股份	3,900	76,284.00	0.01
804	301135	瑞德智能	2,800	74,844.00	0.01
805	600682	南京新百	11,000	73,920.00	0.01

806	000429	粤高速 A	5,500	73,315.00	0.01
807	688662	富信科技	2,000	72,900.00	0.01
808	000803	山高环能	11,800	72,688.00	0.01
809	603296	华勤技术	900	72,612.00	0.01
810	002625	光启技术	1,800	71,964.00	0.01
811	002090	金智科技	7,500	71,850.00	0.01
812	301299	卓创资讯	1,100	69,949.00	0.01
813	000573	粤宏远 A	17,100	68,742.00	0.01
814	300772	运达股份	5,300	68,264.00	0.01
815	002080	中材科技	3,500	68,250.00	0.01
816	301175	中科环保	13,200	68,244.00	0.01
817	300796	贝斯美	6,600	68,046.00	0.01
818	300770	新媒股份	1,700	67,983.00	0.01
819	603070	万控智造	5,100	67,779.00	0.01
820	300918	南山智尚	3,400	65,382.00	0.01
821	300292	吴通控股	13,300	64,771.00	0.01
822	000419	通程控股	11,200	63,728.00	0.01
823	002853	皮阿诺	4,500	61,695.00	0.01
824	300504	天邑股份	3,900	61,542.00	0.01
825	300395	菲利华	1,200	61,320.00	0.01
826	688252	天德钰	2,500	60,950.00	0.01
827	603890	春秋电子	5,200	60,320.00	0.01
828	002970	锐明技术	1,200	59,280.00	0.01
829	002611	东方精工	4,900	59,094.00	0.01
830	603211	晋拓股份	3,200	58,848.00	0.01
831	000935	四川双马	3,200	58,304.00	0.01
832	601615	明阳智能	5,000	57,450.00	0.01
833	002807	江阴银行	11,900	56,525.00	0.01
834	002241	歌尔股份	2,400	55,968.00	0.01
835	300357	我武生物	2,700	55,728.00	0.01
836	002820	桂发祥	4,800	55,632.00	0.01
837	600020	中原高速	11,605	55,471.90	0.01
838	688288	鸿泉物联	1,900	55,119.00	0.01
839	300035	中科电气	3,200	54,016.00	0.01
840	300982	苏文电能	2,979	53,592.21	0.01
841	301517	陕西华达	1,300	52,897.00	0.01
842	601339	百隆东方	11,200	52,864.00	0.01
843	001314	亿道信息	1,100	51,975.00	0.01
844	603421	鼎信通讯	7,700	51,821.00	0.01
845	002021	中捷资源	22,100	51,051.00	0.01
846	300623	捷捷微电	1,700	50,660.00	0.01
847	002442	龙星科技	7,900	50,402.00	0.01
848	301361	众智科技	1,600	48,848.00	0.01

849	002864	盘龙药业	1,700	48,059.00	0.01
850	600338	西藏珠峰	4,300	47,687.00	0.01
851	000957	中通客车	4,300	46,999.00	0.01
852	688182	灿勤科技	1,700	46,852.00	0.01
853	600965	福成股份	9,400	46,248.00	0.00
854	600983	惠而浦	4,410	45,775.80	0.00
855	600118	中国卫星	1,600	45,712.00	0.00
856	301408	华人健康	3,000	45,630.00	0.00
857	688558	国盛智科	1,800	45,432.00	0.00
858	301168	通灵股份	1,300	45,383.00	0.00
859	002204	大连重工	7,600	45,372.00	0.00
860	300195	长荣股份	6,200	44,082.00	0.00
861	002643	万润股份	3,700	42,587.00	0.00
862	300672	国科微	500	42,460.00	0.00
863	002739	万达电影	3,700	42,291.00	0.00
864	301211	亨迪药业	2,400	42,144.00	0.00
865	000756	新华制药	2,800	41,776.00	0.00
866	301310	鑫宏业	1,100	40,414.00	0.00
867	300656	民德电子	1,500	40,095.00	0.00
868	688603	天承科技	900	39,780.00	0.00
869	300045	华力创通	2,000	38,180.00	0.00
870	603367	辰欣药业	2,700	37,854.00	0.00
871	300705	九典制药	2,400	37,368.00	0.00
872	600143	金发科技	3,600	37,116.00	0.00
873	600716	凤凰股份	10,000	37,000.00	0.00
874	301202	朗威股份	900	36,990.00	0.00
875	002950	奥美医疗	4,300	36,980.00	0.00
876	600828	茂业商业	9,300	35,898.00	0.00
877	300363	博腾股份	2,100	35,868.00	0.00
878	600689	上海三毛	2,900	35,380.00	0.00
879	300381	溢多利	4,600	34,592.00	0.00
880	603053	成都燃气	3,500	33,635.00	0.00
881	002598	山东章鼓	3,000	33,360.00	0.00
882	603528	多伦科技	4,000	33,360.00	0.00
883	603087	甘李药业	600	32,868.00	0.00
884	600100	同方股份	4,300	31,132.00	0.00
885	600176	中国巨石	2,700	30,780.00	0.00
886	002384	东山精密	800	30,216.00	0.00
887	300990	同飞股份	600	29,940.00	0.00
888	603518	锦泓集团	3,000	29,640.00	0.00
889	002681	奋达科技	4,300	29,111.00	0.00
890	601212	白银有色	9,100	28,483.00	0.00
891	688300	联瑞新材	600	27,930.00	0.00

892	000011	深物业 A	3,300	27,885.00	0.00
893	002461	珠江啤酒	2,400	27,096.00	0.00
894	301591	肯特股份	700	26,915.00	0.00
895	600356	恒丰纸业	3,300	26,565.00	0.00
896	300806	斯迪克	1,600	26,400.00	0.00
897	601901	方正证券	3,200	25,312.00	0.00
898	688800	瑞可达	493	24,255.60	0.00
899	688049	炬芯科技	400	24,200.00	0.00
900	301458	钧崴电子	701	23,911.11	0.00
901	001389	广合科技	400	23,508.00	0.00
902	600362	江西铜业	1,000	23,430.00	0.00
903	002487	大金重工	700	23,030.00	0.00
904	301275	汉朔科技	397	22,307.43	0.00
905	000333	美的集团	300	21,660.00	0.00
906	600833	第一医药	1,700	21,590.00	0.00
907	688039	当虹科技	600	19,692.00	0.00
908	688653	康希通信	1,600	19,600.00	0.00
909	688248	南网科技	600	18,876.00	0.00
910	603588	高能环境	3,300	18,612.00	0.00
911	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
912	300816	艾可蓝	500	17,060.00	0.00
913	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
914	600075	新疆天业	3,900	16,497.00	0.00
915	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
916	600780	通宝能源	2,700	16,011.00	0.00
917	301029	怡合达	700	16,002.00	0.00
918	002128	电投能源	800	15,824.00	0.00
919	301501	恒鑫生活	349	15,781.78	0.00
920	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
921	603191	望变电气	1,200	15,144.00	0.00
922	002818	富森美	1,200	14,976.00	0.00
923	000869	张裕 A	700	14,861.00	0.00
924	300777	中简科技	400	14,500.00	0.00
925	601066	中信建投	600	14,430.00	0.00
926	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
927	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.00
928	301156	美农生物	720	13,600.80	0.00
929	605162	新中港	1,800	13,518.00	0.00
930	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
931	002045	国光电器	800	12,768.00	0.00
932	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
933	600449	宁夏建材	900	11,844.00	0.00
934	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00

935	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
936	300491	通合科技	600	11,460.00	0.00
937	688336	三生国健	200	10,848.00	0.00
938	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
939	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
940	300303	聚飞光电	1,600	10,144.00	0.00
941	600429	三元股份	2,200	9,922.00	0.00
942	688238	和元生物	1,600	9,920.00	0.00
943	600626	申达股份	2,700	9,801.00	0.00
944	002079	苏州固锝	1,000	9,750.00	0.00
945	688600	皖仪科技	400	9,400.00	0.00
946	002394	联发股份	1,100	9,053.00	0.00
947	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
948	000738	航发控制	400	8,300.00	0.00
949	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
950	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
951	301020	密封科技	300	6,549.00	0.00
952	688192	迪哲医药	109	6,518.20	0.00
953	002376	新北洋	800	6,216.00	0.00
954	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
955	688302	海创药业	127	5,943.60	0.00
956	601236	红塔证券	700	5,929.00	0.00
957	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
958	001215	千味央厨	200	5,698.00	0.00
959	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
960	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
961	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
962	300729	乐歌股份	300	4,296.00	0.00
963	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
964	688819	天能股份	139	3,858.64	0.00
965	688227	品高股份	107	3,364.08	0.00
966	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
967	688103	国力股份	48	2,920.32	0.00
968	688161	威高骨科	104	2,786.16	0.00
969	688005	容百科技	123	2,745.36	0.00
970	688150	莱特光电	107	2,645.04	0.00
971	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
972	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
973	688458	美芯晟	48	2,263.68	0.00
974	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
975	688698	伟创电气	46	2,171.20	0.00
976	300660	江苏雷利	40	1,769.60	0.00
977	301023	江南奕帆	40	1,746.80	0.00

978	688088	虹软科技	35	1,688.75	0.00
979	688475	萤石网络	48	1,512.96	0.00
980	688652	京仪装备	26	1,490.32	0.00
981	688543	国科军工	21	1,263.99	0.00
982	301617	博苑股份	29	1,190.45	0.00
983	688289	圣湘生物	49	1,003.52	0.00
984	001282	三联锻造	40	814.40	0.00
985	688319	欧林生物	42	657.72	0.00
986	300787	海能实业	40	554.00	0.00
987	688315	诺禾致源	36	508.32	0.00
988	688586	江航装备	38	427.50	0.00
989	688486	龙迅股份	5	334.40	0.00
990	688046	药康生物	21	315.84	0.00
991	301296	新巨丰	26	249.86	0.00
992	688009	中国通号	35	179.90	0.00
993	600459	贵研铂业	11	170.61	0.00
994	688410	山外山	6	85.20	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	300750	宁德时代	34,091,890.16	3.32
2	688280	精进电动	23,148,560.00	2.25
3	688158	优刻得	17,885,518.10	1.74
4	300548	博创科技	17,843,414.00	1.74
5	688981	中芯国际	17,192,773.87	1.67
6	601727	上海电气	16,913,624.28	1.65
7	300489	光智科技	15,587,948.50	1.52
8	000725	京东方 A	15,555,582.00	1.51
9	300570	太辰光	15,394,067.00	1.50

10	600782	新钢股份	15,294,546.00	1.49
11	301165	锐捷网络	14,680,096.70	1.43
12	301260	格力博	14,642,349.64	1.43
13	600050	中国联通	14,021,096.00	1.36
14	688008	澜起科技	13,726,769.09	1.34
15	300033	同花顺	13,413,406.00	1.31
16	688343	云天励飞	13,282,056.18	1.29
17	600619	海立股份	13,229,155.00	1.29
18	688347	华虹公司	13,049,967.28	1.27
19	002258	利尔化学	13,026,707.80	1.27
20	601857	中国石油	12,865,575.00	1.25

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	300750	宁德时代	29,900,432.46	2.91
2	688158	优刻得	20,902,821.43	2.03
3	603986	兆易创新	19,585,287.00	1.91
4	688280	精进电动	19,440,688.40	1.89
5	000725	京东方 A	19,099,622.00	1.86
6	601857	中国石油	18,747,992.00	1.82
7	600050	中国联通	18,372,515.00	1.79

8	601727	上海电气	17,953,805.88	1.75
9	000937	冀中能源	17,740,377.50	1.73
10	601919	中远海控	17,127,330.60	1.67
11	002249	大洋电机	17,120,613.00	1.67
12	600582	天地科技	16,724,706.00	1.63
13	000617	中油资本	16,206,580.00	1.58
14	688981	中芯国际	15,982,473.16	1.56
15	300033	同花顺	15,843,220.00	1.54
16	600782	新钢股份	15,360,238.00	1.50
17	000021	深科技	14,783,290.55	1.44
18	601766	中国中车	14,672,751.00	1.43
19	600015	华夏银行	14,550,599.00	1.42
20	601997	贵阳银行	14,520,669.00	1.41

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,426,786,415.33
卖出股票收入（成交）总额	5,597,477,140.45

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.12 投资组合报告附注

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

本基金持有的前十名证券发行主体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	1,977,868.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,594,936.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,572,805.10

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级 别	持有人 户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
国泰君安量化选股混合发起 A	47,258	7,922.78	198,913,211.03	53.13%	175,501,579.45	46.87%
国泰君安量化选股混	4,099	34,981.00	25,418,212.69	17.73%	117,968,921.38	82.27%

合发起 C						
国泰君安量化选股混合发起 D	111,325	2,239.45	208,744,590.72	83.73%	40,562,187.42	16.27%
合计	162,682	4,715.39	433,076,014.44	56.46%	334,032,688.25	43.54%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国泰君安量化选股混合发起 A	2,812,313.31	0.7511%
	国泰君安量化选股混合发起 C	1,864,879.53	1.3006%
	国泰君安量化选股混合发起 D	802,405.44	0.3219%
	合计	5,479,598.28	0.7143%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国泰君安量化选股混合发起 A	>100
	国泰君安量化选股混合发起 C	>100
	国泰君安量化选股混合发起 D	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安量化选股混合发起 A	10~50
	国泰君安量化选股混合发起 C	>100
	国泰君安量化选股混合发起 D	0
	合计	>100

注：同时为基金管理人高级管理人员（含基金投资和研究部门负责人）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	15,019,000.00	1.96%	15,019,000.00	1.96%	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	1,063,034.77	0.14%	—	—	—
基金经理等人员	1,518,857.14	0.20%	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	2,897,706.37	0.38%	—	—	—
合计	20,498,598.28	2.68%	15,019,000.00	1.96%	—

注：其他为公司普通员工持有份额，持有期限为不低于 6 个月。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安量化选股混合发起 A	国泰君安量化选股混合发起 C	国泰君安量化选股混合发起 D
基金合同生效日（2022 年 08 月 18 日）基金份额总额	10,009,990.10	5,010,000.00	—
本报告期期初基金份额总额	358,709,206.33	201,995,901.44	372,490,479.94
本报告期基金总申购份额	215,235,055.25	70,284,617.92	172,751,562.59
减：本报告期基金总赎回份额	199,529,471.10	128,893,385.29	295,935,264.39
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	374,414,790.48	143,387,134.07	249,306,778.14

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专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票	佣金	占当期佣金	

			成交总额的 比例		总量的比例	
国泰海通证券股份有限公司	2	11,023,158,938.04	100.00%	785,899.76	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	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下部分产品在直销 APP 费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证监会指定网站、公司官网	2025-01-02
2	国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金 2024 年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-01-22
4	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
5	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
6	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
7	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
8	国泰君安量化选股混合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
9	国泰君安量化选股混合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
10	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
11	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	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指	2025-04-26

	变更公告	定网站、公司官网、上交所	
12	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、证监会指定网站、公司官网、上交所	2025-04-30
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
15	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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站
<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