

**国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资  
基金**

**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:中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>6</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	13
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.....	14
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
<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.....	18
6.4 报表附注.....	19
<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.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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 .....	51
<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.....	52
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.....	53
<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>55</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	国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金	
基金简称	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起	
基金主代码	017209	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 11 月 16 日	
基金管理人	上海国泰海通证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	27,704,517.39 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C
下属分级基金的交易代码	017209	017210
报告期末下属分级基金的份额总额	16,605,305.64 份	11,099,211.75 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	本基金主要投资于科技创新相关主题的股票，把握中国创新驱动发展的投资机遇，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将综合考虑宏观与微观经济、市场与政策等因素，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。 本基金的投资策略还包括股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、融资策略。
业绩比较基准	中国战略新兴产业综合指数收益率*90%+中债新综合财富(总值)指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海国泰海通证券资产管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	王小飞
	联系电话	021-38676022	021-60637103
	电子邮箱	zgxxpl@gtht.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95521	021-60637228
传真		021-38871190	021-60635778
注册地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200011	100033
法定代表人		陶耿	张金良

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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	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）	
	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C
本期已实现收益	2,441,129.17	1,092,896.12
本期利润	3,913,242.28	1,438,217.37
加权平均基金份额本期利润	0.1817	0.1294
本期加权平均净值利润率	16.90%	12.11%

本期基金份额净值增长率	13.91%	13.64%
<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	1,991,837.07	1,170,420.34
期末可供分配基金份额利润	0.1200	0.1055
期末基金资产净值	19,314,357.12	12,743,806.17
期末基金份额净值	1.1631	1.1482
<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	16.31%	14.82%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.78%	1.05%	5.55%	0.83%	2.23%	0.22%
过去三个月	6.58%	1.97%	2.09%	1.58%	4.49%	0.39%
过去六个月	13.91%	1.80%	5.11%	1.47%	8.80%	0.33%
过去一年	40.23%	2.28%	27.13%	1.81%	13.10%	0.47%
自基金合同生效起至今	16.31%	1.76%	-0.99%	1.42%	17.30%	0.34%

#### 国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.74%	1.05%	5.55%	0.83%	2.19%	0.22%
过去三个月	6.45%	1.97%	2.09%	1.58%	4.36%	0.39%
过去六个月	13.64%	1.80%	5.11%	1.47%	8.53%	0.33%
过去一年	39.55%	2.28%	27.13%	1.81%	12.42%	0.47%
自基金合同生效起至今	14.82%	1.76%	-0.99%	1.42%	15.81%	0.34%

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

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

(2022年11月16日-2025年06月30日)



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

(2022年11月16日-2025年06月30日)



## § 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）	2022-11-16	-	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。

	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%）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，特别是科创板和创业板的上市公司，具有典型的成长投资风格，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和创业板主流指数的收益。同时，本基金在半导体设备、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，以科创板和创业板为主的新兴产业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，虽然以科创板和创业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)、以科创板和创业板为主的科技类相关公司的营收和利润增速

要高于 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。鉴于近年来市场环境的复杂性，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博弈加剧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技创新精选三个月持有股票发起 A 基金份额净值为 1.1631 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 13.91%，同期业绩比较基准收益率为 5.11%；截至报告期末国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C 基金份额净值为 1.1482 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 13.64%，同期业绩比较基准收益率为 5.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

科技产业是“新质生产力”的核心载体，下半年国内研发投入强度持续提升，叠加“科创板八条”等政策支持，半导体设备、生物医药等领域的技术转化效率将显著提高，直接推动相关企业营收增长（科技类公司利润增速高于 A 股整体）；科创 100 指数上半年上涨 13.54%，领涨主

要指数，反映市场对硬科技的认可，尽管部分板块短期估值较高，但长期来看技术突破与进口替代空间支撑估值中枢上移，持有期设计有助于平滑短期波动；行业层面，AI 模型迭代驱动算力基础设施需求爆发，半导体设备、数据中心等板块景气度持续，生物医药中的创新药研发与医疗器械国产化加速，政策支持下盈利确定性增强，需关注中美科技博弈对高端芯片等领域的阶段性影响。

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金

报告截止日：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	2,443,868.30	3,043,887.06
结算备付金		1,025,549.96	911,858.08
存出保证金		141,991.08	139,304.88
交易性金融资产	6.4.7.2	28,580,031.91	37,595,810.91
其中：股票投资		28,580,031.91	37,595,810.91
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		8,440.36	749.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		32,199,881.61	41,691,610.16
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
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		-	0.00
应付赎回款		63,553.38	60.40
应付管理人报酬		30,424.09	44,083.65
应付托管费		5,070.66	7,347.28
应付销售服务费		5,069.28	4,735.97
应付投资顾问费		-	-
应交税费		277.93	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	37,322.98	25,000.22
负债合计		141,718.32	81,227.52
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	27,704,517.39	40,861,048.48
未分配利润	6.4.7.8	4,353,645.90	749,334.16

净资产合计		32,058,163.29	41,610,382.64
负债和净资产总计		32,199,881.61	41,691,610.16

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 27,704,517.39 份。其中国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A 基金份额净值 1.1631 元，基金份额总额 16,605,305.64 份；国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C 基金份额净值 1.1482 元，基金份额总额 11,099,211.75 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金

本报告期：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
<b>一、营业总收入</b>		5,663,497.69	-14,324,042.94
1. 利息收入		9,515.18	13,260.27
其中：存款利息收入	6.4.7.9	9,513.64	13,260.27
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		1.54	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,833,705.50	-12,158,920.48
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,714,924.09	-12,632,352.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.11	4,383.00	156,287.24
股利收益	6.4.7.12	114,398.41	317,145.08

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	1,817,434.36	-2,183,804.17
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	2,842.65	5,421.44
<b>减：二、营业总支出</b>		312,038.04	654,811.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	209,526.94	451,668.91
2. 托管费	6.4.10.2.2	34,921.09	75,278.09
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	29,302.94	71,220.69
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		174.28	909.72
8. 其他费用	6.4.7.15	38,112.79	55,734.08
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		5,351,459.65	-14,978,854.43
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		5,351,459.65	-14,978,854.43
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		5,351,459.65	-14,978,854.43

### 6.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金

本报告期：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	40,861,048.48	749,334.16	41,610,382.64
二、本期期初净资产	40,861,048.48	749,334.16	41,610,382.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-13,156,531.09	3,604,311.74	-9,552,219.35
（一）、综合收益总额	-	5,351,459.65	5,351,459.65
（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）	-13,156,531.09	-1,747,147.91	-14,903,679.00
其中：1. 基金申购款	2,955,713.86	306,269.36	3,261,983.22
2. 基金赎回款	-16,112,244.95	-2,053,417.27	-18,165,662.22
（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	27,704,517.39	4,353,645.90	32,058,163.29
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	90,916,464.97	-2,420,129.48	88,496,335.49
二、本期期初净资产	90,916,464.97	-2,420,129.48	88,496,335.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-19,067,552.85	-9,974,698.48	-29,042,251.33
（一）、综合收益总额	-	-14,978,854.43	-14,978,854.43
（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）	-19,067,552.85	5,004,155.95	-14,063,396.90
其中：1. 基金申购款	22,680,319.48	-2,404,416.94	20,275,902.54
2. 基金赎回款	-41,747,872.33	7,408,572.89	-34,339,299.44
（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	71,848,912.12	-12,394,827.96	59,454,084.16

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

国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国

证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]2626号《关于准予国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由上海国泰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《国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币15,009,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第0947号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金基金合同》于2022年11月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为15,009,000.00份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为上海国泰海通证券资产管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括内地依法发行上市的股票(含主板、创业板及其他依法发行、上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、可转换债券、可交换债券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,本基金可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金股票资产占基金资产的比例不低于80%;每个交易日日终,扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等;本基金投资于科技创新主题的股票不低于非现金基金资产的80%。

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

#### 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	473,868.33
等于：本金	473,811.59

加：应计利息	56.74
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	1,969,999.97
等于：本金	1,969,970.39
加：应计利息	29.58
减：坏账准备	-
合计	2,443,868.30

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	27,250,187.82	-	28,580,031.91	1,329,844.09
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	27,250,187.82	-	28,580,031.91	1,329,844.09

#### 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	1,121,160.00	-	-	-

股指期货	1,121,160.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,121,160.00	-	-	-

#### 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	1	1,173,480.00	52,320.00
合计				52,320.00
减：可抵销期货暂收款				52,320.00
净额				0.00

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

#### 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	-

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	24,795.19
预提审计费	12,396.69
其他应付	131.10
合计	37,322.98

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 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	30,315,973.45	30,315,973.45
本期申购	1,210,699.66	1,210,699.66
本期赎回（以“-”号填列）	-14,921,367.47	-14,921,367.47
本期末	16,605,305.64	16,605,305.64

##### 国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 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	10,545,075.03	10,545,075.03
本期申购	1,745,014.20	1,745,014.20
本期赎回（以“-”号填列）	-1,190,877.48	-1,190,877.48
本期末	11,099,211.75	11,099,211.75

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

##### 国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	379,643.78	259,794.47	639,438.25
本期期初	379,643.78	259,794.47	639,438.25
本期利润	2,441,129.17	1,472,113.11	3,913,242.28
本期基金份额交易产生的变动数	-828,935.88	-1,014,693.17	-
			1,843,629.05

其中：基金申购款	95,336.41	27,770.41	123,106.82
基金赎回款	-924,272.29	-1,042,463.58	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,991,837.07	717,214.41	2,709,051.48

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,631.02	90,264.89	109,895.91
本期期初	19,631.02	90,264.89	109,895.91
本期利润	1,092,896.12	345,321.25	1,438,217.37
本期基金份额交易产生的变动数	57,893.20	38,587.94	96,481.14
其中：基金申购款	135,170.71	47,991.83	183,162.54
基金赎回款	-77,277.51	-9,403.89	-86,681.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,170,420.34	474,174.08	1,644,594.42

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	1,378.79
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	932.00
结算备付金利息收入	7,202.85
其他	-
合计	9,513.64

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	192,921,770.09
减：卖出股票成本总额	189,060,103.05
减：交易费用	146,742.95
买卖股票差价收入	3,714,924.09

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	6,060.00
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	1,452.23
减：交易费用	224.77
合计	4,383.00

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	114,398.41
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	114,398.41

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	1,714,372.29
——股票投资	1,714,372.29
——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	103,340.00
——权证投资	-
——期货投资	103,340.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	277.93
合计	1,817,434.36

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	2,842.58

转换费收入	0.07
合计	2,842.65

#### 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	12,396.69
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行汇划费	920.91
合计	38,112.79

#### 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
中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)	基金托管人
国泰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	371,251,721.85	100.00%	941,549,787.09	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	26,468.93	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	70,983.55	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	209,526.94	451,668.91
其中：应支付销售机构的客户维护费	46,504.09	76,298.24
应支付基金管理人的净管理费	163,022.85	375,370.67

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

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

H 为每日应计提的管理人报酬

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人报酬逐日累计至每月月底，按月支付。

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	34,921.09	75,278.09

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费逐日累计至每月月底，按月支付。

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		
	国泰君安科技创新精选 三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选 三个月持有股票发起 C	合计
国泰海通证券	-	11,627.03	11,627.03
国泰海通资管	-	15,428.44	15,428.44
合计	-	27,055.47	27,055.47

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		
	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C	合计
国泰海通证券	-	16,100.04	16,100.04
国泰海通资管	-	52,022.96	52,022.96
合计	-	68,123.00	68,123.00

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 X 0.50% / 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

##### 国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 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 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	29,671,766.69
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	-	3,000,000.00
报告期末持有的基金份额	10,009,000.00	26,671,766.69
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	60.28%	51.74%

##### 国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C

份额单位：份

项目	本期 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	5,000,000.00	5,000,000.00
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	5,000,000.00	5,000,000.00

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	45.05%	24.63%
---------------------	--------	--------

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
国泰海通证券	1,969,999.97	932.00	3,155,997.78	3,795.48
建设银行	473,868.33	1,378.79	3,491,492.92	3,052.77

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。  
2. 本基金的其他存款由基金结算机构国泰海通证券保管，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建设银行股份有限公司，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在基金最短持有期到期日起（含当日）随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在

市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 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上市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	2,443,868.30	-	-	-	2,443,868.30
结算备付金	1,025,549.96	-	-	-	1,025,549.96
存出保证金	141,991.08	-	-	-	141,991.08
交易性金融资产	-	-	-	28,580,031.91	28,580,031.91
应收申购款	-	-	-	8,440.36	8,440.36
资产总计	3,611,409.34	-	-	28,588,472.27	32,199,881.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	63,553.38	63,553.38
应付管理人报酬	-	-	-	30,424.09	30,424.09
应付托管费	-	-	-	5,070.66	5,070.66
应付销售服务费	-	-	-	5,069.28	5,069.28
应交税费	-	-	-	277.93	277.93
其他负债	-	-	-	37,322.98	37,322.98
负债总计	-	-	-	141,718.32	141,718.32
利率敏感度缺口	3,611,409.34	-	-	28,446,753.95	32,058,163.29
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	3,043,887.06	-	-	-	3,043,887.06
结算备付金	911,858.08	-	-	-	911,858.08
存出保证金	139,304.88	-	-	-	139,304.88
交易性金融资产	-	-	-	37,595,810.91	37,595,810.91
应收申购款	-	-	-	749.23	749.23
资产总计	4,095,050.02	-	-	37,596,560.14	41,691,610.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	60.40	60.40
应付管理人报酬	-	-	-	44,083.65	44,083.65
应付托管费	-	-	-	7,347.28	7,347.28
应付销售服务费	-	-	-	4,735.97	4,735.97
其他负债	-	-	-	25,000.22	25,000.22
负债总计	-	-	-	81,227.52	81,227.52
利率敏感度缺口	4,095,050.02	-	-	37,515,332.62	41,610,382.64

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	28,580,031.91	89.15	37,595,810.91	90.35
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	28,580,031.91	89.15	37,595,810.91	90.35

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%	1,988,097.92	2,539,052.93
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-1,988,097.92	-2,539,052.93

#### 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	28,580,031.91	37,595,810.91
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	28,580,031.91	37,595,810.91

##### 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	28,580,031.91	88.76
	其中：股票	28,580,031.91	88.76
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	3,469,418.26	10.77
8	其他各项资产	150,431.44	0.47
9	合计	32,199,881.61	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	123,868.00	0.39
B	采矿业	-	-
C	制造业	22,295,064.51	69.55
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	196,418.00	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,116,659.23	12.84
J	金融业	553,702.00	1.73
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	1,166,498.17	3.64
N	水利、环境和公共设施管理业	127,822.00	0.40
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	28,580,031.91	89.15

### 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	5,900	1,488,098.00	4.64
2	688981	中芯国际	10,129	893,073.93	2.79
3	688041	海光信息	3,578	505,535.62	1.58
4	300124	汇川技术	7,200	464,904.00	1.45
5	300059	东方财富	18,500	427,905.00	1.33
6	688008	澜起科技	4,928	404,096.00	1.26
7	300308	中际旭创	2,700	393,822.00	1.23
8	688249	晶合集成	18,438	373,738.26	1.17
9	688469	芯联集成	77,491	369,632.07	1.15
10	688347	华虹公司	6,600	362,406.00	1.13
11	688343	云天励飞	6,500	321,230.00	1.00
12	688660	电气风电	36,900	320,292.00	1.00
13	688518	联赢激光	14,900	303,811.00	0.95
14	688256	寒武纪	500	300,750.00	0.94
15	688222	成都先导	18,281	293,958.48	0.92
16	688602	康鹏科技	34,700	290,786.00	0.91
17	688595	芯海科技	7,600	284,164.00	0.89
18	688512	慧智微	26,000	283,660.00	0.88
19	688158	优刻得	12,500	282,750.00	0.88
20	688499	利元亨	6,507	270,756.27	0.84
21	688403	汇成股份	25,400	263,906.00	0.82
22	688428	诺诚健华	10,400	254,072.00	0.79
23	301260	格力博	12,800	252,416.00	0.79
24	300558	贝达药业	4,300	249,185.00	0.78
25	688141	杰华特	7,428	242,004.24	0.75
26	300043	星辉娱乐	49,200	238,128.00	0.74
27	688334	西高院	13,500	231,930.00	0.72
28	301526	国际复材	62,000	225,680.00	0.70

29	688079	美迪凯	22,345	224,343.80	0.70
30	300502	新易盛	1,760	223,555.20	0.70
31	688176	亚虹医药	25,200	223,524.00	0.70
32	300014	亿纬锂能	4,800	219,888.00	0.69
33	300274	阳光电源	3,200	216,864.00	0.68
34	300456	赛微电子	12,600	216,594.00	0.68
35	688111	金山办公	772	216,198.60	0.67
36	300458	全志科技	5,400	214,326.00	0.67
37	300358	楚天科技	26,700	208,260.00	0.65
38	300206	理邦仪器	17,300	207,946.00	0.65
39	688183	生益电子	3,963	202,905.60	0.63
40	688275	万润新能	4,944	200,479.20	0.63
41	300102	乾照光电	17,100	197,847.00	0.62
42	688146	中船特气	6,840	197,744.40	0.62
43	300825	阿尔特	18,200	196,742.00	0.61
44	301558	三态股份	21,800	196,418.00	0.61
45	301536	星辰科技	3,200	192,960.00	0.60
46	300869	康泰医学	13,400	192,156.00	0.60
47	688584	上海合晶	10,634	190,135.92	0.59
48	300224	正海磁材	13,400	189,610.00	0.59
49	300879	大叶股份	4,700	184,616.00	0.58
50	688593	新相微	11,273	184,088.09	0.57
51	688209	英集芯	9,964	184,035.08	0.57
52	300489	光智科技	4,000	176,640.00	0.55
53	688128	中国电研	6,998	171,451.00	0.53
54	688321	微芯生物	7,197	171,144.66	0.53
55	300602	飞荣达	8,000	169,680.00	0.53
56	300548	博创科技	2,500	166,925.00	0.52
57	688388	嘉元科技	8,300	166,664.00	0.52
58	300393	中来股份	28,900	166,464.00	0.52
59	002258	利尔化学	15,000	165,600.00	0.52
60	300231	银信科技	13,400	164,954.00	0.51
61	301165	锐捷网络	2,620	161,025.20	0.50
62	300299	富春股份	20,600	158,208.00	0.49
63	300760	迈瑞医疗	700	157,325.00	0.49
64	300739	明阳电路	10,500	155,820.00	0.49
65	688523	航天环宇	7,200	154,872.00	0.48
66	301318	维海德	4,400	148,896.00	0.46
67	300496	中科创达	2,600	148,772.00	0.46
68	688351	微电生理	7,428	146,331.60	0.46
69	002414	高德红外	14,200	145,550.00	0.45
70	300185	通裕重工	50,700	145,002.00	0.45
71	688033	天宜新材	22,600	144,866.00	0.45

72	688201	信安世纪	11,100	143,745.00	0.45
73	300221	银禧科技	17,000	141,100.00	0.44
74	688220	翱捷科技	1,800	140,940.00	0.44
75	300433	蓝思科技	6,200	138,260.00	0.43
76	301396	宏景科技	2,200	136,642.00	0.43
77	688716	中研股份	3,800	135,280.00	0.42
78	301281	科源制药	4,100	132,758.00	0.41
79	688280	精进电动	17,799	129,398.73	0.40
80	688180	君实生物	3,800	129,124.00	0.40
81	300709	精研科技	3,300	128,865.00	0.40
82	688661	和林微纳	3,160	125,673.20	0.39
83	300624	万兴科技	2,000	124,100.00	0.39
84	688373	盟科药业	19,472	122,089.44	0.38
85	688488	艾迪药业	8,800	121,880.00	0.38
86	688505	复旦张江	13,972	120,997.52	0.38
87	300562	乐心医疗	8,200	120,950.00	0.38
88	688685	迈信林	2,100	117,285.00	0.37
89	688108	赛诺医疗	10,408	116,777.76	0.36
90	688221	前沿生物	11,531	115,771.24	0.36
91	688277	天智航	8,300	115,370.00	0.36
92	300830	金现代	12,300	112,299.00	0.35
93	300510	金冠股份	23,700	108,546.00	0.34
94	688690	纳微科技	4,733	108,054.39	0.34
95	688380	中微半导	3,900	105,690.00	0.33
96	688233	神工股份	3,291	104,555.07	0.33
97	688396	华润微	2,216	104,506.56	0.33
98	300187	永清环保	20,400	104,040.00	0.32
99	300620	光库科技	2,200	103,642.00	0.32
100	688588	凌志软件	7,113	103,636.41	0.32
101	300418	昆仑万维	3,000	100,890.00	0.31
102	688582	芯动联科	1,500	100,800.00	0.31
103	300768	迪普科技	5,700	97,755.00	0.30
104	688181	八亿时空	3,090	96,160.80	0.30
105	688549	中巨芯	12,200	94,428.00	0.29
106	688179	阿拉丁	7,422	94,407.84	0.29
107	300476	胜宏科技	700	94,066.00	0.29
108	300009	安科生物	11,100	92,907.00	0.29
109	300746	汉嘉设计	5,900	92,453.00	0.29
110	688636	智明达	2,637	89,104.23	0.28
111	300803	指南针	1,100	88,726.00	0.28
112	688400	凌云光	3,200	88,224.00	0.28
113	688387	信科移动	15,300	86,445.00	0.27
114	300967	晓鸣股份	4,600	85,100.00	0.27

115	300420	五洋自控	24,700	84,968.00	0.27
116	300232	洲明科技	11,700	84,708.00	0.26
117	300400	劲拓股份	5,000	84,200.00	0.26
118	301251	威尔高	2,100	82,341.00	0.26
119	688365	光云科技	5,400	82,188.00	0.26
120	600521	华海药业	4,300	80,109.00	0.25
121	301248	杰创智能	3,100	77,128.00	0.24
122	300628	亿联网络	2,200	76,472.00	0.24
123	688031	星环科技	1,600	74,608.00	0.23
124	688418	震有科技	2,800	74,088.00	0.23
125	300802	矩子科技	3,900	73,476.00	0.23
126	688590	新致软件	3,574	73,409.96	0.23
127	300017	网宿科技	6,800	72,896.00	0.23
128	301282	金禄电子	2,900	71,891.00	0.22
129	688202	美迪西	2,000	71,860.00	0.22
130	688425	铁建重工	17,392	70,959.36	0.22
131	300424	航新科技	4,000	69,280.00	0.22
132	300473	德尔股份	2,100	68,355.00	0.21
133	002624	完美世界	4,500	68,265.00	0.21
134	600703	三安光电	5,400	67,068.00	0.21
135	688055	龙腾光电	17,600	65,120.00	0.20
136	688552	航天南湖	1,600	63,856.00	0.20
137	688131	皓元医药	1,311	63,386.85	0.20
138	300699	光威复材	2,000	63,340.00	0.20
139	688629	华丰科技	1,100	62,920.00	0.20
140	300608	思特奇	5,300	61,692.00	0.19
141	688147	微导纳米	2,017	60,873.06	0.19
142	300598	诚迈科技	1,400	59,570.00	0.19
143	688506	百利天恒	200	59,224.00	0.18
144	688717	艾罗能源	1,100	59,213.00	0.18
145	688819	天能股份	2,100	58,296.00	0.18
146	300088	长信科技	9,700	57,812.00	0.18
147	300241	瑞丰光电	10,000	57,000.00	0.18
148	300382	斯莱克	3,700	56,277.00	0.18
149	600460	士兰微	2,200	54,604.00	0.17
150	002151	北斗星通	1,900	54,511.00	0.17
151	301509	金凯生科	1,400	52,906.00	0.17
152	300365	恒华科技	7,900	52,061.00	0.16
153	688122	西部超导	1,000	51,880.00	0.16
154	300666	江丰电子	700	51,870.00	0.16
155	301230	泓博医药	1,500	51,630.00	0.16
156	688271	联影医疗	400	51,096.00	0.16
157	688443	智翔金泰	1,795	49,793.30	0.16

158	300351	永贵电器	3,100	49,352.00	0.15
159	688665	四方光电	1,100	49,192.00	0.15
160	301270	汉仪股份	1,000	47,660.00	0.15
161	688248	南网科技	1,500	47,190.00	0.15
162	688012	中微公司	258	47,033.40	0.15
163	688270	臻镭科技	1,000	46,560.00	0.15
164	688085	三友医疗	2,400	46,152.00	0.14
165	688711	宏微科技	2,600	45,734.00	0.14
166	300579	数字认证	1,300	44,863.00	0.14
167	688579	山大地纬	4,003	44,793.57	0.14
168	688015	交控科技	2,120	44,180.80	0.14
169	688182	灿勤科技	1,600	44,096.00	0.14
170	688286	敏芯股份	600	42,414.00	0.13
171	688213	思特威	400	40,888.00	0.13
172	688553	汇宇制药	2,500	40,725.00	0.13
173	301205	联特科技	400	38,344.00	0.12
174	688090	瑞松科技	1,100	37,829.00	0.12
175	002107	沃华医药	6,600	37,752.00	0.12
176	688668	鼎通科技	600	37,476.00	0.12
177	601628	中国人寿	900	37,071.00	0.12
178	300550	和仁科技	2,700	36,693.00	0.11
179	688722	同益中	1,700	36,159.00	0.11
180	002786	银宝山新	3,900	35,958.00	0.11
181	301055	张小泉	1,700	35,836.00	0.11
182	300314	戴维医疗	2,800	35,560.00	0.11
183	300223	北京君正	500	34,600.00	0.11
184	688585	上纬新材	4,400	34,232.00	0.11
185	688020	方邦股份	900	34,083.00	0.11
186	688036	传音控股	404	32,198.80	0.10
187	688667	菱电电控	600	31,926.00	0.10
188	300320	海达股份	3,200	31,808.00	0.10
189	688739	成大生物	1,200	31,680.00	0.10
190	688468	科美诊断	4,300	31,648.00	0.10
191	688558	国盛智科	1,203	30,363.72	0.09
192	688150	莱特光电	1,200	29,664.00	0.09
193	688022	瀚川智能	2,000	29,640.00	0.09
194	688597	煜邦电力	3,760	29,440.80	0.09
195	688586	江航装备	2,600	29,250.00	0.09
196	300900	广联航空	1,200	29,124.00	0.09
197	688550	瑞联新材	664	28,558.64	0.09
198	300079	数码视讯	4,800	28,080.00	0.09
199	300289	利德曼	5,400	28,080.00	0.09
200	688030	山石网科	1,700	27,183.00	0.08

201	688018	乐鑫科技	180	26,298.00	0.08
202	300339	润和软件	500	25,415.00	0.08
203	300045	华力创通	1,300	24,817.00	0.08
204	688185	康希诺	408	24,329.04	0.08
205	300257	开山股份	2,400	24,168.00	0.08
206	300498	温氏股份	1,400	23,912.00	0.07
207	301175	中科环保	4,600	23,782.00	0.07
208	300306	远方信息	1,800	23,256.00	0.07
209	002174	游族网络	1,900	23,047.00	0.07
210	688238	和元生物	3,700	22,940.00	0.07
211	002491	通鼎互联	4,000	22,720.00	0.07
212	300479	神思电子	1,000	22,070.00	0.07
213	688571	杭华股份	2,800	21,588.00	0.07
214	688102	斯瑞新材	1,600	21,568.00	0.07
215	688702	盛科通信	349	21,316.92	0.07
216	688379	华光新材	600	20,796.00	0.06
217	300039	上海凯宝	3,400	20,604.00	0.06
218	688800	瑞可达	400	19,680.00	0.06
219	688362	甬矽电子	656	19,535.68	0.06
220	600819	耀皮玻璃	3,300	19,206.00	0.06
221	688682	霍莱沃	600	18,780.00	0.06
222	688591	泰凌微	392	18,776.80	0.06
223	300357	我武生物	900	18,576.00	0.06
224	300549	优德精密	1,000	18,290.00	0.06
225	300623	捷捷微电	600	17,880.00	0.06
226	600268	国电南自	2,200	17,204.00	0.05
227	300160	秀强股份	3,000	16,860.00	0.05
228	688261	东微半导	400	16,500.00	0.05
229	688262	国芯科技	600	16,002.00	0.05
230	300776	帝尔激光	300	15,963.00	0.05
231	688510	航亚科技	625	15,112.50	0.05
232	600354	敦煌种业	2,400	14,856.00	0.05
233	688662	富信科技	400	14,580.00	0.05
234	300026	红日药业	3,800	14,022.00	0.04
235	300363	博腾股份	800	13,664.00	0.04
236	300696	爱乐达	600	13,548.00	0.04
237	688360	德马科技	720	13,356.00	0.04
238	300238	冠昊生物	800	12,984.00	0.04
239	300115	长盈精密	600	12,840.00	0.04
240	300583	赛托生物	700	12,068.00	0.04
241	300207	欣旺达	600	12,036.00	0.04
242	688066	航天宏图	600	11,748.00	0.04
243	688173	希荻微	800	10,928.00	0.03

244	002249	大洋电机	1,600	10,528.00	0.03
245	688252	天德钰	400	9,752.00	0.03
246	688603	天承科技	200	8,840.00	0.03
247	688099	晶晨股份	119	8,450.19	0.03
248	600685	中船防务	300	8,157.00	0.03
249	002228	合兴包装	1,900	6,707.00	0.02
250	300048	合康新能	1,100	6,457.00	0.02
251	688088	虹软科技	101	4,873.25	0.02
252	688161	威高骨科	135	3,616.65	0.01
253	688208	道通科技	116	3,549.60	0.01
254	688177	百奥泰	105	2,631.30	0.01
255	688689	银河微电	109	2,514.63	0.01
256	688035	德邦科技	25	1,015.50	0.00
257	688458	美芯晟	21	990.36	0.00
258	688300	联瑞新材	20	931.00	0.00
259	688707	振华新材	50	677.50	0.00
260	688772	珠海冠宇	46	657.34	0.00
261	688683	莱尔科技	9	226.98	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	2,266,064.40	5.45
2	688041	海光信息	1,613,279.10	3.88
3	688981	中芯国际	1,598,293.37	3.84
4	688280	精进电动	1,221,381.04	2.94
5	688008	澜起科技	1,115,949.00	2.68
6	688256	寒武纪	1,062,347.12	2.55
7	688249	晶合集成	994,107.04	2.39
8	688591	泰凌微	952,178.75	2.29
9	688158	优刻得	899,683.35	2.16
10	688141	杰华特	854,234.28	2.05
11	688183	生益电子	837,564.08	2.01
12	300124	汇川技术	828,075.00	1.99
13	300489	光智科技	785,267.00	1.89
14	688343	云天励飞	784,169.00	1.88
15	000725	京东方 A	705,927.00	1.70
16	688277	天智航	698,509.25	1.68
17	300059	东方财富	694,868.00	1.67

18	688327	云从科技	691,138.31	1.66
19	688728	格科微	689,650.91	1.66
20	688472	阿特斯	688,888.00	1.66

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	2,313,995.54	5.56
2	688041	海光信息	2,232,335.66	5.36
3	688256	寒武纪	1,809,011.04	4.35
4	688008	澜起科技	1,673,632.87	4.02
5	300750	宁德时代	1,383,960.00	3.33
6	688158	优刻得	1,272,798.37	3.06
7	688591	泰凌微	1,168,548.99	2.81
8	688280	精进电动	1,134,780.36	2.73
9	688012	中微公司	1,096,448.70	2.64
10	688111	金山办公	1,020,301.94	2.45
11	688099	晶晨股份	945,205.12	2.27
12	688327	云从科技	944,326.00	2.27
13	688472	阿特斯	910,924.00	2.19
14	688249	晶合集成	782,048.20	1.88
15	688728	格科微	778,262.14	1.87
16	688347	华虹公司	772,250.46	1.86
17	688180	君实生物	756,739.75	1.82
18	300433	蓝思科技	756,436.00	1.82
19	000725	京东方 A	731,890.00	1.76
20	688161	威高骨科	731,315.10	1.76

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	178,329,951.76
卖出股票收入（成交）总额	192,921,770.09

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

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

## 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

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

## 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	141,991.08
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,440.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	150,431.44

### 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
国泰君安科技创新	233	71,267.41	10,009,000.00	60.28%	6,596,305.64	39.72%

精选三个月持有股票发起 A						
国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C	133	83,452.72	7,569,138.35	68.20%	3,530,073.40	31.80%
合计	366	75,695.40	17,578,138.35	63.45%	10,126,379.04	36.55%

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	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	2,269,496.06	13.6673%
	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C	55,088.24	0.4963%
	合计	2,324,584.30	8.3906%

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

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

#### 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	15,009,000.00	54.18%	15,009,000.00	54.18%	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	18,816.58	0.07%	-	-	-
基金经理等人员	1,073,088.26	3.87%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	1,232,679.46	4.45%	-	-	-
合计	17,333,584.30	62.57%	15,009,000.00	54.18%	-

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

	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C
基金合同生效日（2022 年 11 月 16 日）基金份额总额	10,009,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	30,315,973.45	10,545,075.03
本报告期基金总申购份额	1,210,699.66	1,745,014.20
减：本报告期基金总赎回份额	14,921,367.47	1,190,877.48
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	16,605,305.64	11,099,211.75

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：

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

## 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	371,251,721.85	100.00%	26,468.93	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	国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金 2024 年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-01-22
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	国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金 2024 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-03-31
7	国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-04-22
8	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
9	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
10	上海国泰君安证券资产管理有限公司	上海证券报、中国证券报、证	2025-04-30

	限公司关于办公地址变更的公告	券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	
11	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
12	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
13	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	20250101-20250630	15,009,000.00	-	-	15,009,000.00	54.18%
个人	1	20250101-20250224	10,054,667.65	-	10,054,667.65	0.00	0.00%

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

### 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