

国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 08 月 30 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董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08月23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2024年04月16日起至2024年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13

§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
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	14
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
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	49
7.12 投资组合报告附注	49

§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
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
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	53
10.8 其他重大事件.....	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金	
基金简称	国泰君安科创板量化选股股票发起	
基金主代码	020698	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 04 月 16 日	
基金管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	110,889,351.13 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安科创板量化选股股票发起 A	国泰君安科创板量化选股股票发起 C
下属分级基金的交易代码	020698	020699
报告期末下属分级基金的份额总额	50,771,570.63 份	60,117,780.50 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

		限公司	
信息披露负责人	姓名	吕巍	石立平
	联系电话	021-38676022	010-63639180
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		95521	95595
传真		021-38871190	010-63639132
注册地址		上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址		上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		200120	100033
法定代表人		陶耿	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gtjazg.com
基金中期报告备置地点	上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上海国泰君安证券资产管理有限公司	上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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（2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）-2024 年 06 月 30 日）	
	国泰君安科创板量化选股股票发起 A	国泰君安科创板量化选股股票发起 C
本期已实现收益	-678,110.68	-851,116.50
本期利润	-2,826,941.84	-3,393,886.43
加权平均基金份额本期利润	-0.0557	-0.0565
本期加权平均净值利润率	-5.62%	-5.70%
本期基金份额净值增长率	-5.57%	-5.65%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-2,826,941.84	-3,393,886.43
期末可供分配基金份额利润	-0.0557	-0.0565
期末基金资产净值	47,944,628.79	56,723,894.07
期末基金份额净值	0.9443	0.9435
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-5.57%	-5.65%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰君安科创板量化选股股票发起 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-4.67%	1.18%	-5.12%	1.30%	0.45%	-0.12%
自基金合同生效起至今	-5.57%	0.94%	-4.68%	1.37%	-0.89%	-0.43%

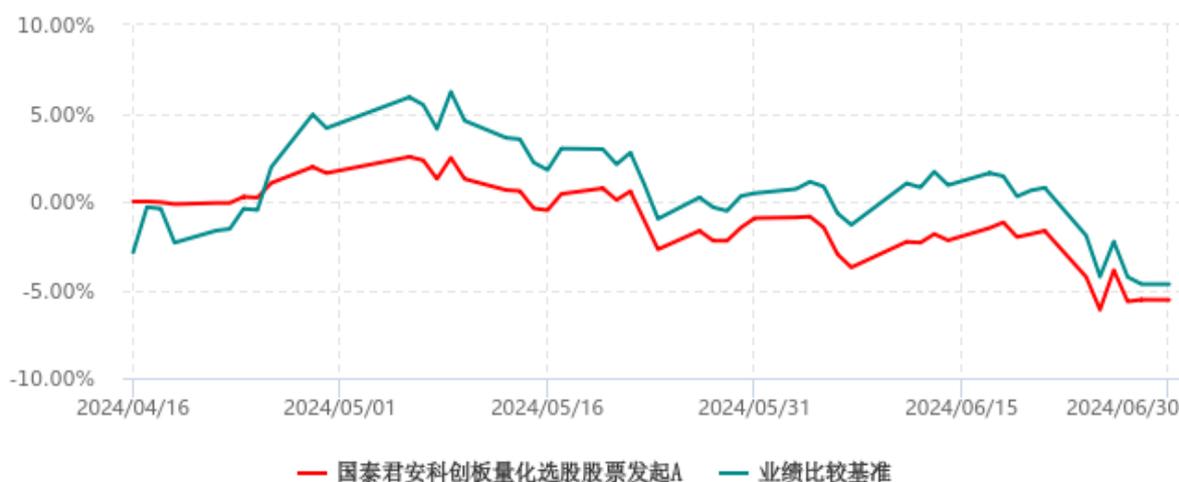
国泰君安科创板量化选股股票发起 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-4.71%	1.18%	-5.12%	1.30%	0.41%	-0.12%
自基金合同生效起至今	-5.65%	0.94%	-4.68%	1.37%	-0.97%	-0.43%

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

国泰君安科创板量化选股股票发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2024年04月16日-2024年06月30日)

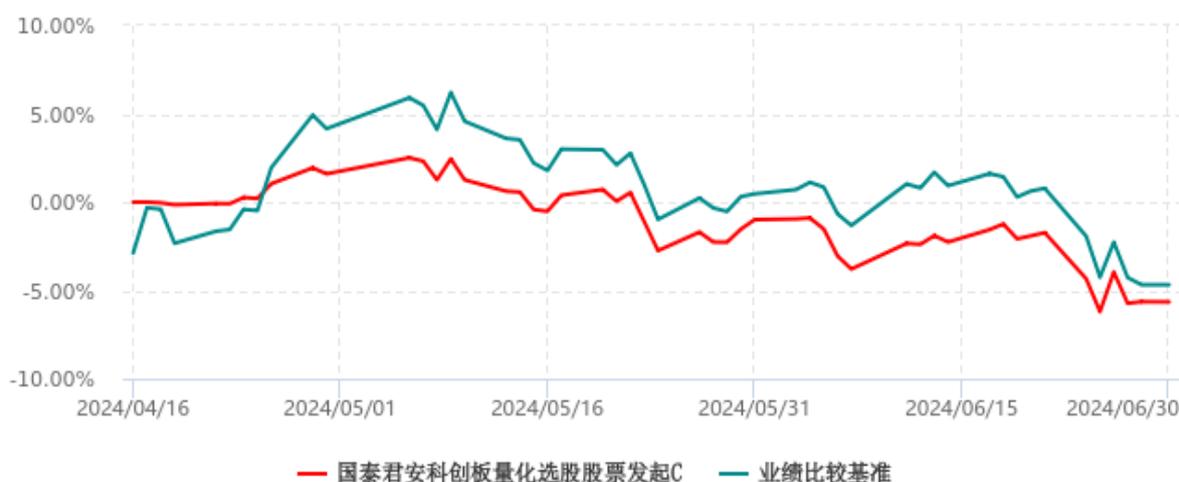


注：1、本基金于 2024 年 04 月 16 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，截止本报告期末基金成立未满六个月。

国泰君安科创板量化选股股票发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2024年04月16日-2024年06月30日)



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

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，截止本报告期末基金成立未满六个月。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海国泰君安证券资产管理有限公司正式成立于 2010 年 10 月 18 日，经中国证监会证监许可【2010】631 号文批准，是业内首批券商系资产管理公司。公司注册资本金 20 亿元，注册地上海。

截至 2024 年 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、国泰君安君得利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 53 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 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，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经理，国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安稳债增利	2024-04-16	-	13 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士。曾任香港科技大学人工智能实验室访问学者，其后加盟方正证券研究所、国泰君安证券咨询部及研究所从事量化对冲模型的研发工作，2014 年加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，先后在量化投资部、权益与衍生品部担任高级投资经理，从事量化投资和策略研发工作，在 Alpha 量化策略以及基于机器学习的投资方面有独到且深入的研究。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。

	债券型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。				
--	---	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 2 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

上半年，市场风险偏好降至冰点，投资者在不确定性笼罩下寻求避风港，红利及大型垄断性国

企成为资金青睐的对象，展现出显著的超额收益。这不仅反映了投资者对确定性资产的强烈需求，也揭示了市场在动荡时期的价值回归趋势。同时，今年两市跑赢沪深 300 指数的公司不足 15%，而跑赢中证 500 的公司也不到 1/4，整体市场平均涨跌幅超过 20%，显示出明显的亏钱效应，这对以分散化持股为主要投资风格的量化策略并不友好。

本基金聚焦科创板，特别是科创 50 和科创 100 的成分股，投资于成长潜力较大的科技新兴产业，挖掘 A 股未来最有潜力的结构性 Beta。以量化的方式，从各个数据维度对科技产业上市公司进行全覆盖，有效挖掘“科技龙头”、“专精特新”、“小而美”的科技创新企业，发挥量化选股及模型的优势，获取大幅超越科创板主流指数（科创 50 和科创 100 等）的收益。

随着我国积极的财政政策适度加力，高水平对外开放政策不断延续，以及消费需求仍处于充分释放阶段，未来市场具备回升条件，我们预计，未来市场板块轮动速度仍然较快。以分散化投资为主的量化投资在今年超大盘股引领的防御性行情下，阶段性面临一定的挑战，也本没有一种投资方法论可以通吃所有风格的行情，但是量化投资从投资理念和投资逻辑来讲并未发生本质性改变，量化投资在不同风格的选股方面依然有较大的可为空间和较高的性价比。在行业和个股走势出现较大的变化下，我们依然维持一贯的投资理念和投资组合管理体系，本基金在投资组合的配置和交易方面严格遵循量化模型的建议，基金经理则主要从挖掘有投资逻辑的 Alpha 因子、随着市场演变不断改进底层量化模型以及模型的日常跟踪和分析等层面不断增强策略的表现，常年来我们坚守整体一贯的投资体系和理念，也尽可能以此稳定投资者在不同市场环境对我们超额收益率的预期。在量化增强层面，我们尽量结合以财务数据为基础的基本面信号和以量价为主的技术面信号，对于科技创新型公司也会更注重研发投资和专利数据等另类因子的挖掘和利用，并通过机器学习模型来进行有效因子的选择和因子之间的轮动，得益于基本面量化、另类因子和实时量价在信号层面较低的相关性，使得我们有信心在兼顾各类因子的情况下追求稳健的 Alpha。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安科创板量化选股股票发起 A 基金份额净值为 0.9443 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.57%，同期业绩比较基准收益率为-4.68%；截至报告期末国泰君安科创板量化选股股票发起 C 基金份额净值为 0.9435 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.65%，同期业绩比较基准收益率为-4.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，A 股权益市场估值仍然处于历史底部位置，A 股指数具有较高的配置性价比，在积极的财政和货币政策的支撑下，A 股依然有望延续震荡反弹的格局。海外方面，美联储降息预期再次扩张，引来美元指数和美债利率的进一步走弱，人民币汇率回升，有助于海外资金加速回流 A 股。国内方面，监管层面对股票市场的非常态波动采取了积极行动，“国九条”的实施与打击财务造假举措的不断推进，短期内对中小市值公司确实造成一定情绪面的冲击，但长远来看，这些措施

犹如“刮骨疗伤”，短期的阵痛反而有利于资本市场中长期的健康发展，在提升上市公司质量和注重投资者回报的同时，为投资者创造更加透明和公平的投资环境。审视当下的行情，诚然目前市场依然处于风险偏好较低的缩量博弈阶段，市场信心的恢复尚需时日，但是我们认为大多数股票的市场化“出清”较为彻底，过去多年的下跌对当下复杂经济环境和国际政治形势的估值消化已经较为充分，“磨底”的煎熬并不妨碍我们对于下半年的行情变得积极乐观起来。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日
资产：		
货币资金	6.4.7.1	7,382,626.51
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	97,689,031.66
其中：股票投资		97,689,031.66
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-

其他投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产	6.4.7.3	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.4	-
资产总计		105,071,658.17
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		270,209.09
应付托管费		45,034.85
应付销售服务费		48,821.60
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-

递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.5	39,069.77
负债合计		403,135.31
净资产：		
实收基金	6.4.7.6	110,889,351.13
未分配利润	6.4.7.7	-6,220,828.27
净资产合计		104,668,522.86
负债和净资产总计		105,071,658.17

注：1、报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 110,889,351.13 份。其中国泰君安科创板量化选股股票发起 A 基金份额净值 0.9443 元，基金份额总额 50,771,570.63 份；国泰君安科创板量化选股股票发起 C 基金份额净值 0.9435 元，基金份额总额 60,117,780.50 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2024 年 4 月 16 日(基金合同生效日)至 204 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-5,821,932.10
1. 利息收入		35,478.48
其中：存款利息收入	6.4.7.8	35,478.48
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,165,809.49

其中：股票投资收益	6.4.7.9	-1,643,180.12
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益	6.4.7.10	477,370.63
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.11	-4,691,601.09
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		-
减：二、营业总支出		398,896.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	270,209.09
2. 托管费	6.4.10.2.2	45,034.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	48,821.60
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.12	34,830.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,220,828.27
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,220,828.27
五、其他综合收益的税后净额		-

六、综合收益总额		-6,220,828.27
----------	--	---------------

注：本基金合同生效日为 2024 年 4 月 16 日，无上年度同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	110,889,351.13	-	110,889,351.13
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-6,220,828.27	-6,220,828.27
（一）、综合收益总额	-	-6,220,828.27	-6,220,828.27
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	110,889,351.13	-6,220,828.27	104,668,522.86

注：本基金合同生效日为 2024 年 4 月 16 日，无上年度同期对比数据。

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	茹建江
-----	-----	-----
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024] 62 号《关于准予国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由上海国泰君安证券资产管理有限公司依照《中华人

民共和国证券投资基金法》和《国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 110,889,351.13 元，业经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）毕马威华振验字第 2400134 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同》于 2024 年 4 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 110,889,351.13 份基金份额，其中认购资金利息折合 26,616.00 份基金份额。本基金的基金管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,010,801.80 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为依法发行上市的股票（含主板、创业板、科创板及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、可转换债券、可交换债券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，本基金可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于科创板股票资产的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：上证科创板 50 成份指数收益率*45%+上证科创板 100 指数收益率*45%+中债综合全价（总值）指数收益率*10%。

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》、《国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同》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 2024 年 04 月 16 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 04 月 16 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 04 月 16 日(基金合同生效日)至 2024 年 06 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产金融资产于初始确认时分类为：

以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2)金融负债金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3)衍生金融工具本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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 2024 年 06 月 30 日
活期存款	3,919,613.74
等于：本金	3,918,829.94
加：应计利息	783.80
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	3,463,012.77
等于：本金	3,462,794.98
加：应计利息	217.79
减：坏账准备	-
合计	7,382,626.51

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 2024 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	102,380,632.75	-	97,689,031.66	-4,691,601.09
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	102,380,632.75	-	97,689,031.66	-4,691,601.09

6.4.7.3 买入返售金融资产

6.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	26,061.75
预提审计费	8,768.88
其他应付	4,239.14
合计	39,069.77

6.4.7.6 实收基金

国泰君安科创板量化选股股票发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	50,771,570.63	50,771,570.63
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	50,771,570.63	50,771,570.63

国泰君安科创板量化选股股票发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月
----	---

	30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	60,117,780.50	60,117,780.50
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	60,117,780.50	60,117,780.50

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.7 未分配利润

国泰君安科创板量化选股股票发起 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-678,110.68	-2,148,831.16	-
			2,826,941.84
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-678,110.68	-2,148,831.16	-
			2,826,941.84

国泰君安科创板量化选股股票发起 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-851,116.50	-2,542,769.93	-
			3,393,886.43
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-851,116.50	-2,542,769.93	-
			3,393,886.43

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	30,262.61
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	5,215.87
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	35,478.48

6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	224,262,525.34
减：卖出股票成本总额	225,713,358.04
减：交易费用	192,347.42
买卖股票差价收入	-1,643,180.12

6.4.7.10 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	477,370.63
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	477,370.63

6.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-4,691,601.09
——股票投资	-4,691,601.09
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-

——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-4,691,601.09

6.4.7.12 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	8,768.88
信息披露费	26,061.75
证券出借违约金	-
合计	34,830.63

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
上海国泰君安证券资产管理有限公司 (以下简称“国泰君安资管”)	基金管理人
中国光大银行股份有限公司(以下简称“光大银行”)	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君安证券”)	基金管理人的股东、代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券	552,356,516.13	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）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
国泰君安证券	44,798.59	100.00%	0.00	0.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	270,209.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	117,681.92
应支付基金管理人的净管理费	152,527.17

注：支付基金管理人国泰君安资管的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.20% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日） 至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	45,034.85

注：支付基金托管人光大银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安科创板量化选 股股票发起 A	国泰君安科创板量化选 股股票发起 C	合计
国泰君安资管	-	4,065.29	4,065.29
国泰君安证券	-	43,651.27	43,651.27
合计	-	47,716.56	47,716.56

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

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国泰君安科创板量化选股股票发起 A

份额单位：份

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日） 至 2024 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2024 年 04 月 16 日）持有的 基金份额	5,009,901.80
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-

报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	5,009,901.80
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.87%

国泰君安科创板量化选股股票发起 C

份额单位：份

项目	本期 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日） 至 2024 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2024 年 04 月 16 日）持有的基金份额	5,000,900.00
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	5,000,900.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.32%

注：1. 基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。2. 报告期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 2024 年 04 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
光大银行	3,919,613.74	30,262.61
国泰君安证券	3,463,012.77	5,215.87

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管，按银行同业利率计息。
2. 本基金的其他存款由基金结算机构国泰君安证券保管，按协议约定利率计息。

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

本基金本报告期无须做说明的其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金的托管行中国光大银行股份有限公司，其他银行存款为国泰君安证券券商保证金，与银

行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2024 年 6 月 30 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 2024 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度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	7,382,626.51	-	-	-	7,382,626.51
交易性金融资产	-	-	-	97,689,031.66	97,689,031.66
资产总计	7,382,626.51	-	-	97,689,031.66	105,071,658.17
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	270,209.09	270,209.09
应付托管费	-	-	-	45,034.85	45,034.85
应付销售服	-	-	-	48,821.60	48,821.60

务费					
其他负债	-	-	-	39,069.77	39,069.77
负债总计	-	-	-	403,135.31	403,135.31
利率敏感度	7,382,626.5	-	-	97,285,896.3	104,668,522.8
缺口	1			5	6

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 2024 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%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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 2024 年 06 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	97,689,031.66	93.33
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	97,689,031.66	93.33

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2024 年 06 月 30 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 06 月 30 日
第一层次	97,689,031.66
第二层次	-
第三层次	-
合计	97,689,031.66

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	97,689,031.66	92.97
	其中：股票	97,689,031.66	92.97
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	7,382,626.51	7.03
8	其他各项资产	-	-
9	合计	105,071,658.17	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	83,531,207.35	79.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	858,643.00	0.82
E	建筑业	34,515.00	0.03
F	批发和零售业	305,216.40	0.29

G	交通运输、仓储和邮政业	310,080.00	0.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,807,038.79	10.33
J	金融业	218,760.00	0.21
K	房地产业	30,660.00	0.03
L	租赁和商务服务业	137,478.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	1,455,433.12	1.39
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	97,689,031.66	93.33

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	688981	中芯国际	79,633	3,671,081.30	3.51
2	688012	中微公司	25,385	3,585,885.10	3.43
3	688041	海光信息	44,974	3,162,571.68	3.02
4	300750	宁德时代	13,400	2,412,402.00	2.30
5	688111	金山办公	10,521	2,393,527.50	2.29
6	688008	澜起科技	40,400	2,309,264.00	2.21
7	688099	晶晨股份	37,910	2,248,821.20	2.15
8	688271	联影医疗	17,870	1,960,339.00	1.87
9	688169	石头科技	4,145	1,627,327.00	1.55
10	688019	安集科技	11,943	1,502,429.40	1.44
11	688363	华熙生物	25,052	1,417,191.64	1.35
12	688187	时代电气	28,403	1,402,540.14	1.34
13	688120	华海清科	7,100	1,346,018.00	1.29
14	688036	传音控股	16,057	1,229,002.78	1.17
15	688088	虹软科技	42,093	1,214,803.98	1.16
16	688249	晶合集成	81,738	1,199,096.46	1.15
17	688002	睿创微纳	42,028	1,175,523.16	1.12

18	688208	道通科技	46,686	1,127,000.04	1.08
19	688289	圣湘生物	61,597	1,082,875.26	1.03
20	688586	江航装备	113,518	1,055,717.40	1.01
21	688617	惠泰医疗	2,306	1,051,766.60	1.00
22	688029	南微医学	16,932	1,042,333.92	1.00
23	688728	格科微	85,766	1,038,626.26	0.99
24	688516	奥特维	24,555	1,026,644.55	0.98
25	688281	华秦科技	11,854	987,675.28	0.94
26	688055	龙腾光电	306,755	972,413.35	0.93
27	688352	颀中科技	83,303	950,487.23	0.91
28	688213	思特威	18,997	921,354.50	0.88
29	688472	阿特斯	89,861	914,784.98	0.87
30	688578	艾力斯	13,942	888,663.08	0.85
31	688798	艾为电子	14,917	844,600.54	0.81
32	000725	京东方 A	206,300	843,767.00	0.81
33	688336	三生国健	41,094	836,262.90	0.80
34	002422	科伦药业	26,700	809,811.00	0.77
35	688223	晶科能源	111,885	794,383.50	0.76
36	688126	沪硅产业	56,781	784,145.61	0.75
37	688032	禾迈股份	6,788	779,126.64	0.74
38	002241	歌尔股份	39,200	764,792.00	0.73
39	688128	中国电研	44,057	758,220.97	0.72
40	688188	柏楚电子	4,065	750,195.75	0.72
41	688028	沃尔德	45,420	746,250.60	0.71
42	688439	振华风光	10,874	722,577.30	0.69
43	688138	清溢光电	32,566	700,169.00	0.67
44	688313	仕佳光子	72,625	691,390.00	0.66
45	688475	萤石网络	19,384	661,188.24	0.63
46	688007	光峰科技	40,992	659,971.20	0.63
47	688484	南芯科技	17,757	658,784.70	0.63
48	688608	恒玄科技	4,500	658,710.00	0.63
49	601633	长城汽车	25,300	640,090.00	0.61
50	688378	奥来德	27,173	637,478.58	0.61
51	688389	普门科技	39,204	637,457.04	0.61
52	688253	英诺特	16,500	628,815.00	0.60
53	688116	天奈科技	26,554	612,866.32	0.59
54	688408	中信博	6,600	607,728.00	0.58
55	688222	成都先导	52,301	593,616.35	0.57
56	688779	长远锂科	126,566	586,000.58	0.56
57	002340	格林美	91,200	580,944.00	0.56
58	688123	聚辰股份	9,365	569,672.95	0.54
59	688016	心脉医疗	5,700	558,885.00	0.53
60	688150	莱特光电	28,500	552,900.00	0.53

61	601877	正泰电器	28,700	547,022.00	0.52
62	600809	山西汾酒	2,500	527,200.00	0.50
63	688195	腾景科技	21,494	526,817.94	0.50
64	688601	力芯微	11,805	515,760.45	0.49
65	688105	诺唯赞	25,228	504,812.28	0.48
66	688777	中控技术	13,000	490,100.00	0.47
67	300408	三环集团	16,200	472,878.00	0.45
68	688819	天能股份	19,108	455,916.88	0.44
69	688209	英集芯	36,200	449,242.00	0.43
70	688153	唯捷创芯	11,961	442,557.00	0.42
71	688065	凯赛生物	9,741	442,143.99	0.42
72	688127	蓝特光学	23,908	439,668.12	0.42
73	688050	爱博医疗	5,904	432,881.28	0.41
74	688139	海尔生物	11,500	427,800.00	0.41
75	688362	甬矽电子	21,169	411,948.74	0.39
76	688433	华曙高科	19,526	407,312.36	0.39
77	688276	百克生物	14,211	403,166.07	0.39
78	688590	新致软件	31,154	401,886.60	0.38
79	688582	芯动联科	14,270	401,843.20	0.38
80	688383	新益昌	7,700	401,247.00	0.38
81	000830	鲁西化工	32,700	378,993.00	0.36
82	300735	光弘科技	17,400	375,840.00	0.36
83	688409	富创精密	9,880	364,967.20	0.35
84	688778	厦钨新能	11,538	360,447.12	0.34
85	688072	拓荆科技	2,888	346,877.68	0.33
86	688233	神工股份	17,251	332,426.77	0.32
87	688315	诺禾致源	29,320	320,174.40	0.31
88	688239	航宇科技	9,044	314,731.20	0.30
89	688498	源杰科技	2,345	307,171.55	0.29
90	688690	纳微科技	17,171	298,260.27	0.28
91	603501	韦尔股份	3,000	298,110.00	0.28
92	600468	百利电气	68,500	295,235.00	0.28
93	688612	威迈斯	10,890	289,347.30	0.28
94	688107	安路科技	10,900	277,078.00	0.26
95	000568	泸州老窖	1,900	272,631.00	0.26
96	688371	菲沃泰	26,498	266,039.92	0.25
97	688106	金宏气体	15,042	263,535.84	0.25
98	688686	奥普特	4,100	262,523.00	0.25
99	600011	华能国际	26,900	258,778.00	0.25
100	603025	大豪科技	18,300	252,906.00	0.24
101	002897	意华股份	6,700	252,322.00	0.24
102	688556	高测股份	21,065	250,462.85	0.24
103	003816	中国广核	54,000	250,020.00	0.24

104	301408	华人健康	24,200	247,566.00	0.24
105	688787	海天瑞声	4,500	246,960.00	0.24
106	688122	西部超导	6,412	245,707.84	0.23
107	605369	拱东医疗	6,000	239,400.00	0.23
108	002468	申通快递	27,700	232,680.00	0.22
109	603015	弘讯科技	30,500	230,580.00	0.22
110	688531	日联科技	4,977	229,738.32	0.22
111	688550	瑞联新材	9,792	227,076.48	0.22
112	600030	中信证券	12,000	218,760.00	0.21
113	688231	隆达股份	15,263	217,650.38	0.21
114	000538	云南白药	4,200	214,830.00	0.21
115	002245	蔚蓝锂芯	27,300	211,575.00	0.20
116	002284	亚太股份	31,100	210,236.00	0.20
117	300381	溢多利	34,200	209,988.00	0.20
118	688581	安杰思	4,290	209,909.70	0.20
119	688147	微导纳米	8,400	209,160.00	0.20
120	688513	苑东生物	4,151	208,753.79	0.20
121	688563	航材股份	3,931	207,871.28	0.20
122	688523	航天环宇	11,900	205,275.00	0.20
123	600406	国电南瑞	8,000	199,680.00	0.19
124	688579	山大地纬	23,646	185,621.10	0.18
125	688141	杰华特	11,247	181,751.52	0.17
126	688148	芳源股份	42,626	179,455.46	0.17
127	688380	中微半导	10,700	178,904.00	0.17
128	688182	灿勤科技	13,500	178,740.00	0.17
129	002601	龙佰集团	9,600	178,272.00	0.17
130	688776	国光电气	3,200	177,280.00	0.17
131	688385	复旦微电	5,600	175,728.00	0.17
132	300442	润泽科技	7,300	174,835.00	0.17
133	601500	通用股份	31,500	168,210.00	0.16
134	688561	奇安信	7,104	167,796.48	0.16
135	688093	世华科技	9,156	166,364.52	0.16
136	603229	奥翔药业	16,300	163,815.00	0.16
137	688772	珠海冠宇	10,235	152,501.50	0.15
138	688351	微电生理	6,774	149,298.96	0.14
139	002292	奥飞娱乐	24,500	146,510.00	0.14
140	603823	百合花	14,800	143,116.00	0.14
141	688017	绿的谐波	1,700	139,570.00	0.13
142	688348	昱能科技	2,350	138,650.00	0.13
143	601888	中国中免	2,200	137,478.00	0.13
144	000930	中粮科技	27,100	136,313.00	0.13
145	600819	耀皮玻璃	31,900	134,618.00	0.13
146	688553	汇宇制药	10,800	134,136.00	0.13

147	002613	北玻股份	38,500	133,980.00	0.13
148	688005	容百科技	5,700	132,696.00	0.13
149	002907	华森制药	10,300	129,986.00	0.12
150	688403	汇成股份	15,087	127,937.76	0.12
151	300034	钢研高纳	8,000	127,120.00	0.12
152	603198	迎驾贡酒	2,200	126,500.00	0.12
153	002906	华阳集团	4,700	125,772.00	0.12
154	688306	均普智能	30,426	123,529.56	0.12
155	688533	上声电子	4,678	121,019.86	0.12
156	301301	川宁生物	9,400	120,132.00	0.11
157	600096	云天化	6,000	116,520.00	0.11
158	002399	海普瑞	13,000	112,710.00	0.11
159	688279	峰岬科技	1,008	111,787.20	0.11
160	600183	生益科技	5,300	111,618.00	0.11
161	002046	国机精工	10,500	106,785.00	0.10
162	300502	新易盛	1,000	105,550.00	0.10
163	688226	威腾电气	5,900	103,132.00	0.10
164	300821	东岳硅材	14,900	101,916.00	0.10
165	601991	大唐发电	33,800	101,738.00	0.10
166	002475	立讯精密	2,400	94,344.00	0.09
167	688219	会通股份	12,109	94,086.93	0.09
168	300505	川金诺	7,700	93,863.00	0.09
169	688486	龙迅股份	1,600	91,680.00	0.09
170	600021	上海电力	9,000	89,010.00	0.09
171	300351	永贵电器	6,000	88,800.00	0.08
172	688049	炬芯科技	3,995	88,369.40	0.08
173	688236	春立医疗	6,100	86,498.00	0.08
174	688375	国博电子	1,200	84,768.00	0.08
175	600789	鲁抗医药	11,300	79,100.00	0.08
176	600027	华电国际	11,300	78,422.00	0.07
177	300233	金城医药	5,200	77,584.00	0.07
178	002120	韵达股份	10,000	77,400.00	0.07
179	600727	鲁北化工	12,000	75,600.00	0.07
180	688252	天德钰	5,020	72,940.60	0.07
181	300047	天源迪科	10,700	69,978.00	0.07
182	688102	斯瑞新材	6,100	69,662.00	0.07
183	003021	兆威机电	1,500	69,225.00	0.07
184	603496	恒为科技	2,800	68,460.00	0.07
185	000738	航发控制	3,400	68,238.00	0.07
186	688595	芯海科技	2,100	63,000.00	0.06
187	688566	吉贝尔	2,798	62,955.00	0.06
188	600617	国新能源	25,160	62,900.00	0.06
189	688599	天合光能	3,700	62,604.00	0.06

190	688366	昊海生科	980	60,446.40	0.06
191	688358	祥生医疗	2,324	60,354.28	0.06
192	002378	章源钨业	10,500	60,270.00	0.06
193	688766	普冉股份	600	58,302.00	0.06
194	603883	老百姓	3,140	57,650.40	0.06
195	688432	有研硅	5,900	57,171.00	0.05
196	688201	信安世纪	4,800	56,688.00	0.05
197	300274	阳光电源	900	55,827.00	0.05
198	688526	科前生物	3,700	54,353.00	0.05
199	002519	银河电子	10,800	53,028.00	0.05
200	600362	江西铜业	2,200	52,096.00	0.05
201	600602	云赛智联	4,600	50,784.00	0.05
202	601311	骆驼股份	6,000	48,120.00	0.05
203	688388	嘉元科技	4,803	46,829.25	0.04
204	688301	奕瑞科技	400	46,092.00	0.04
205	002054	德美化工	9,200	45,172.00	0.04
206	300357	我武生物	2,200	44,484.00	0.04
207	300724	捷佳伟创	800	43,208.00	0.04
208	688066	航天宏图	2,400	42,720.00	0.04
209	688800	瑞可达	1,400	39,312.00	0.04
210	688183	生益电子	1,977	38,314.26	0.04
211	603658	安图生物	800	36,856.00	0.04
212	688248	南网科技	1,243	36,830.09	0.04
213	600760	中航沈飞	900	36,090.00	0.03
214	688079	美迪凯	4,848	35,972.16	0.03
215	002577	雷柏科技	2,900	35,873.00	0.03
216	300751	迈为股份	300	35,844.00	0.03
217	300539	横河精密	4,400	35,420.00	0.03
218	601668	中国建筑	6,500	34,515.00	0.03
219	688321	微芯生物	1,916	33,721.60	0.03
220	603896	寿仙谷	1,400	32,858.00	0.03
221	603399	永杉锂业	5,200	32,188.00	0.03
222	300624	万兴科技	600	31,842.00	0.03
223	300424	航新科技	2,600	31,798.00	0.03
224	600048	保利发展	3,500	30,660.00	0.03
225	601615	明阳智能	3,000	28,320.00	0.03
226	603790	雅运股份	2,900	27,840.00	0.03
227	600062	华润双鹤	1,300	25,454.00	0.02
228	600566	济川药业	800	25,368.00	0.02
229	300634	彩讯股份	1,400	23,562.00	0.02
230	601231	环旭电子	1,400	22,470.00	0.02
231	688700	东威科技	800	20,968.00	0.02
232	300396	迪瑞医疗	1,000	20,310.00	0.02

233	688697	纽威数控	1,200	18,828.00	0.02
234	600023	浙能电力	2,500	17,775.00	0.02
235	300229	拓尔思	1,300	17,459.00	0.02
236	688510	航亚科技	877	16,145.57	0.02
237	688789	宏华数科	106	11,426.80	0.01
238	688503	聚和材料	400	11,240.00	0.01
239	688076	诺泰生物	141	11,037.48	0.01
240	688278	特宝生物	200	10,710.00	0.01
241	688535	华海诚科	107	7,331.64	0.01
242	688300	联瑞新材	115	5,531.50	0.01
243	688799	华纳药厂	125	5,303.75	0.01
244	603296	华勤技术	40	2,209.20	0.00
245	688552	航天南湖	118	1,911.60	0.00
246	688259	创耀科技	36	1,438.56	0.00
247	688543	国科军工	15	616.05	0.00
248	688063	派能科技	15	595.65	0.00
249	688312	燕麦科技	23	557.75	0.00
250	688658	悦康药业	16	285.44	0.00
251	688360	德马科技	23	276.92	0.00
252	688588	凌志软件	6	41.10	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入 金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	688981	中芯国际	8,864,606.55	8.47
2	688041	海光信息	8,343,880.71	7.97
3	688012	中微公司	7,132,456.22	6.81
4	688111	金山办公	4,916,174.29	4.70
5	300750	宁德时代	4,673,154.00	4.46
6	688008	澜起科技	4,287,457.73	4.10
7	688271	联影医疗	4,069,618.26	3.89
8	688036	传音控股	3,764,853.66	3.60
9	688578	艾力斯	3,671,446.76	3.51
10	688187	时代电气	3,661,454.68	3.50
11	688099	晶晨股份	3,540,934.06	3.38
12	688313	仕佳光子	3,387,395.63	3.24
13	688169	石头科技	3,300,098.75	3.15
14	688363	华熙生物	3,036,446.12	2.90
15	688139	海尔生物	2,879,794.42	2.75

16	688183	生益电子	2,687,015.05	2.57
17	688408	中信博	2,632,982.74	2.52
18	688088	虹软科技	2,544,438.65	2.43
19	688009	中国通号	2,525,307.88	2.41
20	688208	道通科技	2,519,048.53	2.41
21	688779	长远锂科	2,518,644.99	2.41
22	688222	成都先导	2,517,504.47	2.41
23	688065	凯赛生物	2,506,212.06	2.39
24	688249	晶合集成	2,473,393.54	2.36
25	688223	晶科能源	2,439,092.78	2.33
26	688484	南芯科技	2,434,702.74	2.33
27	688778	厦钨新能	2,412,820.28	2.31
28	688389	普门科技	2,378,499.37	2.27
29	688472	阿特斯	2,367,012.14	2.26
30	688105	诺唯赞	2,300,313.86	2.20
31	688128	中国电研	2,253,773.25	2.15
32	688123	聚辰股份	2,246,280.42	2.15
33	688819	天能股份	2,226,889.30	2.13
34	688050	爱博医疗	2,195,735.59	2.10
35	688002	睿创微纳	2,181,335.06	2.08
36	688728	格科微	2,166,218.67	2.07
37	688772	珠海冠宇	2,159,852.56	2.06

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	688981	中芯国际	5,378,647.65	5.14
2	688041	海光信息	4,887,598.78	4.67
3	688012	中微公司	3,592,513.68	3.43
4	688183	生益电子	2,977,530.11	2.84
5	688578	艾力斯	2,840,117.94	2.71
6	688009	中国通号	2,588,908.00	2.47
7	688139	海尔生物	2,525,788.50	2.41
8	688313	仕佳光子	2,469,266.68	2.36
9	688008	澜起科技	2,386,807.17	2.28
10	688187	时代电气	2,326,315.04	2.22
11	688772	珠海冠宇	2,152,568.72	2.06
12	688065	凯赛生物	2,062,279.39	1.97
13	688036	传音控股	2,021,650.43	1.93

14	688408	中信博	1,997,051.29	1.91
15	688778	厦钨新能	1,977,385.95	1.89
16	688525	佰维存储	1,948,307.86	1.86
17	688111	金山办公	1,912,297.24	1.83
18	300750	宁德时代	1,847,340.00	1.76
19	688248	南网科技	1,843,497.27	1.76
20	688050	爱博医疗	1,827,871.81	1.75

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	328,093,990.79
卖出股票收入（成交）总额	224,262,525.34

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末无其他各项资产构成。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国泰君安科创板量化选股股票发起 A	303	167,562.94	6,994,388.78	13.78%	43,777,181.85	86.22%
国泰君安科创板量化选股股票发起 C	869	69,180.41	13,727,070.08	22.83%	46,390,710.42	77.17%
合计	1,172	94,615.49	20,721,458.86	18.69%	90,167,892.27	81.31%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国泰君安科创板量化选股股票发起 A	-	-
	国泰君安科创板量化选股股票发起 C	17,003.02	0.0283%
	合计	17,003.02	0.0153%

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、基金投资和研发部门负责人持有本开	国泰君安科创板量化选股股票发起 A	0

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

注：本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人以及本基金基金经理均未持有本基金份额。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,010,801.80	9.03%	10,010,801.80	9.03%	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	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	17,003.02	0.02%	-	-	-
合计	10,027,804.82	9.05%	10,010,801.80	9.03%	-

注：其他为公司普通员工持有份额，持有期限为不低于 6 个月。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安科创板量化选股股票发起 A	国泰君安科创板量化选股股票发起 C
基金合同生效日（2024 年 04 月 16 日）基金份额总额	50,771,570.63	60,117,780.50
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-

本报告期末基金份额总额	50,771,570.63	60,117,780.50
-------------	---------------	---------------

§ 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：

2024 年 2 月 28 日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告》。自 2024 年 2 月 26 日起叶明同志代为履行公司首席信息官，朱晓力同志不再担任公司首席信息官职务。

2024 年 3 月 20 日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》。自 2024 年 3 月 18 日起陶耿同志兼任公司财务负责人，叶明同志不再兼任公司财务负责人职务。

2024 年 3 月 20 日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》。自 2024 年 3 月 18 日起吕巍同志兼任公司首席风险官，叶明同志不再兼任公司首席风险官职务。

2、本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券	2	552,356,516.13	100.00%	44,798.59	100.00%	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金托管协议	证监会指定网站、公司官网	2024-03-27
2	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同	证监会指定网站、公司官网	2024-03-27
3	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2024-03-27
4	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2024-03-27
5	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金招募说明书	证监会指定网站、公司官网	2024-03-27
6	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	上海证券报	2024-03-27
7	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金份额发售公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2024-03-27
8	国泰君安科创板量化选股股票	上海证券报、证监会指定网	2024-04-17

	型发起式证券投资基金基金合同生效公告	站、公司官网	
9	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2024-06-28
10	国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2024-06-28

§ 11 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

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、法律意见书；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

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

上海国泰君安证券资产管理有限公司

二〇二四年八月三十日