

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

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 03 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。本年度报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年03月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2023年01月01日起至2023年12月31日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	7
2.1 基金基本情况	7
2.2 基金产品说明	7
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	84
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	85
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	85

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	85
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	85
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	85
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	85
8.12 投资组合报告附注	85
§ 9 基金份额持有人信息	86
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	86
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	87
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	87
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	87
§ 10 开放式基金份额变动	88
§ 11 重大事件揭示	88
11.1 基金份额持有人大会决议	88
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	89
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	89
11.4 基金投资策略的改变	89
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	89
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	89
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	89
11.8 其他重大事件	90
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	92
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	92

12.2 影响投资者决策的其他重要信息	93
§ 13 备查文件目录	93
13.1 备查文件目录	93
13.2 存放地点	93
13.3 查阅方式	93

§ 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	上海国泰君安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	90,916,464.97 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	55,905,576.15 份	35,010,888.82 份

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		上海国泰君安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@gtjas.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	95521	021-60637228
传真	021-38871190	021-60635778
注册地址	上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海市静安区新闸路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	陶耿	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	上海国泰君安证券资产管理有限公司	上海市静安区新闸路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年 11 月 16 日（基金合同生效日）-2022 年 12 月 31 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	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	-1,915,838.56	-2,298,818.83	-346,177.20	-168,967.79
本期利润	-1,529,716.74	-2,644,373.05	-437,932.13	-223,686.09
加权平均基金份额本期利润	-0.0458	-0.0703	-0.0364	-0.0383
本期加权平均净值利润率	-4.53%	-6.90%	-3.74%	-3.93%

本期基金份额净值增长率	1.40%	0.92%	-3.81%	-3.87%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	-1,973,403.83	-1,419,646.07	-526,153.01	-250,528.28
期末可供分配基金份额利润	-0.0353	-0.0405	-0.0381	-0.0387
期末基金资产净值	54,532,719.86	33,963,615.63	13,267,478.07	6,217,495.55
期末基金份额净值	0.9754	0.9701	0.9619	0.9613
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-2.46%	-2.99%	-3.81%	-3.87%

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
过去三个月	-2.52%	1.11%	-3.22%	0.95%	0.70%	0.16%
过去六个月	-7.60%	1.14%	-11.21%	0.93%	3.61%	0.21%
过去一年	1.40%	1.12%	-6.10%	0.91%	7.50%	0.21%
自基金合同生效起至今	-2.46%	1.11%	-11.64%	0.90%	9.18%	0.21%

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
过去三个月	-2.63%	1.11%	-3.22%	0.95%	0.59%	0.16%
过去六个月	-7.82%	1.14%	-11.21%	0.93%	3.39%	0.21%
过去一年	0.92%	1.12%	-6.10%	0.91%	7.02%	0.21%
自基金合同生效起至今	-2.99%	1.11%	-11.64%	0.90%	8.65%	0.21%

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-2023年12月31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-2023年12月31日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

§ 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 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理国泰君安现金管家货币市场基金、国泰君安 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、国泰君安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金、国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金、国泰君安君得明混合型证券投资基金、国泰君安东久新经济产业园封闭式基础设施证券投资基金、国泰君安君得利短债债券型证券投资基金、国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、国泰君安 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安安弘六个月定期开放债券型证券投资基金、国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金等 48 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。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。	2022-11-17	-	12 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士，12 年证券从业经验，具备基金从业资格。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。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《上海国泰君安证券资产管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 27 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

2023 年在国内经济弱复苏、美联储加息和全球避险情绪高涨的背景下，A 股市场经历了年初冲高后长期的震荡下行。年初市场因超预期的宏观经济数据以及宽松的政策环境而表现出乐观，但随着经济复苏放缓和宏观数据回落，市场进入震荡下行期。三、四季度，尽管有强力的政策支持，但中美关系紧张和地缘政治因素使市场持续低迷。我们对 2024 年 A 股市场持乐观态度，2023 年开年至今，经济已显现见底回升的积极态势且政策呵护有力，同时 A 股市场的估值优势愈发显著，在美元降息周期中，A 股将更加有配置价值。

2023 年科创 50 指数（跌幅 11.24%）和创业板指数（跌幅 19.41%），差于中证 2000 指数（涨幅 5.57%）、中证 500 指数（跌幅 7.42%）和沪深 300 指数（跌幅 11.38%），整体表现欠佳。A 股全年波动较大，且行业轮动频繁，主题投资机会也快速切换。以中特估和人工智能为代表的结构性投资机会贯穿全年，为投资者提供了一定的收益贡献。2023 年行业表现分化明显，其中 TMT 板块尤其是通信行业以超过 20% 的收益率领跑，而在经济复苏不达预期的背景下，消费板块表现疲软。房地产行业在 2023 年获得显著的政策支持，但是由于实际的去化和债务问题，行业表现不及预期。展望 2024 年，科技成长板块和高技术制造业估值已经处于低位，加上持续的政策支持，有不错的成长机会。政策的发力方向仍然会持续在地产和科创上，同时以大宗消费、文旅消费为抓手的扩内需政策将继续推进。

本基金聚焦科创板，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“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（如科创 50、科创 100）的收益。同时，本基金参考中证科创信息、中证科创生物、中证科创芯片、中证科创高装、中证科创材料、中证科创新能等的行业分布，在高端装备、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。

我们预计，未来一年将继续科技创新的主题，但是科技创新风格中的行业板块也会有轮动。相对于主观选股来说，量化投资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下对我们超额收益率的预期。在量化增强层面，我们尽量结合以财务数据为基础的基本面信号和以高频量价为主的技术面信号，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，得益于基本面量化和高频量价在信号层面较低的相关性，使得我们有信心在兼顾两者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技创新精选三个月持有股票发起 A 基金份额净值为 0.9754 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.40%，同期业绩比较基准收益率为-6.10%；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 0.9701 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.92%，同期业绩比较基准收益率为-6.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A 股已经经历了接近 3 年的下行走势，大部分宽基指数的估值来到了历史的下轨附近，充分体现了市场对未来经济下行以及经济转型阵痛的预期，以双创为主的成长股调整幅度显著大于价值股。2023 年是资本市场全面深化改革的关键年，围绕全面注册制改革、防范化解风险和提振市场信心，资本市场进行一系列重大改革，从投资端、融资端、交易端等方面制定了一揽子措施。我们认为全面降低交易费率、强化上市公司监管、提升上市公司分红和回购意识、规范化大股东减持制度等等，均是对资本市场长期痼疾的治本之策，扎扎实实提升了 A 股长期投资价值。展望 2024 年，货币政策有望延续宽松格局，资本市场资金迎来新结构和新均衡，资金面有望温和净流入。随着美联储结束加息以及进入降息，美元指数和美债收益率迎来“双降”，叠加国内经济和盈利预期改善的提振作用，外资有望回流。在货币宽松的市场环境下，市场风险偏好回暖，资金供给端的规模有望较 2023 年明显改善，成长股有望迎来显著的修复性行情。科创板作为 A 股中最具成长属性的典型板块，具有极强的科技属性，专精特新含量较高。从量化模型的 Alpha 角度来看，诚然过去几年随着公私募量化行业以及场外衍生品的快速发展，主要宽基指数的波动率变得越来越低，博取超额收益的难度也越来越受到挑战，但是科创板得益于高波动和机构持仓比例较低等因素，当前依然可谓是 Alpha 的沃土之一，也是本基金的主要“阵地”。立足当下来看，以雪球为主的场外衍生品、融券 T0 和 DMA 的出清和规范化监管，一定程度上缓解了主要宽基指数成分股内的拥挤程度，有利于量化行业的长期有序发展，量化投资方法论在各个不同维度依然会得到越来越多投资者的认可。另一方面在投研过程中，我们也逐步强化另类因子的挖掘、异质化思维建模和提升实盘模型的逻辑性等，在统一的投研框架下，尽量提升在各个不同宽基上博取纯粹 Alpha 的能力。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合规运作角度出发，在合规文化建设、制度体系建设、合规审查及检查、反洗钱、员工执业行为规范等角度开展工作，不断深化员工的合规意识，推动公司合规文化和内部风险控制机制的完善和优化。

内部监察工作重点包括以下几个方面：

1、合规文化建设。管理人通过内外部合规培训、合规考试、法规解读、法律法规库维护更新、监管会议精神传达等多种形式推动公司合规文化建设，不断提高全体员工合规意识，为公司业务健康发展提供良好的文化土壤。

2、制度体系建设和完善。管理人根据法律法规变化，结合行业新动态，围绕新业务需要，不断优化和健全公司制度体系，并注重相关制度体系的落实和执行。通过制度体系的建设和完善，不断提升了业务管理流程的健全性、规范性、精细化和可操作性，为公司业务规范运营和合规管理进一步夯实了制度基础。

3、合规审查和检查。根据法律法规、监管要求和公司制度规定，做好对公司新业务、新产品、新投资品种及其他创新业务的法律合规及风险控制支持，定期对产品销售、投资、研究及交易等相关业务活动的日常合规性进行检查，查漏补缺。合规检查工作促进了内部控制管理的完善，防范了合规风险的进一步发生。

4、员工执业与投资行为管理。根据法律法规和公司制度要求，管理人不断加强员工执业行为管理。管理人要求新员工入职时需提供和完善个人信息并完成相关投资的申报工作，对投资、交易人员的通讯工具实行交易时间段集中管理，并对监控摄像、电子邮件、电话录音和即时通讯工具聊天记录定期进行合规检查。通过一系列常态化的员工执业和投资行为管理，促进员工执业和投资行为持续符合监管要求。

5、反洗钱合规管理。本报告期内，管理人持续加强反洗钱合规管理，制定反洗钱工作方案，并在年度内推进落实。持续做好日常可疑交易监控排查、客户风险等级划分、修订反洗钱内部控制管理制度、跟进反洗钱系统改造、完成各类反洗钱工作报告、反洗钱金融机构分类评级自评工作等。

管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部合规风控工作的科学性和有效性，努力防范和控制各类风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行过利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 21327 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金 全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了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“国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日和 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度和 2022 年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金 2023 年 12 月 31 日和 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度和 2022 年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>

强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金的基金管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金不能持续经营。</p>

	(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	薛竞、段黄霖
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2024-03-25

§ 7 年度财务报表

7.1 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: 2023 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产:			
货币资金	7.4.7.1	6,195,015.66	1,855,944.19
结算备付金		800,633.38	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	81,691,185.22	17,648,322.41
其中: 股票投资		81,691,185.22	17,648,322.41
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	7.4.7.3	-	-

应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		39,421.24	9,852.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.4	-	-
资产总计		88,726,255.50	19,514,118.82
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		90,319.84	22,844.29
应付托管费		15,053.28	3,807.39
应付销售服务费		14,546.89	2,493.52
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.5	110,000.00	-

负债合计		229,920.01	29,145.20
净资产：			
实收基金	7.4.7.6	90,916,464.97	20,261,654.91
未分配利润	7.4.7.7	-2,420,129.48	-776,681.29
净资产合计		88,496,335.49	19,484,973.62
负债和净资产总计		88,726,255.50	19,514,118.82

注：1. 报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 90,916,464.97 份，其中国泰君安科技创新精选三个月持有 A 类基金份额净值 0.9754 元，基金份额 55,905,576.15 份；国泰君安科技创新精选三个月持有 C 类基金份额净值 0.9701 元，基金份额 35,010,888.82 份。于 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 20,261,654.91 份，其中国泰君安科技创新精选三个月持有 A 类基金份额净值 0.9619 元，基金份额 13,793,631.08 份；国泰君安科技创新精选三个月持有 C 类基金份额净值 0.9613 元，基金份额 6,468,023.83 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2023 年度和 2022 年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间。

7.2 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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 11 月 16 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-2,749,444.78	-620,456.52
1. 利息收入		18,732.23	3,330.42
其中：存款利息收入	7.4.7.8	18,732.23	3,330.42
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）		-2,847,806.55	-477,313.71
其中：股票投资收益	7.4.7.9	-3,365,292.40	-477,313.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	7.4.7.10	517,485.85	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.11	40,567.60	-146,473.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.12	39,061.94	-
减：二、营业总支出		1,424,645.01	41,161.70
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	962,316.88	32,256.42
2. 托管费	7.4.10.2.2	160,386.11	5,376.08
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	190,443.83	3,514.20
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.13	111,498.19	15.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,174,089.79	-661,618.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,174,089.79	-661,618.22

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4,174,089.79	-661,618.22

7.3 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：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	20,261,654.91	-776,681.29	19,484,973.62
二、本期期初净资产	20,261,654.91	-776,681.29	19,484,973.62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	70,654,810.06	-1,643,448.19	69,011,361.87
(一)、综合收益总额	-	-4,174,089.79	-4,174,089.79
(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)	70,654,810.06	2,530,641.60	73,185,451.66
其中：1. 基金申购款	92,320,281.89	2,449,137.41	94,769,419.30
2. 基金赎回款	-21,665,471.83	81,504.19	-21,583,967.64
(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	90,916,464.97	-2,420,129.48	88,496,335.49
项目	上年度可比期间 2022 年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	15,009,000.00	-	15,009,000.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	5,252,654.91	-776,681.29	4,475,973.62
(一)、综合收益总额	-	-661,618.22	-661,618.22
(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)	5,252,654.91	-115,063.07	5,137,591.84
其中：1. 基金申购款	5,252,654.91	-115,063.07	5,137,591.84
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	20,261,654.91	-776,681.29	19,484,973.62
-----------	---------------	-------------	---------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

陶耿	庄严	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

7.4 报表附注

7.4.1 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,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君安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%。本财务报表由本基金的基金管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司于 2024 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 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》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度和 2022 年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 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 2023 年 12 月 31 日和 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度和 2022 年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2023 年度和 2022 年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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商业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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

7.4.4.5 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、资产支持证券投资和衍生工具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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。对基金通过港股通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。(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。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。(5)本基金的城

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	702,397.76	1,425,962.41
等于：本金	702,290.61	1,425,814.52
加：应计利息	107.15	147.89
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	5,492,617.90	429,981.78
等于：本金	5,492,314.92	429,854.79
加：应计利息	302.98	126.99
减：坏账准备	-	-
合计	6,195,015.66	1,855,944.19

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	81,797,090.85	-	81,691,185.22	-105,905.63
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	81,797,090.85	-	81,691,185.22	-105,905.63
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	17,794,795.64	-	17,648,322.41	-146,473.23
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		17,794,795.64	-	17,648,322.41	-146,473.23

7.4.7.3 买入返售金融资产

7.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 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	-	-
预提费用	110,000.00	-
合计	110,000.00	-

7.4.7.6 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	13,793,631.08	13,793,631.08
本期申购	49,663,835.08	49,663,835.08
本期赎回（以“-”号填列）	-7,551,890.01	-7,551,890.01
本期末	55,905,576.15	55,905,576.15

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,468,023.83	6,468,023.83
本期申购	42,656,446.81	42,656,446.81
本期赎回（以“-”号填列）	-14,113,581.82	-14,113,581.82
本期末	35,010,888.82	35,010,888.82

注：1. 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2022 年 11 月 15 日至 2022 年 11 月 15 日止公开发售，共募集有效净认购资金人民币 15,009,000.00 元，折合为 15,009,000.00 份基金份额（其中 A 类基金份额 10,009,000.00 份，C 类基金份额 5,000,000.00 份）。本基金在募集期间未产生利息折份额。

7.4.7.7 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	-375,263.22	-150,889.79	-526,153.01
本期期初	-375,263.22	-150,889.79	-526,153.01
本期利润	-1,915,838.56	386,121.82	-1,529,716.74
本期基金份额交易产生的变动数	317,697.95	365,315.51	683,013.46
其中：基金申购款	583,862.60	286,232.81	870,095.41
基金赎回款	-266,164.65	79,082.70	-187,081.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,973,403.83	600,547.54	-1,372,856.29

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	-179,742.17	-70,786.11	-250,528.28
本期期初	-179,742.17	-70,786.11	-250,528.28

本期利润	-2,298,818.83	-345,554.22	-2,644,373.05
本期基金份额交易产生的变动数	1,058,914.93	788,713.21	1,847,628.14
其中：基金申购款	1,202,836.05	376,205.95	1,579,042.00
基金赎回款	-143,921.12	412,507.26	268,586.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,419,646.07	372,372.88	-1,047,273.19

7.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	5,360.97	1,239.29
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	12,737.88	2,091.13
结算备付金利息收入	633.38	-
其他	-	-
合计	18,732.23	3,330.42

7.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,476,606,064.83	28,709,377.99
减：卖出股票成本总额	1,478,348,683.39	29,146,631.80
减：交易费用	1,622,673.84	40,059.90
买卖股票差价收入	-3,365,292.40	-477,313.71

7.4.7.10 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2022

		年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	517,485.85	-
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	517,485.85	-

7.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	40,567.60	-146,473.23
——股票投资	40,567.60	-146,473.23
——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	40,567.60	-146,473.23

7.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	39,061.94	-
合计	39,061.94	-

7.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00	-

信息披露费	80,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	1,098.19	15.00
其他费用	400.00	-
合计	111,498.19	15.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海国泰君安证券资产管理有限公司(以下简称“国泰君安资管”)	基金管理人
中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君安证券”)	基金管理人的股东、代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 11 月 16 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 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
国泰君安证券	3,018,957,043.43	100.00%	75,650,805.43	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的基金交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券	215,259.20	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 11 月 16 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券	5,389.67	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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 11 月 16 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	962,316.88	32,256.42

其中：应支付销售机构的客户维护费	142,897.53	2,062.89
应支付基金管理人的净管理费	819,419.35	30,193.53

注：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的管理费率由 1.5% 下调至 1.2%，自 2023 年 7 月 24 日起执行新的管理费率。2023 年 7 月 24 日之前，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 1.50\% \div \text{当年实际天数}$ ，H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日的基金资产净值，基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。2023 年 7 月 24 日(含)之后，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率。计提管理费的计算方法如下： $H = E \times 1.20\% \div \text{当年实际天数}$ ，H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日的基金资产净值，基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	160,386.11	5,376.08

注：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的托管费率由 0.25% 下调至 0.2%，自 2023 年 7 月 24 日起执行新的托管费率。2023 年 7 月 24 日之前，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.25\% \div \text{当年实际天数}$ ，H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日的基金资产净值，基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。2023 年 7 月 24 日之后(含)，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.20\% \div \text{当年实际天数}$ ，H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日的基金资产净值，基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安科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
国泰君安资管	0	129,482.84	129,482.84
国泰君安证券	0	49,986.17	49,986.17
合计	0	179,469.01	179,469.01
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安科技创新精选 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
国泰君安资管	0	3,228.01	3,228.01
国泰君安证券	0	224.68	224.68
合计	0	3,452.69	3,452.69

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.50% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下： $H=E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ ，H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费，E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值，基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2022 年 11 月 16 日)持有的基金份额	-	10,009,000.00
报告期初持有的基金份额	10,009,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	19,662,766.69	-
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	29,671,766.69	10,009,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	53.07%	72.56%

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 11 月 16 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2022 年 11 月 16 日)持有的基金份额	-	5,000,000.00
报告期初持有的基金份额	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	14.28%	77.30%

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总份额比例，分类基金比例的分母采用基金分类份额计算。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 11 月 16 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	702,397.76	5,360.97	1,425,962.41	1,239.29
国泰君安证券	5,492,617.90	12,737.88	429,981.78	2,091.13

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

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2022 年 12 月 31 日：本基金未持有信用类债券）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可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 2023 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	6,195,015.66	-	-	-	6,195,015.66
结算备付金	800,633.38	-	-	-	800,633.38
交易性金融资产	-	-	-	81,691,185.22	81,691,185.22
应收申购款	-	-	-	39,421.24	39,421.24
资产总计	6,995,649.04	-	-	81,730,606.46	88,726,255.50
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	90,319.84	90,319.84
应付托管费	-	-	-	15,053.28	15,053.28
应付销售服务费	-	-	-	14,546.89	14,546.89
其他负债	-	-	-	110,000.00	110,000.00
负债总计	-	-	-	229,920.01	229,920.01
利率敏感度缺口	6,995,649.04	-	-	81,500,686.45	88,496,335.49
上年度末 2022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	1,855,944.19	-	-	-	1,855,944.19
交易性金融资产	-	-	-	17,648,322.41	17,648,322.41
应收申购款	-	-	-	9,852.22	9,852.22
资产总计	1,855,944.19	-	-	17,658,174.63	19,514,118.82
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	22,844.29	22,844.29
应付托管费	-	-	-	3,807.39	3,807.39
应付销售服务费	-	-	-	2,493.52	2,493.52
负债总计	-	-	-	29,145.20	29,145.20
利率敏感度缺口	1,855,944.19	-	-	17,629,029.43	19,484,973.62

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日或行权日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例 0.00% (2022 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 (2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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	81,691,185.22	92.31	17,648,322.41	90.57
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	81,691,185.22	92.31	17,648,322.41	90.57

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 7.4.1）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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准（附注 7.4.1）上升 5%	5,081,987.72	-
	业绩比较基准（附注 7.4.1）下降 5%	-5,081,987.72	-

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	81,691,185.22	17,648,322.41
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	81,691,185.22	17,648,322.41

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	81,691,185.22	92.07
	其中：股票	81,691,185.22	92.07
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	6,995,649.04	7.88
8	其他各项资产	39,421.24	0.04
9	合计	88,726,255.50	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%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	91,287.00	0.10
B	采矿业	226,720.00	0.26
C	制造业	66,666,051.12	75.33
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	-	-
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	13,682,975.26	15.46
J	金融业	-	-
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	892,463.84	1.01
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	131,688.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	81,691,185.22	92.31

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688111	金山办公	6,930	2,191,266.00	2.48
2	688396	华润微电子	48,220	2,154,951.80	2.44
3	688385	复旦微电	53,500	2,066,705.00	2.34
4	688012	中微半导体设备	13,398	2,057,932.80	2.33
5	688187	时代电气	56,100	2,038,113.00	2.30
6	688006	浙江杭可科技	78,801	1,850,247.48	2.09
7	688503	聚和材料股份公司	31,424	1,684,326.40	1.90
8	688138	清溢光电	74,183	1,678,019.46	1.90
9	688981	中芯国际	31,600	1,675,432.00	1.89
10	688484	南芯科技	40,454	1,612,091.90	1.82
11	688234	天岳先进	22,635	1,495,494.45	1.69
12	688599	天合光能	50,340	1,436,200.20	1.62
13	688707	振华新材料	66,100	1,355,050.00	1.53
14	688095	福昕软件开发	19,053	1,330,852.05	1.50
15	688475	萤石网络	27,841	1,250,060.90	1.41
16	688003	天准科技	33,145	1,243,600.40	1.41
17	300102	乾照光电	168,700	1,239,945.00	1.40
18	002916	深南电路	17,400	1,235,226.00	1.40
19	600867	通化东宝	112,300	1,216,209.00	1.37
20	600812	华北制药	207,500	1,182,750.00	1.34
21	688223	晶科能源	130,100	1,152,686.00	1.30
22	688516	奥特维科技	12,717	1,150,888.50	1.30
23	002007	华兰生物	50,700	1,121,991.00	1.27
24	688366	昊海生物科技	10,103	1,094,053.87	1.24
25	600584	长电科技	36,300	1,083,918.00	1.22
26	002558	巨人网络	97,200	1,082,808.00	1.22
27	688002	睿创微纳	23,300	1,030,326.00	1.16
28	002913	奥士康	33,400	1,023,710.00	1.16
29	300709	精研科技	32,500	1,013,675.00	1.15
30	300558	贝达药业	19,600	1,010,380.00	1.14
31	688049	炬芯科技	25,251	961,305.57	1.09
32	688336	三生国健	42,614	959,241.14	1.08

33	688772	珠海冠宇电池	41,100	904,611.00	1.02
34	688586	江航飞机装备	80,300	890,527.00	1.01
35	688472	阿特斯阳光电力	69,836	882,028.68	1.00
36	688521	芯原微电子	17,458	872,201.68	0.99
37	601633	长城汽车	33,800	852,436.00	0.96
38	688252	天德钰科技	42,200	842,312.00	0.95
39	002380	科远智慧	49,100	836,173.00	0.94
40	688276	长春百克生物科技	15,133	829,439.73	0.94
41	688135	利扬芯片	36,755	820,004.05	0.93
42	688292	浩瀚深度信息技术	29,774	819,380.48	0.93
43	300628	亿联网络	27,500	812,625.00	0.92
44	688099	晶晨半导体	12,520	784,127.60	0.89
45	688106	金宏气体	31,817	766,471.53	0.87
46	300724	捷佳伟创	10,300	762,303.00	0.86
47	688008	澜起科技	12,398	728,506.48	0.82
48	688306	均普智能制造	127,186	708,426.02	0.80
49	688711	江苏宏微科技	16,424	681,431.76	0.77
50	688287	观典防务	66,832	659,631.84	0.75
51	300357	我武生物	22,300	646,700.00	0.73
52	688009	中国通号	147,300	645,174.00	0.73
53	301339	通行宝	31,900	643,742.00	0.73
54	688468	科美诊断	58,800	634,452.00	0.72
55	688036	传音控股	4,400	608,960.00	0.69
56	600789	鲁抗医药	85,100	607,614.00	0.69
57	688368	晶丰明源半导体	5,613	605,867.22	0.68
58	688819	天能电池集团股份	21,300	594,696.00	0.67
59	688798	艾为电子	8,126	560,937.78	0.63
60	002555	三七互娱	29,800	560,538.00	0.63
61	688107	安路科技	15,108	555,672.24	0.63
62	002165	红宝丽	128,800	544,824.00	0.62
63	688389	深圳普门科技	22,200	499,722.00	0.56
64	688588	凌志软件	41,100	489,090.00	0.55
65	300289	利德曼	77,900	479,085.00	0.54
66	688439	振华风光	5,273	469,877.03	0.53
67	688018	乐鑫科技	4,389	451,847.55	0.51
68	601600	中国铝业	75,700	426,948.00	0.48
69	688403	汇成股份	39,817	420,069.35	0.47
70	688601	力芯微股份	7,980	418,072.20	0.47

71	603659	璞泰来	19,300	403,949.00	0.46
72	000597	东北制药	72,500	387,875.00	0.44
73	688779	长远锂科	52,500	383,250.00	0.43
74	002730	电光科技	40,000	379,200.00	0.43
75	000650	仁和药业	56,800	376,584.00	0.43
76	688271	联影医疗	2,700	369,927.00	0.42
77	688210	泛海统联精密制造	12,382	323,789.30	0.37
78	002057	中钢天源	38,200	307,128.00	0.35
79	301301	川宁生物	36,000	302,400.00	0.34
80	688699	明微电子	6,813	274,904.55	0.31
81	300292	吴通控股	66,700	248,124.00	0.28
82	000738	航发控制	12,400	246,760.00	0.28
83	688183	生益电子	21,700	246,729.00	0.28
84	300111	向日葵	79,800	242,592.00	0.27
85	600479	千金药业	22,400	241,248.00	0.27
86	688088	虹软科技	5,871	240,945.84	0.27
87	688037	芯源微电子	1,800	240,498.00	0.27
88	002298	中电兴发	41,600	239,616.00	0.27
89	600562	国睿科技	17,100	236,664.00	0.27
90	603259	药明康德	3,200	232,832.00	0.26
91	600776	东方通信	20,600	232,574.00	0.26
92	603993	洛阳钼业	43,600	226,720.00	0.26
93	603283	赛腾股份	2,900	210,424.00	0.24
94	688299	长阳科技	14,800	206,460.00	0.23
95	000519	中兵红箭	13,800	193,752.00	0.22
96	300127	银河磁体	10,900	188,679.00	0.21
97	688023	安恒信息	1,700	188,513.00	0.21
98	688569	铁科轨道	6,466	178,526.26	0.20
99	002196	方正电机	24,800	178,064.00	0.20
100	002644	佛慈制药	17,400	169,650.00	0.19
101	688739	成大生物	5,212	169,442.12	0.19
102	300113	顺网科技	11,900	166,600.00	0.19
103	600438	通威股份	6,300	157,689.00	0.18
104	688568	中科星图公司	3,200	156,992.00	0.18
105	002522	浙江众成	31,700	152,477.00	0.17
106	600498	烽火通信	9,100	151,424.00	0.17
107	002602	世纪华通	28,300	146,028.00	0.17
108	002364	中恒电气	18,400	141,680.00	0.16
109	002467	二六三	29,900	138,736.00	0.16
110	002129	TCL 中环	8,500	132,940.00	0.15
111	300682	朗新集团	8,100	132,759.00	0.15
112	600576	祥源文旅	17,700	131,688.00	0.15

113	688331	荣昌生物	2,090	129,705.40	0.15
114	600351	亚宝药业	18,600	128,340.00	0.15
115	300046	台基股份	7,900	125,689.00	0.14
116	603806	福斯特	5,100	123,777.00	0.14
117	002611	东方精工	22,600	112,096.00	0.13
118	688173	希荻微电子	6,072	106,806.48	0.12
119	300634	彩讯股份	5,100	104,397.00	0.12
120	301330	熵基科技	3,100	102,610.00	0.12
121	002041	登海种业	6,900	91,287.00	0.10
122	301165	锐捷网络	2,400	90,936.00	0.10
123	000100	TCL 科技	20,800	89,440.00	0.10
124	688028	沃尔德金刚石	3,397	84,551.33	0.10
125	002880	卫光生物	2,400	84,312.00	0.10
126	002601	龙佰集团	4,700	80,511.00	0.09
127	002407	多氟多	5,200	79,144.00	0.09
128	002415	海康威视	2,200	76,384.00	0.09
129	600613	神奇制药	9,800	74,578.00	0.08
130	688310	迈得医疗	2,200	65,780.00	0.07
131	688126	上海硅产业集团	3,294	57,052.08	0.06
132	600176	中国巨石	5,400	53,082.00	0.06
133	688578	艾力斯医药科技	1,100	45,826.00	0.05
134	300319	麦捷科技	4,500	43,380.00	0.05
135	002179	中航光电	900	35,100.00	0.04
136	688083	中望软件	228	22,695.12	0.03
137	688561	奇安信集团	141	5,652.69	0.01
138	688035	德邦科技股份	44	2,347.84	0.00
139	688139	海尔生物	42	1,701.84	0.00
140	688575	XD 亚辉龙生物	47	1,074.89	0.00
141	688358	祥生医疗科技	3	113.34	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	688111	金山办公	19,918,239.38	102.22
2	688036	传音控股	16,353,913.04	83.93
3	688981	中芯国际	15,649,070.71	80.31
4	688223	晶科能源	14,988,271.86	76.92

5	688012	中微半导体设备	13,786,497.21	70.75
6	688126	上海硅产业集团	13,430,267.01	68.93
7	688599	天合光能	13,034,374.64	66.89
8	688187	时代电气	12,807,173.30	65.73
9	688772	珠海冠宇电池	11,595,783.62	59.51
10	688578	艾力斯医药科技	11,428,592.46	58.65
11	688396	华润微电子	10,492,973.56	53.85
12	688169	石头科技	9,247,849.54	47.46
13	688777	中控技术	8,607,749.63	44.18
14	688234	天岳先进	8,560,122.50	43.93
15	688002	睿创微纳	8,527,351.71	43.76
16	688009	中国通号	8,453,332.71	43.38
17	688006	浙江杭可科技	8,444,728.31	43.34
18	688072	拓荆科技	8,423,516.64	43.23
19	688107	安路科技	8,241,019.75	42.29
20	688138	清溢光电	8,132,319.94	41.74
21	688007	光峰科技	7,759,292.84	39.82
22	600050	中国联通	7,631,281.00	39.16
23	688385	复旦微电	7,432,086.31	38.14
24	688139	海尔生物	7,368,024.43	37.81
25	002916	深南电路	7,299,650.23	37.46
26	688711	江苏宏微科技	7,289,264.66	37.41
27	688439	振华风光	7,122,374.55	36.55
28	688029	南微医学科技	7,100,018.13	36.44
29	688363	华熙生物	6,722,180.84	34.50
30	688819	天能电池集团股份	6,456,416.68	33.14
31	688008	澜起科技	6,397,374.72	32.83
32	688106	金宏气体	6,240,972.33	32.03
33	000100	TCL 科技	6,207,518.00	31.86
34	688588	凌志软件	6,191,930.62	31.78
35	688390	固德威电源	6,025,144.58	30.92
36	688120	华海清科	5,874,076.33	30.15
37	688332	中科蓝讯	5,779,601.78	29.66
38	688135	利扬芯片	5,754,757.27	29.53
39	000725	京东方 A	5,727,429.00	29.39
40	688425	铁建重工	5,716,381.88	29.34
41	002600	领益智造	5,693,143.00	29.22
42	000045	深纺织 A	5,529,695.00	28.38
43	688099	晶晨半导体	5,518,189.92	28.32

44	688408	中信博新能源	5,517,711.03	28.32
45	688368	晶丰明源半导体	5,415,096.93	27.79
46	688516	奥特维科技	5,301,407.97	27.21
47	688063	派能科技	5,292,932.11	27.16
48	688521	芯原微电子	5,277,061.75	27.08
49	688318	财富趋势	5,270,763.17	27.05
50	603228	景旺电子	5,171,074.52	26.54
51	600789	鲁抗医药	5,162,693.60	26.50
52	688248	南方电网电力科技	5,127,065.33	26.31
53	688188	上海柏楚电子科技	5,097,239.90	26.16
54	688559	海目星激光	5,091,360.06	26.13
55	688208	道通科技	5,046,175.72	25.90
56	688707	振华新材料	5,033,369.19	25.83
57	601600	中国铝业	4,996,752.00	25.64
58	688018	乐鑫科技	4,990,586.46	25.61
59	688590	新致软件	4,973,916.55	25.53
60	688088	虹软科技	4,961,184.27	25.46
61	688083	中望软件	4,752,984.73	24.39
62	688148	芳源股份	4,736,543.76	24.31
63	688779	长远锂科	4,720,097.04	24.22
64	688658	悦康药业	4,711,059.55	24.18
65	688509	正元地信	4,591,686.47	23.57
66	688207	格灵深瞳	4,587,949.35	23.55
67	300433	蓝思科技	4,532,813.00	23.26
68	688287	观典防务	4,483,135.17	23.01
69	688575	XD 亚辉龙生物	4,446,921.12	22.82
70	688579	山大地纬软件	4,403,938.79	22.60
71	002475	立讯精密	4,344,495.00	22.30
72	688403	汇成股份	4,329,547.34	22.22
73	688082	盛美上海半导体	4,319,696.49	22.17
74	002027	分众传媒	4,319,559.00	22.17
75	688128	中国电器研究院	4,218,998.18	21.65
76	688468	科美诊断	4,215,574.08	21.64
77	600572	康恩贝	4,185,699.00	21.48
78	688586	中航飞机装备	4,136,433.66	21.23
79	688352	颀中科技	4,125,853.75	21.17
80	002913	奥士康	4,119,321.00	21.14
81	688630	芯碁微装	4,086,523.51	20.97

82	603806	福斯特	4,085,850.00	20.97
83	688041	海光信息	4,085,452.06	20.97
84	688566	吉贝尔药业	4,063,546.93	20.85
85	688123	聚辰半导体	4,043,536.09	20.75
86	688271	联影医疗	4,043,387.57	20.75
87	688295	中复神鹰碳纤维	4,025,544.29	20.66
88	600031	三一重工	4,019,350.00	20.63
89	688037	芯源微电子	3,991,943.50	20.49
90	600458	时代新材	3,986,982.00	20.46
91	688173	希荻微电子	3,967,891.19	20.36
92	603218	日月股份	3,949,806.00	20.27
93	300102	乾照光电	3,923,866.05	20.14
94	600707	彩虹股份	3,890,490.00	19.97
95	688676	海南金盘智能科技	3,875,464.45	19.89
96	688010	福光股份	3,848,912.01	19.75
97	688212	澳华内镜	3,794,332.96	19.47
98	688049	炬芯科技	3,776,220.36	19.38
99	002056	横店东磁	3,772,635.00	19.36
100	600309	万华化学	3,752,420.00	19.26
101	600373	中文传媒	3,741,246.45	19.20
102	688179	阿拉丁科技	3,736,561.92	19.18
103	688183	生益电子	3,720,648.12	19.09
104	688359	三孚新材料科技	3,717,630.93	19.08
105	688389	深圳普门科技	3,717,530.53	19.08
106	688526	武汉科前生物	3,709,406.68	19.04
107	600267	海正药业	3,673,240.00	18.85
108	688331	荣昌生物	3,658,485.76	18.78
109	688375	国博电子	3,655,004.32	18.76
110	688798	艾为电子	3,653,243.40	18.75
111	688127	蓝特光学	3,646,586.51	18.71
112	688508	芯朋微电子	3,626,804.35	18.61
113	688366	昊海生物科技	3,599,638.96	18.47
114	000739	普洛药业	3,588,177.00	18.42
115	002632	道明光学	3,555,627.00	18.25
116	688003	天准科技	3,552,466.98	18.23
117	688091	上海谊众药业	3,545,173.99	18.19
118	000597	东北制药	3,537,815.76	18.16
119	688065	凯赛生物	3,499,975.44	17.96
120	601567	三星医疗	3,490,155.00	17.91
121	688596	正帆科技	3,486,298.69	17.89

122	600498	烽火通信	3,482,244.00	17.87
123	688195	腾景科技	3,455,862.31	17.74
124	688032	禾迈股份	3,420,912.33	17.56
125	688311	盟升电子	3,363,982.38	17.26
126	603169	兰石重装	3,339,968.00	17.14
127	688122	西部超导	3,331,784.47	17.10
128	002384	东山精密	3,325,347.00	17.07
129	688095	福昕软件开发	3,308,761.59	16.98
130	601231	环旭电子	3,307,564.00	16.97
131	600062	华润双鹤	3,306,907.00	16.97
132	000063	中兴通讯	3,300,154.00	16.94
133	688326	经纬恒润	3,295,339.34	16.91
134	600380	健康元	3,276,536.00	16.82
135	300319	麦捷科技	3,248,533.00	16.67
136	688475	萤石网络	3,227,074.91	16.56
137	002648	卫星化学	3,216,366.00	16.51
138	000997	新大陆	3,201,078.00	16.43
139	600183	生益科技	3,192,335.00	16.38
140	688150	莱特光电股份	3,175,722.10	16.30
141	002129	TCL 中环	3,162,811.51	16.23
142	600667	太极实业	3,147,051.00	16.15
143	600893	航发动力	3,145,570.00	16.14
144	688100	威胜信息	3,132,218.86	16.08
145	603118	共进股份	3,131,736.64	16.07
146	300408	三环集团	3,127,059.00	16.05
147	688005	容百科技	3,120,309.67	16.01
148	002463	沪电股份	3,111,769.00	15.97
149	000738	航发控制	3,091,622.00	15.87
150	600570	恒生电子	3,081,284.96	15.81
151	300759	康龙化成	3,080,047.00	15.81
152	002007	华兰生物	3,023,461.00	15.52
153	600351	亚宝药业	3,015,419.00	15.48
154	688299	长阳科技	3,014,776.30	15.47
155	603328	依顿电子	3,008,307.00	15.44
156	002273	水晶光电	3,002,802.00	15.41
157	688722	同益中新材料	2,986,982.20	15.33
158	688609	广东九联科技	2,985,293.25	15.32
159	688400	凌云光技术	2,984,288.26	15.32
160	300724	捷佳伟创	2,953,179.00	15.16
161	688598	金博碳素股份	2,939,426.14	15.09
162	300735	光弘科技	2,918,395.00	14.98
163	002601	龙佰集团	2,904,390.00	14.91
164	688519	南亚新材料	2,889,110.41	14.83

165	688336	三生国健	2,887,522.54	14.82
166	002635	安洁科技	2,843,400.00	14.59
167	688778	厦钨新能源	2,821,111.66	14.48
168	688613	奥精医疗	2,777,267.40	14.25
169	300709	精研科技	2,776,351.00	14.25
170	601633	长城汽车	2,770,155.00	14.22
171	688800	瑞可达连接系统	2,758,795.90	14.16
172	688276	长春百克生物科技	2,722,744.27	13.97
173	601126	四方股份	2,700,038.00	13.86
174	688388	嘉元科技	2,685,281.99	13.78
175	688357	建龙微纳	2,682,045.40	13.76
176	300457	赢合科技	2,677,625.00	13.74
177	688510	航亚科技	2,650,178.67	13.60
178	603567	珍宝岛	2,631,538.00	13.51
179	688680	海优新材	2,630,737.12	13.50
180	002739	万达电影	2,626,819.00	13.48
181	600583	海油工程	2,603,880.00	13.36
182	688177	百奥泰生物	2,591,298.35	13.30
183	688503	聚和材料股份公司	2,584,811.89	13.27
184	002555	三七互娱	2,581,572.00	13.25
185	688556	高测科技股份	2,561,403.26	13.15
186	688162	巨一科技	2,534,023.92	13.01
187	600571	信雅达	2,532,525.00	13.00
188	301239	普瑞眼科	2,529,411.00	12.98
189	688239	贵州航宇科技	2,492,106.64	12.79
190	688678	福立旺精密	2,482,792.50	12.74
191	688381	帝奥微电子	2,455,096.43	12.60
192	002073	软控股份	2,451,970.00	12.58
193	688225	亚信安全	2,450,785.01	12.58
194	688739	成大生物	2,424,758.63	12.44
195	688023	安恒信息	2,412,551.20	12.38
196	002459	晶澳科技	2,398,699.80	12.31
197	300719	安达维尔	2,395,692.00	12.30
198	601369	陕鼓动力	2,388,131.00	12.26
199	002130	沃尔核材	2,359,455.00	12.11
200	002644	佛慈制药	2,356,745.00	12.10
201	688337	普源精电	2,356,679.01	12.09
202	688185	康希诺生物	2,353,964.55	12.08
203	688668	鼎通科技	2,352,032.08	12.07
204	300033	同花顺	2,333,524.00	11.98

205	688561	奇安信集团	2,322,017.51	11.92
206	601608	中信重工	2,321,762.00	11.92
207	002415	海康威视	2,320,923.00	11.91
208	601766	中国中车	2,292,840.00	11.77
209	688046	药康生物	2,280,789.86	11.71
210	688569	铁科轨道	2,275,023.59	11.68
211	000682	东方电子	2,271,007.61	11.66
212	002990	盛视科技	2,270,115.00	11.65
213	000768	中航西飞	2,263,342.00	11.62
214	688020	方邦股份	2,262,069.34	11.61
215	002046	国机精工	2,251,549.00	11.56
216	300219	鸿利智汇	2,240,498.00	11.50
217	002165	红宝丽	2,236,977.00	11.48
218	002107	沃华医药	2,213,016.00	11.36
219	688601	力芯微股份	2,212,025.96	11.35
220	600862	中航高科	2,199,901.00	11.29
221	000919	金陵药业	2,190,224.00	11.24
222	603658	安图生物	2,181,954.00	11.20
223	688292	浩瀚深度信息 技术	2,179,182.93	11.18
224	000969	安泰科技	2,174,050.66	11.16
225	002534	西子洁能	2,172,539.00	11.15
226	688267	中触媒股份	2,166,719.93	11.12
227	000862	银星能源	2,164,929.00	11.11
228	600479	千金药业	2,163,479.00	11.10
229	688589	力合微电子	2,162,815.57	11.10
230	603920	世运电路	2,159,514.00	11.08
231	300316	晶盛机电	2,157,616.00	11.07
232	002249	大洋电机	2,156,708.00	11.07
233	601989	中国重工	2,154,128.00	11.06
234	688181	八亿时空液晶 股份	2,153,565.29	11.05
235	603613	国联股份	2,144,106.00	11.00
236	300274	阳光电源	2,142,692.00	11.00
237	603993	洛阳钼业	2,142,125.00	10.99
238	002531	天顺风能	2,135,730.00	10.96
239	688079	美迪凯股份	2,129,147.70	10.93
240	688349	三一重能	2,123,202.80	10.90
241	688799	华纳大药厂	2,113,143.22	10.84
242	002322	理工能科	2,095,519.00	10.75
243	600562	国睿科技	2,058,031.00	10.56
244	603338	浙江鼎力	2,057,459.00	10.56
245	688321	微芯生物	2,054,352.84	10.54

246	000999	华润三九	2,037,740.00	10.46
247	688019	安集科技	2,031,598.39	10.43
248	688484	南芯科技	2,022,041.90	10.38
249	002938	鹏鼎控股	2,017,997.72	10.36
250	000551	创元科技	2,016,982.00	10.35
251	688186	张家港广大特材	2,011,018.91	10.32
252	688259	创耀通信科技	2,009,988.84	10.32
253	600594	益佰制药	2,002,270.00	10.28
254	600765	中航重机	1,989,067.00	10.21
255	688626	翔宇医疗	1,988,707.44	10.21
256	300476	胜宏科技	1,987,561.00	10.20
257	688206	概伦电子	1,981,916.33	10.17
258	000920	沃顿科技	1,981,104.00	10.17
259	300750	宁德时代	1,967,389.00	10.10
260	603444	吉比特	1,965,408.00	10.09
261	300232	洲明科技	1,955,146.00	10.03
262	000661	长春高新	1,949,908.00	10.01
263	688278	特宝生物	1,945,362.58	9.98
264	600500	中化国际	1,926,299.00	9.89
265	300158	振东制药	1,925,758.00	9.88
266	688315	诺禾致源科技	1,924,969.77	9.88
267	601100	恒立液压	1,919,622.00	9.85
268	688378	奥来德光电	1,913,189.90	9.82
269	688472	阿特斯阳光电力	1,907,187.48	9.79
270	600038	中直股份	1,898,306.00	9.74
271	688022	瀚川智能	1,879,857.68	9.65
272	603893	瑞芯微	1,869,633.00	9.60
273	300285	国瓷材料	1,858,086.85	9.54
274	300454	深信服	1,857,374.00	9.53
275	600161	天坛生物	1,852,730.40	9.51
276	688305	科德数控	1,851,668.69	9.50
277	300782	卓胜微	1,849,954.00	9.49
278	301339	通行宝	1,836,657.00	9.43
279	688686	奥普特科技	1,831,842.88	9.40
280	688608	恒玄科技	1,827,649.04	9.38
281	688348	昱能科技	1,825,172.00	9.37
282	688222	成都先导	1,823,620.94	9.36
283	600271	航天信息	1,818,246.00	9.33
284	300919	中伟股份	1,817,375.00	9.33
285	002378	章源钨业	1,814,397.00	9.31
286	002483	润邦股份	1,810,155.00	9.29

287	600535	天士力	1,797,283.00	9.22
288	301257	普蕊斯	1,796,991.00	9.22
289	002351	漫步者	1,793,479.00	9.20
290	600812	华北制药	1,792,405.00	9.20
291	688166	博瑞生物医药	1,778,930.97	9.13
292	688663	新风光科技	1,767,912.70	9.07
293	688052	纳芯微电子	1,762,569.74	9.05
294	688300	联瑞新材	1,752,367.45	8.99
295	688687	北京凯因科技	1,751,709.03	8.99
296	300558	贝达药业	1,741,792.00	8.94
297	600580	卧龙电驱	1,740,515.00	8.93
298	688196	卓越新能	1,727,041.64	8.86
299	000519	中兵红箭	1,717,681.00	8.82
300	600875	东方电气	1,712,760.00	8.79
301	002467	二六三	1,696,157.00	8.70
302	600316	洪都航空	1,688,787.00	8.67
303	600756	浪潮软件	1,687,073.00	8.66
304	688131	皓元医药	1,685,624.99	8.65
305	688147	微导纳米科技	1,680,263.02	8.62
306	300628	亿联网络	1,674,636.00	8.59
307	688066	北京航天宏图	1,670,781.18	8.57
308	600268	国电南自	1,657,993.00	8.51
309	688580	伟思医疗	1,657,188.17	8.50
310	300034	钢研高纳	1,657,174.00	8.50
311	600114	东睦股份	1,652,604.00	8.48
312	603507	振江股份	1,648,000.00	8.46
313	600211	西藏药业	1,647,092.00	8.45
314	002389	航天彩虹	1,641,691.00	8.43
315	300276	三丰智能	1,639,393.00	8.41
316	688690	纳微科技	1,633,287.99	8.38
317	003022	联泓新科	1,630,106.00	8.37
318	601208	东材科技	1,627,106.00	8.35
319	688210	泛海统联精密 制造	1,624,744.92	8.34
320	600760	中航沈飞	1,620,719.00	8.32
321	300768	迪普科技	1,620,015.00	8.31
322	600894	广日股份	1,619,223.00	8.31
323	002139	拓邦股份	1,606,029.00	8.24
324	688621	阳光诺和	1,591,739.77	8.17
325	688499	广东利元亨	1,582,417.64	8.12
326	601958	金钼股份	1,560,148.00	8.01
327	002421	达实智能	1,556,010.00	7.99
328	600063	皖维高新	1,539,848.00	7.90

329	300760	迈瑞医疗	1,539,420.00	7.90
330	300510	金冠股份	1,528,299.20	7.84
331	688016	心脉医疗	1,527,265.65	7.84
332	002841	视源股份	1,524,138.00	7.82
333	002519	银河电子	1,521,762.00	7.81
334	002111	威海广泰	1,519,951.00	7.80
335	300383	光环新网	1,512,356.00	7.76
336	002017	东信和平	1,509,555.00	7.75
337	002266	浙富控股	1,506,059.00	7.73
338	688320	禾川科技	1,504,129.85	7.72
339	600468	百利电气	1,480,723.00	7.60
340	300413	芒果超媒	1,479,563.00	7.59
341	002533	金杯电工	1,477,677.00	7.58
342	300602	飞荣达	1,473,917.00	7.56
343	603063	禾望电气	1,465,752.00	7.52
344	300376	易事特	1,463,644.00	7.51
345	600588	用友网络	1,462,055.30	7.50
346	688205	德科立光电子	1,460,150.75	7.49
347	601619	嘉泽新能	1,458,968.00	7.49
348	002236	大华股份	1,457,816.00	7.48
349	300101	振芯科技	1,455,292.00	7.47
350	000050	深天马 A	1,448,350.00	7.43
351	300566	激智科技	1,447,912.36	7.43
352	600685	中船防务	1,444,742.00	7.41
353	603989	艾华集团	1,441,829.00	7.40
354	002550	千红制药	1,441,366.00	7.40
355	600613	神奇制药	1,440,668.00	7.39
356	603015	弘讯科技	1,434,471.00	7.36
357	688258	江苏卓易信息 科技	1,423,357.42	7.30
358	002241	歌尔股份	1,420,393.00	7.29
359	000973	佛塑科技	1,420,115.00	7.29
360	688351	微创电生理股 份	1,419,164.43	7.28
361	688261	东微半导体	1,414,118.86	7.26
362	002410	广联达	1,412,319.00	7.25
363	603508	思维列控	1,411,330.20	7.24
364	601137	博威合金	1,402,401.00	7.20
365	688699	明微电子	1,395,582.57	7.16
366	000823	超声电子	1,392,373.00	7.15
367	688617	惠泰医疗	1,379,908.50	7.08
368	300194	福安药业	1,375,263.00	7.06
369	603392	万泰生物	1,364,724.00	7.00

370	300145	中金环境	1,336,616.00	6.86
371	000157	中联重科	1,335,384.00	6.85
372	600797	浙大网新	1,333,866.00	6.85
373	688226	威腾电气集团 股份	1,333,284.57	6.84
374	601179	中国西电	1,330,374.00	6.83
375	003029	吉大正元	1,317,415.00	6.76
376	600728	佳都科技	1,315,791.00	6.75
377	002252	上海莱士	1,309,518.00	6.72
378	300025	华星创业	1,308,942.00	6.72
379	000963	华东医药	1,308,551.00	6.72
380	600105	永鼎股份	1,308,178.00	6.71
381	601616	广电电气	1,303,002.00	6.69
382	600867	通化东宝	1,300,938.00	6.68
383	688112	鼎阳科技	1,286,542.00	6.60
384	600206	有研新材	1,284,758.00	6.59
385	601908	京运通	1,282,251.00	6.58
386	002745	木林森	1,276,255.00	6.55
387	002138	顺络电子	1,271,746.00	6.53
388	603416	信捷电气	1,270,526.00	6.52
389	300763	锦浪科技	1,269,378.00	6.51
390	688068	热景生物	1,268,998.59	6.51
391	002611	东方精工	1,248,701.00	6.41
392	688399	硕世生物	1,246,986.74	6.40
393	300747	锐科激光	1,242,678.00	6.38
394	002558	巨人网络	1,241,812.00	6.37
395	688209	英集芯科技	1,235,280.86	6.34
396	300667	必创科技	1,234,318.00	6.33
397	002559	亚威股份	1,233,960.00	6.33
398	300305	裕兴股份	1,232,265.00	6.32
399	300679	电连技术	1,226,786.00	6.30
400	688168	北京安博通	1,224,688.84	6.29
401	688078	龙软科技	1,221,592.95	6.27
402	600745	闻泰科技	1,221,157.00	6.27
403	688055	昆山龙腾光电	1,219,234.00	6.26
404	688505	复旦张江股份	1,217,190.26	6.25
405	688071	华依科技集团	1,215,046.24	6.24
406	601985	中国核电	1,212,609.94	6.22
407	300671	富满微	1,212,460.00	6.22
408	002594	比亚迪	1,212,376.00	6.22
409	300751	迈为股份	1,205,780.00	6.19
410	300377	赢时胜	1,203,707.00	6.18
411	688568	中科星图公司	1,202,469.09	6.17

412	300347	泰格医药	1,202,198.00	6.17
413	300199	翰宇药业	1,199,619.00	6.16
414	603421	鼎信通讯	1,175,522.00	6.03
415	688252	天德钰科技	1,174,247.81	6.03
416	600718	东软集团	1,173,454.00	6.02
417	688398	赛特新材	1,161,901.23	5.96
418	600563	法拉电子	1,150,699.00	5.91
419	300241	瑞丰光电	1,146,342.00	5.88
420	300699	光威复材	1,142,779.00	5.86
421	002179	中航光电	1,137,338.40	5.84
422	300207	欣旺达	1,130,634.00	5.80
423	600869	远东股份	1,119,768.00	5.75
424	300414	中光防雷	1,113,486.00	5.71
425	600418	江淮汽车	1,112,964.00	5.71
426	600196	复星医药	1,109,258.00	5.69
427	600320	振华重工	1,103,532.00	5.66
428	002915	中欣氟材	1,103,314.00	5.66
429	002449	国星光电	1,100,014.00	5.65
430	601012	隆基绿能	1,096,958.00	5.63
431	600143	金发科技	1,096,839.00	5.63
432	688228	开普云信息科技	1,091,422.92	5.60
433	688700	东威科技	1,083,819.76	5.56
434	688121	卓然技术	1,075,812.56	5.52
435	688202	美迪西生物医药	1,068,964.93	5.49
436	688050	爱博诺德医疗	1,066,414.30	5.47
437	300114	中航电测	1,066,131.00	5.47
438	600584	长电科技	1,062,604.00	5.45
439	300248	新开普	1,060,099.00	5.44
440	300872	天阳科技	1,059,027.17	5.44
441	000636	风华高科	1,055,555.00	5.42
442	300246	宝莱特	1,049,006.00	5.38
443	603303	得邦照明	1,048,832.00	5.38
444	600391	航发科技	1,048,790.00	5.38
445	688639	华恒生物	1,048,434.35	5.38
446	300014	亿纬锂能	1,045,735.00	5.37
447	688219	会通股份	1,041,997.11	5.35
448	000541	佛山照明	1,041,346.00	5.34
449	603601	再升科技	1,024,399.00	5.26
450	300109	新开源	1,013,162.00	5.20
451	300289	利德曼	1,006,348.00	5.16
452	603628	清源股份	1,000,588.00	5.14

453	002544	普天科技	993,661.00	5.10
454	603283	赛腾股份	992,427.00	5.09
455	688787	海天瑞声	991,465.74	5.09
456	002669	康达新材	988,815.00	5.07
457	002880	卫光生物	985,037.00	5.06
458	600537	亿晶光电	982,451.00	5.04
459	002730	电光科技	971,461.00	4.99
460	688153	唯捷创芯	967,589.60	4.97
461	688246	嘉和美康科技	967,150.66	4.96
462	002522	浙江众成	966,496.00	4.96
463	301095	广立微	962,898.00	4.94
464	000938	紫光股份	961,313.00	4.93
465	300111	向日葵	959,314.00	4.92
466	002518	科士达	958,584.00	4.92
467	688157	松井新材料	958,199.54	4.92
468	688167	西安炬光科技	946,971.15	4.86
469	688256	寒武纪科技	941,695.00	4.83
470	000066	中国长城	938,381.00	4.82
471	603259	药明康德	936,124.00	4.80
472	002041	登海种业	934,657.00	4.80
473	300685	艾德生物	934,580.00	4.80
474	600851	海欣股份	931,757.00	4.78
475	300976	达瑞电子	923,079.00	4.74
476	002324	普利特	918,813.00	4.72
477	002376	新北洋	916,828.00	4.71
478	002145	中核钛白	914,157.00	4.69
479	300357	我武生物	913,964.00	4.69
480	688269	西安凯立新材	912,827.41	4.68
481	688080	映翰通网络	909,048.20	4.67
482	688133	泰坦股份	907,469.12	4.66
483	688238	和元生物	905,113.22	4.65
484	603383	顶点软件	901,649.00	4.63
485	600332	白云山	896,027.00	4.60
486	603330	天洋新材	895,857.00	4.60
487	688073	毕得医药科技股份	895,505.00	4.60
488	002036	联创电子	894,798.00	4.59
489	002380	科远智慧	891,350.00	4.57
490	688358	祥生医疗科技	890,789.17	4.57
491	300046	台基股份	889,845.00	4.57
492	002373	千方科技	887,651.00	4.56
493	601360	三六零	886,308.00	4.55
494	002912	中新赛克	883,837.00	4.54

495	688329	苏州艾隆科技	883,040.32	4.53
496	300378	鼎捷软件	879,889.00	4.52
497	000423	东阿阿胶	879,282.00	4.51
498	300520	科大国创	869,019.00	4.46
499	600775	南京熊猫	867,555.00	4.45
500	688677	青岛海泰新光	865,756.85	4.44
501	688533	上声电子股份	859,065.07	4.41
502	688172	燕东微电子股份	858,952.91	4.41
503	300533	冰川网络	858,241.00	4.40
504	300292	吴通控股	848,282.00	4.35
505	600475	华光环能	842,400.00	4.32
506	002923	润都股份	836,136.00	4.29
507	002869	金溢科技	834,367.00	4.28
508	600973	宝胜股份	834,341.00	4.28
509	600329	达仁堂	829,588.00	4.26
510	002298	中电兴发	828,320.00	4.25
511	688076	诺泰生物	823,008.00	4.22
512	002838	道恩股份	821,420.00	4.22
513	688718	唯赛勃科技	821,283.56	4.21
514	000875	吉电股份	818,829.00	4.20
515	688301	奕瑞科技股份	817,702.08	4.20
516	300183	东软载波	813,753.10	4.18
517	688039	当虹科技	810,799.32	4.16
518	300803	指南针	810,744.00	4.16
519	688456	有研粉材	805,783.74	4.14
520	002136	安纳达	802,207.00	4.12
521	002810	山东赫达	800,732.00	4.11
522	603309	维力医疗	799,130.00	4.10
523	002335	科华数据	796,515.00	4.09
524	002465	海格通信	796,335.00	4.09
525	603236	移远通信	793,085.00	4.07
526	002484	江海股份	792,018.00	4.06
527	688289	圣湘生物	791,288.97	4.06
528	300230	永利股份	790,959.00	4.06
529	600501	航天晨光	773,700.00	3.97
530	000962	东方钨业	772,735.00	3.97
531	002546	新联电子	771,973.00	3.96
532	300532	今天国际	769,383.00	3.95
533	600200	江苏吴中	768,512.00	3.94
534	688391	钜泉科技	766,844.46	3.94
535	688102	陕西斯瑞新材股份	765,302.95	3.93

536	002169	智光电气	763,163.00	3.92
537	688093	世华科技	761,565.12	3.91
538	300404	博济医药	760,700.00	3.90
539	688200	华峰测控	760,040.00	3.90
540	300127	银河磁体	759,512.00	3.90
541	688518	联赢激光股份	759,324.53	3.90
542	300426	唐德影视	751,208.00	3.86
543	600732	爱旭股份	749,979.00	3.85
544	601611	中国核建	745,208.00	3.82
545	600237	铜峰电子	743,811.00	3.82
546	688317	上海之江生物	735,423.44	3.77
547	002446	盛路通信	735,257.00	3.77
548	000544	中原环保	733,818.00	3.77
549	688161	威高骨科	732,587.42	3.76
550	603501	韦尔股份	729,322.00	3.74
551	300326	凯利泰	727,440.00	3.73
552	688035	德邦科技股份	725,250.76	3.72
553	600085	同仁堂	724,906.00	3.72
554	000538	云南白药	724,692.00	3.72
555	002566	益盛药业	721,680.00	3.70
556	300777	中简科技	714,542.00	3.67
557	002922	伊戈尔	714,288.00	3.67
558	688667	菱电电控	710,570.00	3.65
559	688383	新益昌科技	710,484.00	3.65
560	002223	鱼跃医疗	710,428.00	3.65
561	688551	科威尔股份	706,796.64	3.63
562	688146	中船派瑞特气	701,159.00	3.60
563	688260	昀冢科技	699,740.12	3.59
564	300115	长盈精密	698,131.00	3.58
565	300239	东宝生物	694,159.00	3.56
566	688369	致远互联	693,968.00	3.56
567	002288	超华科技	691,094.00	3.55
568	002452	长高电新	687,732.00	3.53
569	688306	均普智能制造	681,743.38	3.50
570	688232	国泰新点软件	680,310.00	3.49
571	603659	璞泰来	678,043.00	3.48
572	002771	真视通	676,469.00	3.47
573	300059	东方财富	674,293.00	3.46
574	601615	明阳智能	674,055.00	3.46
575	688028	沃尔德金刚石	669,176.71	3.43
576	601717	郑煤机	665,911.00	3.42
577	002602	世纪华通	662,459.00	3.40
578	603258	电魂网络	658,951.00	3.38

579	688198	佰仁医疗科技	654,745.63	3.36
580	000657	中钨高新	650,025.00	3.34
581	601808	中海油服	647,596.00	3.32
582	688517	金冠电气	643,168.73	3.30
583	603396	金辰股份	637,343.00	3.27
584	600763	通策医疗	635,913.00	3.26
585	300638	广和通	634,613.00	3.26
586	600363	联创光电	632,744.00	3.25
587	002338	奥普光电	625,558.00	3.21
588	300842	帝科股份	623,046.00	3.20
589	600645	中源协和	622,234.00	3.19
590	688048	长光华芯	619,069.39	3.18
591	000650	仁和药业	615,202.00	3.16
592	300465	高伟达	613,713.00	3.15
593	300308	中际旭创	612,395.00	3.14
594	600292	远达环保	608,472.00	3.12
595	688662	广东富信科技	597,303.00	3.07
596	688522	纳睿雷达科技	591,055.09	3.03
597	300206	理邦仪器	590,496.00	3.03
598	002649	博彦科技	583,765.00	3.00
599	300161	华中数控	580,461.00	2.98
600	002479	富春环保	579,862.00	2.98
601	000513	丽珠集团	575,581.00	2.95
602	003035	南网能源	574,953.00	2.95
603	688189	南新制药	572,302.84	2.94
604	300098	高新兴	572,054.00	2.94
605	603533	掌阅科技	567,810.00	2.91
606	688401	路维光电	565,048.63	2.90
607	002970	锐明技术	564,970.00	2.90
608	002851	麦格米特	564,519.00	2.90
609	300017	网宿科技	563,821.00	2.89
610	000625	长安汽车	557,467.00	2.86
611	688636	智明达电子	555,283.44	2.85
612	000623	吉林敖东	548,359.00	2.81
613	688733	壹石通	546,282.67	2.80
614	688275	万润新能源	538,944.00	2.77
615	688170	德龙激光	535,678.24	2.75
616	002038	双鹭药业	533,161.00	2.74
617	600435	北方导航	530,865.00	2.72
618	000055	方大集团	530,157.00	2.72
619	600592	龙溪股份	529,922.00	2.72
620	300310	宜通世纪	528,046.00	2.71
621	300706	阿石创	519,477.00	2.67

622	000400	许继电气	517,302.00	2.65
623	300578	会畅通讯	517,091.00	2.65
624	301183	东田微	502,648.00	2.58
625	003021	兆威机电	502,176.00	2.58
626	300020	银江技术	496,483.00	2.55
627	603663	三祥新材	494,333.00	2.54
628	301123	奕东电子	493,705.00	2.53
629	300493	润欣科技	488,884.00	2.51
630	601222	林洋能源	488,814.00	2.51
631	002097	山河智能	487,585.00	2.50
632	600222	太龙药业	485,726.00	2.49
633	300380	安硕信息	484,271.00	2.49
634	300035	中科电气	482,041.41	2.47
635	300150	世纪瑞尔	480,186.00	2.46
636	600850	电科数字	475,576.00	2.44
637	688025	杰普特光电	471,122.00	2.42
638	603515	欧普照明	465,182.00	2.39
639	688190	云路先进材料 股份	462,319.18	2.37
640	300133	华策影视	458,592.00	2.35
641	688058	宝兰德软件	457,714.72	2.35
642	600151	航天机电	455,598.00	2.34
643	300466	赛摩智能	455,577.00	2.34
644	002119	康强电子	454,331.00	2.33
645	601016	节能风电	451,385.69	2.32
646	603611	诺力股份	450,098.00	2.31
647	300129	泰胜风能	444,888.00	2.28
648	688152	麒麟信安	437,702.00	2.25
649	002815	崇达技术	435,372.00	2.23
650	600410	华胜天成	433,371.00	2.22
651	600482	中国动力	433,113.00	2.22
652	300448	浩云科技	432,843.00	2.22
653	688262	苏州国芯科技	432,671.16	2.22
654	688227	品高股份	430,762.00	2.21
655	300615	欣天科技	430,031.00	2.21
656	300113	顺网科技	428,728.00	2.20
657	688257	新锐股份	423,799.98	2.18
658	601218	吉鑫科技	422,652.00	2.17
659	688330	宏力达信息	422,088.76	2.17
660	300314	戴维医疗	419,314.00	2.15
661	300409	道氏技术	418,852.00	2.15
662	688338	赛科希德	416,738.00	2.14
663	688585	上纬新材	416,338.00	2.14

664	300822	贝仕达克	411,373.00	2.11
665	002623	亚玛顿	409,063.00	2.10
666	002065	东华软件	408,386.00	2.10
667	300112	万讯自控	407,785.00	2.09
668	300259	新天科技	406,380.00	2.09
669	002414	高德红外	399,295.00	2.05
670	300078	思创医惠	396,372.00	2.03
671	300738	奥飞数据	392,261.00	2.01
672	002491	通鼎互联	392,260.00	2.01

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	688111	金山办公	18,922,682.82	97.11
2	688036	传音控股	16,033,549.68	82.29
3	688981	中芯国际	14,179,405.36	72.77
4	688223	晶科能源	13,845,126.96	71.06
5	688126	上海硅产业集团	13,355,815.86	68.54
6	688599	天合光能	12,268,010.73	62.96
7	688012	中微半导体设备	12,076,829.97	61.98
8	688578	艾力斯医药科技	12,074,271.97	61.97
9	688772	珠海冠宇电池	10,774,723.24	55.30
10	688187	时代电气	10,765,179.81	55.25
11	688169	石头科技	9,203,883.39	47.24
12	688072	拓荆科技	9,032,390.86	46.36
13	688777	中控技术	8,535,412.98	43.81
14	688396	华润微电子	8,367,195.99	42.94
15	688007	光峰科技	8,028,739.27	41.20
16	688009	中国通号	7,782,025.26	39.94
17	600050	中国联通	7,534,466.03	38.67
18	688002	睿创微纳	7,498,829.93	38.49
19	688107	安路科技	7,357,679.74	37.76
20	688029	南微医学科技	7,237,339.62	37.14
21	688139	海尔生物	7,158,789.08	36.74
22	688138	清溢光电	6,860,466.33	35.21
23	688390	固德威电源	6,837,960.83	35.09
24	688234	天岳先进	6,717,678.12	34.48

25	688439	振华风光	6,658,484.18	34.17
26	688006	浙江杭可科技	6,551,674.13	33.62
27	688711	江苏宏微科技	6,507,615.13	33.40
28	688363	华熙生物	6,409,634.99	32.90
29	688120	华海清科	6,198,543.96	31.81
30	002916	深南电路	6,128,140.00	31.45
31	000100	TCL 科技	6,108,483.26	31.35
32	688819	天能电池集团 股份	5,999,350.05	30.79
33	688332	中科蓝讯	5,975,828.42	30.67
34	002600	领益智造	5,948,764.00	30.53
35	688588	凌志软件	5,897,475.24	30.27
36	688063	派能科技	5,782,598.54	29.68
37	688318	财富趋势	5,751,547.68	29.52
38	688425	铁建重工	5,728,903.84	29.40
39	688008	澜起科技	5,694,170.79	29.22
40	688408	中信博新能源	5,650,713.26	29.00
41	688106	金宏气体	5,649,504.04	28.99
42	000725	京东方 A	5,627,328.00	28.88
43	000045	深纺织 A	5,578,678.00	28.63
44	688559	海目星激光	5,474,516.26	28.10
45	603228	景旺电子	5,296,189.06	27.18
46	688385	复旦微电	5,264,298.95	27.02
47	688658	悦康药业	5,148,321.51	26.42
48	688188	上海柏楚电子 科技	5,128,126.37	26.32
49	688208	道通科技	4,950,540.02	25.41
50	688135	利扬芯片	4,935,873.64	25.33
51	688248	南方电网电力 科技	4,922,139.74	25.26
52	688368	晶丰明源半导 体	4,883,246.39	25.06
53	688148	芳源股份	4,820,344.87	24.74
54	688088	虹软科技	4,741,567.46	24.33
55	688590	新致软件	4,737,197.68	24.31
56	688207	格灵深瞳	4,656,169.46	23.90
57	600789	鲁抗医药	4,620,655.00	23.71
58	601600	中国铝业	4,615,648.00	23.69
59	688509	正元地信	4,605,505.67	23.64
60	688516	奥特维科技	4,571,845.39	23.46
61	688018	乐鑫科技	4,535,863.14	23.28
62	688579	山大地纬软件	4,519,429.11	23.19
63	300433	蓝思科技	4,512,909.00	23.16

64	688575	XD 亚辉龙生物	4,492,863.67	23.06
65	002475	立讯精密	4,481,504.00	23.00
66	688099	晶晨半导体	4,461,481.75	22.90
67	688128	中国电器研究院	4,452,287.84	22.85
68	688352	颀中科技	4,409,751.16	22.63
69	688082	盛美上海半导体	4,358,352.97	22.37
70	688083	中望软件	4,348,935.32	22.32
71	002027	分众传媒	4,342,147.00	22.28
72	688122	西部超导	4,243,942.95	21.78
73	688630	芯碁微装	4,228,856.70	21.70
74	688566	吉贝尔药业	4,217,453.02	21.64
75	688041	海光信息	4,174,703.54	21.43
76	688521	芯原微电子	4,173,688.01	21.42
77	688037	芯源微电子	4,162,021.73	21.36
78	600572	康恩贝	4,146,456.00	21.28
79	688779	长远锂科	4,119,517.46	21.14
80	688295	中复神鹰碳纤维	4,086,158.43	20.97
81	688676	海南金盘智能科技	4,049,462.18	20.78
82	600458	时代新材	4,031,064.00	20.69
83	600707	彩虹股份	4,010,477.00	20.58
84	688468	科美诊断	4,007,898.67	20.57
85	600031	三一重工	4,001,657.00	20.54
86	688123	聚辰半导体	3,992,418.33	20.49
87	603806	福斯特	3,959,244.60	20.32
88	688403	汇成股份	3,953,033.70	20.29
89	688707	振华新材料	3,937,407.13	20.21
90	600373	中文传媒	3,924,384.60	20.14
91	688183	生益电子	3,787,147.87	19.44
92	688010	福光股份	3,769,751.15	19.35
93	600309	万华化学	3,750,922.00	19.25
94	688287	观典防务	3,745,096.74	19.22
95	002056	横店东磁	3,736,050.00	19.17
96	688212	澳华内镜	3,711,717.67	19.05
97	603218	日月股份	3,706,602.00	19.02
98	688173	希荻微电子	3,699,761.82	18.99
99	688271	联影医疗	3,666,819.79	18.82
100	601567	三星医疗	3,660,918.00	18.79
101	688179	阿拉丁科技	3,627,574.20	18.62
102	688526	武汉科前生物	3,602,736.14	18.49

103	600267	海正药业	3,597,700.00	18.46
104	688331	荣昌生物	3,597,277.56	18.46
105	688359	三孚新材料科技	3,593,731.15	18.44
106	000063	中兴通讯	3,584,299.99	18.40
107	002632	道明光学	3,570,798.00	18.33
108	688195	腾景科技	3,555,849.49	18.25
109	688596	正帆科技	3,548,318.64	18.21
110	688127	蓝特光学	3,541,890.64	18.18
111	000739	普洛药业	3,531,068.00	18.12
112	688032	禾迈股份	3,520,547.46	18.07
113	688091	上海谊众药业	3,518,477.93	18.06
114	601231	环旭电子	3,489,123.00	17.91
115	688375	国博电子	3,474,601.42	17.83
116	688508	芯朋微电子	3,457,959.28	17.75
117	688311	盟升电子	3,452,865.31	17.72
118	688065	凯赛生物	3,445,040.06	17.68
119	600062	华润双鹤	3,425,541.00	17.58
120	600498	烽火通信	3,422,847.00	17.57
121	600380	健康元	3,366,422.00	17.28
122	603169	兰石重装	3,323,025.00	17.05
123	002463	沪电股份	3,321,238.80	17.05
124	300319	麦捷科技	3,320,185.00	17.04
125	002384	东山精密	3,316,143.00	17.02
126	688586	中航飞机装备	3,305,672.08	16.97
127	688100	威胜信息	3,297,456.73	16.92
128	688326	经纬恒润	3,281,860.40	16.84
129	002648	卫星化学	3,277,854.00	16.82
130	603328	依顿电子	3,248,788.00	16.67
131	300408	三环集团	3,232,831.00	16.59
132	000997	新大陆	3,230,504.00	16.58
133	688556	高测科技股份	3,214,589.95	16.50
134	688389	深圳普门科技	3,197,079.41	16.41
135	600893	航发动力	3,180,088.00	16.32
136	002913	奥士康	3,150,462.00	16.17
137	688005	容百科技	3,142,764.75	16.13
138	688798	艾为电子	3,141,159.04	16.12
139	600667	太极实业	3,104,903.00	15.93
140	000597	东北制药	3,095,706.62	15.89
141	300759	康龙化成	3,090,537.77	15.86
142	688400	凌云光技术	3,070,496.02	15.76
143	300735	光弘科技	3,069,520.00	15.75
144	600183	生益科技	3,061,423.00	15.71

145	688150	莱特光电股份	3,035,981.22	15.58
146	688722	同益中新材料	3,007,096.94	15.43
147	600570	恒生电子	3,003,942.00	15.42
148	603118	共进股份	2,983,753.00	15.31
149	002273	水晶光电	2,967,387.00	15.23
150	688049	炬芯科技	2,933,594.67	15.06
151	002129	TCL 中环	2,924,952.35	15.01
152	688609	广东九联科技	2,907,471.57	14.92
153	688613	奥精医疗	2,844,661.11	14.60
154	688519	南亚新材料	2,836,044.60	14.56
155	002635	安洁科技	2,826,409.00	14.51
156	000738	航发控制	2,810,446.00	14.42
157	688598	金博碳素股份	2,807,994.47	14.41
158	600351	亚宝药业	2,807,535.00	14.41
159	688800	瑞可达连接系统	2,796,047.86	14.35
160	688778	厦钨新能源	2,775,606.32	14.24
161	300102	乾照光电	2,772,024.20	14.23
162	002601	龙佰集团	2,763,763.00	14.18
163	601126	四方股份	2,696,783.00	13.84
164	688177	百奥泰生物	2,683,823.90	13.77
165	688299	长阳科技	2,672,732.27	13.72
166	300457	赢合科技	2,668,695.00	13.70
167	688046	药康生物	2,643,626.09	13.57
168	301239	普瑞眼科	2,585,945.00	13.27
169	603567	珍宝岛	2,584,923.24	13.27
170	688366	昊海生物科技	2,580,409.35	13.24
171	300033	同花顺	2,577,901.00	13.23
172	600571	信雅达	2,575,963.00	13.22
173	688510	航亚科技	2,571,673.80	13.20
174	688225	亚信安全	2,560,263.46	13.14
175	600583	海油工程	2,532,713.00	13.00
176	688388	嘉元科技	2,518,171.86	12.92
177	688239	贵州航宇科技	2,509,120.04	12.88
178	688668	鼎通科技	2,495,916.10	12.81
179	002739	万达电影	2,495,119.00	12.81
180	688678	福立旺精密	2,494,103.54	12.80
181	688680	海优新材	2,463,040.24	12.64
182	002073	软控股份	2,451,149.00	12.58
183	688162	巨一科技	2,432,730.98	12.49
184	601766	中国中车	2,425,412.00	12.45
185	688381	帝奥微电子	2,421,561.08	12.43
186	300719	安达维尔	2,404,911.00	12.34

187	002459	晶澳科技	2,394,427.47	12.29
188	688003	天准科技	2,384,504.14	12.24
189	002990	盛视科技	2,363,244.00	12.13
190	688337	普源精电	2,362,821.20	12.13
191	688185	康希诺生物	2,345,520.28	12.04
192	601608	中信重工	2,321,045.00	11.91
193	300219	鸿利智汇	2,317,284.00	11.89
194	688357	建龙微纳	2,302,068.42	11.81
195	603658	安图生物	2,291,067.00	11.76
196	000682	东方电子	2,286,047.18	11.73
197	688589	力合微电子	2,285,708.07	11.73
198	000919	金陵药业	2,278,343.00	11.69
199	603920	世运电路	2,277,796.00	11.69
200	600862	中航高科	2,276,371.00	11.68
201	688569	铁科轨道	2,270,968.08	11.65
202	688020	方邦股份	2,263,493.24	11.62
203	002130	沃尔核材	2,258,739.00	11.59
204	002415	海康威视	2,253,030.00	11.56
205	688739	成大生物	2,251,032.39	11.55
206	601369	陕鼓动力	2,242,769.00	11.51
207	300724	捷佳伟创	2,241,509.00	11.50
208	688561	奇安信集团	2,237,919.78	11.49
209	000768	中航西飞	2,227,694.64	11.43
210	002534	西子洁能	2,188,398.00	11.23
211	002107	沃华医药	2,182,595.00	11.20
212	002046	国机精工	2,165,126.00	11.11
213	000969	安泰科技	2,163,353.41	11.10
214	601989	中国重工	2,152,608.00	11.05
215	688259	创耀通信科技	2,146,784.68	11.02
216	002249	大洋电机	2,136,754.00	10.97
217	688023	安恒信息	2,133,902.49	10.95
218	300274	阳光电源	2,131,819.00	10.94
219	688181	八亿时空液晶 股份	2,124,837.35	10.91
220	300476	胜宏科技	2,122,350.00	10.89
221	688799	华纳大药厂	2,122,167.64	10.89
222	688475	萤石网络	2,119,542.44	10.88
223	000551	创元科技	2,107,157.00	10.81
224	002644	佛慈制药	2,106,318.00	10.81
225	688079	美迪凯股份	2,101,371.37	10.78
226	688321	微芯生物	2,099,504.91	10.77
227	688349	三一重能	2,095,993.70	10.76
228	000862	银星能源	2,091,600.00	10.73

229	688315	诺禾致源科技	2,078,030.11	10.66
230	603613	国联股份	2,077,828.00	10.66
231	600594	益佰制药	2,067,366.00	10.61
232	002322	理工能科	2,057,440.00	10.56
233	002531	天顺风能	2,052,199.00	10.53
234	002555	三七互娱	2,048,993.00	10.52
235	688278	特宝生物	2,047,157.86	10.51
236	603338	浙江鼎力	2,045,248.00	10.50
237	688626	翔宇医疗	2,040,769.87	10.47
238	002938	鹏鼎控股	2,032,949.00	10.43
239	000920	沃顿科技	2,032,899.98	10.43
240	688019	安集科技	2,030,836.57	10.42
241	000999	华润三九	2,024,847.00	10.39
242	300316	晶盛机电	2,022,073.00	10.38
243	688095	福昕软件开发	1,992,164.48	10.22
244	688186	张家港广大特材	1,981,386.35	10.17
245	688336	三生国健	1,974,793.11	10.13
246	688206	概伦电子	1,956,350.57	10.04
247	300158	振东制药	1,956,174.00	10.04
248	600479	千金药业	1,955,911.00	10.04
249	300750	宁德时代	1,937,731.00	9.94
250	688305	科德数控	1,925,474.80	9.88
251	000661	长春高新	1,909,226.00	9.80
252	601100	恒立液压	1,900,369.00	9.75
253	688686	奥普特科技	1,900,330.63	9.75
254	600500	中化国际	1,893,978.00	9.72
255	603444	吉比特	1,892,627.00	9.71
256	002007	华兰生物	1,891,453.00	9.71
257	688276	长春百克生物科技	1,888,789.72	9.69
258	002351	漫步者	1,888,753.00	9.69
259	600161	天坛生物	1,878,486.80	9.64
260	601633	长城汽车	1,876,872.00	9.63
261	300232	洲明科技	1,869,233.00	9.59
262	603893	瑞芯微	1,866,727.75	9.58
263	688022	瀚川智能	1,862,983.75	9.56
264	688378	奥来德光电	1,861,066.32	9.55
265	600765	中航重机	1,853,259.00	9.51
266	688222	成都先导	1,850,627.63	9.50
267	600038	中直股份	1,840,279.00	9.44
268	688267	中触媒股份	1,834,929.81	9.42
269	300919	中伟股份	1,833,513.00	9.41

270	600562	国睿科技	1,820,903.72	9.35
271	002483	润邦股份	1,816,587.00	9.32
272	600271	航天信息	1,813,358.00	9.31
273	300285	国瓷材料	1,807,857.90	9.28
274	300454	深信服	1,803,634.00	9.26
275	688687	北京凯因科技	1,801,862.00	9.25
276	688608	恒玄科技	1,801,760.49	9.25
277	688052	纳芯微电子	1,784,232.66	9.16
278	300782	卓胜微	1,782,588.00	9.15
279	603993	洛阳钼业	1,781,504.00	9.14
280	002165	红宝丽	1,775,531.00	9.11
281	600535	天士力	1,774,429.00	9.11
282	002378	章源钨业	1,773,696.00	9.10
283	301257	普蕊斯	1,771,567.00	9.09
284	688196	卓越新能	1,765,272.66	9.06
285	688166	博瑞生物医药	1,764,007.67	9.05
286	688601	力芯微股份	1,745,095.32	8.96
287	600114	东睦股份	1,742,045.00	8.94
288	600580	卧龙电驱	1,731,859.00	8.89
289	688580	伟思医疗	1,726,923.00	8.86
290	688066	北京航天宏图	1,720,676.86	8.83
291	688131	皓元医药	1,704,444.76	8.75
292	688663	新风光科技	1,691,520.85	8.68
293	688300	联瑞新材	1,688,824.00	8.67
294	688147	微导纳米科技	1,678,409.92	8.61
295	003022	联泓新科	1,677,188.00	8.61
296	600268	国电南自	1,666,868.72	8.55
297	600760	中航沈飞	1,665,033.00	8.55
298	688348	昱能科技	1,658,767.56	8.51
299	600316	洪都航空	1,653,665.00	8.49
300	002139	拓邦股份	1,651,113.00	8.47
301	601208	东材科技	1,632,256.00	8.38
302	600211	西藏药业	1,630,666.00	8.37
303	300709	精研科技	1,630,569.00	8.37
304	300768	迪普科技	1,630,364.00	8.37
305	600756	浪潮软件	1,626,706.00	8.35
306	600894	广日股份	1,620,985.00	8.32
307	603507	振江股份	1,615,109.00	8.29
308	600685	中船防务	1,612,003.00	8.27
309	600875	东方电气	1,595,833.00	8.19
310	688690	纳微科技	1,594,352.99	8.18
311	002389	航天彩虹	1,590,965.00	8.17
312	688621	阳光诺和	1,589,516.42	8.16

313	002421	达实智能	1,587,070.00	8.15
314	300276	三丰智能	1,584,050.00	8.13
315	002236	大华股份	1,582,630.00	8.12
316	601958	金钼股份	1,570,838.00	8.06
317	300034	钢研高纳	1,556,245.00	7.99
318	002519	银河电子	1,551,041.00	7.96
319	688499	广东利元亨	1,550,516.52	7.96
320	300602	飞荣达	1,538,520.50	7.90
321	300760	迈瑞医疗	1,534,644.00	7.88
322	000519	中兵红箭	1,534,514.00	7.88
323	688258	江苏卓易信息 科技	1,527,982.14	7.84
324	688016	心脉医疗	1,519,386.66	7.80
325	002017	东信和平	1,518,251.00	7.79
326	688320	禾川科技	1,516,271.94	7.78
327	688351	微创电生理股 份	1,515,250.12	7.78
328	002533	金杯电工	1,515,066.00	7.78
329	002266	浙富控股	1,506,742.00	7.73
330	300510	金冠股份	1,505,902.24	7.73
331	688617	惠泰医疗	1,494,544.98	7.67
332	600468	百利电气	1,494,453.00	7.67
333	603015	弘讯科技	1,491,267.00	7.65
334	002467	二六三	1,489,818.00	7.65
335	300566	激智科技	1,487,478.08	7.63
336	000050	深天马A	1,481,108.00	7.60
337	300413	芒果超媒	1,473,603.00	7.56
338	002841	视源股份	1,472,134.00	7.56
339	688292	浩瀚深度信息 技术	1,469,303.02	7.54
340	688210	泛海统联精密 制造	1,468,858.12	7.54
341	300383	光环新网	1,464,885.00	7.52
342	300376	易事特	1,455,831.00	7.47
343	002550	千红制药	1,449,941.00	7.44
344	601619	嘉泽新能	1,447,180.00	7.43
345	300194	福安药业	1,442,542.00	7.40
346	000823	超声电子	1,436,043.00	7.37
347	003029	吉大正元	1,434,144.00	7.36
348	603989	艾华集团	1,420,737.00	7.29
349	600063	皖维高新	1,415,047.00	7.26
350	000973	佛塑科技	1,414,326.30	7.26
351	603508	思维列控	1,400,237.00	7.19

352	603063	禾望电气	1,399,861.00	7.18
353	601137	博威合金	1,395,852.00	7.16
354	601985	中国核电	1,393,597.00	7.15
355	688261	东微半导体	1,392,474.19	7.15
356	688505	复旦张江股份	1,390,722.00	7.14
357	688205	德科立光电子	1,390,225.23	7.13
358	300145	中金环境	1,381,122.00	7.09
359	600613	神奇制药	1,378,818.00	7.08
360	000963	华东医药	1,367,594.00	7.02
361	002111	威海广泰	1,366,108.00	7.01
362	600797	浙大网新	1,366,084.00	7.01
363	603392	万泰生物	1,360,517.20	6.98
364	002252	上海莱士	1,333,733.00	6.84
365	600588	用友网络	1,333,052.00	6.84
366	688068	热景生物	1,332,323.44	6.84
367	600105	永鼎股份	1,332,068.00	6.84
368	603416	信捷电气	1,319,377.00	6.77
369	002241	歌尔股份	1,316,127.00	6.75
370	688112	鼎阳科技	1,310,671.33	6.73
371	000157	中联重科	1,308,369.60	6.71
372	688700	东威科技	1,306,631.64	6.71
373	601179	中国西电	1,299,038.00	6.67
374	300207	欣旺达	1,297,582.00	6.66
375	601616	广电电气	1,294,723.00	6.64
376	300101	振芯科技	1,291,597.00	6.63
377	688228	开普云信息科技	1,289,661.66	6.62
378	600745	闻泰科技	1,287,541.00	6.61
379	002745	木林森	1,286,432.00	6.60
380	600728	佳都科技	1,285,739.00	6.60
381	601908	京运通	1,283,420.00	6.59
382	300025	华星创业	1,281,297.05	6.58
383	688209	英集芯科技	1,279,493.43	6.57
384	002559	亚威股份	1,277,827.00	6.56
385	688050	爱博诺德医疗	1,276,836.74	6.55
386	600206	有研新材	1,264,207.00	6.49
387	688078	龙软科技	1,248,304.35	6.41
388	300679	电连技术	1,246,678.00	6.40
389	300751	迈为股份	1,243,118.20	6.38
390	300377	赢时胜	1,240,011.00	6.36
391	002410	广联达	1,239,874.00	6.36
392	688055	昆山龙腾光电	1,238,341.56	6.36
393	002138	顺络电子	1,236,781.00	6.35

394	688399	硕世生物	1,232,151.42	6.32
395	688168	北京安博通	1,228,621.00	6.31
396	300747	锐科激光	1,222,845.00	6.28
397	603421	鼎信通讯	1,215,769.40	6.24
398	002594	比亚迪	1,214,183.00	6.23
399	300305	裕兴股份	1,204,905.00	6.18
400	300671	富满微	1,204,579.00	6.18
401	688226	威腾电气集团 股份	1,191,909.06	6.12
402	301339	通行宝	1,191,652.00	6.12
403	600718	东软集团	1,188,615.00	6.10
404	688071	华依科技集团	1,164,785.61	5.98
405	300763	锦浪科技	1,161,923.00	5.96
406	300667	必创科技	1,158,918.75	5.95
407	688699	明微电子	1,158,489.96	5.95
408	300241	瑞丰光电	1,157,775.00	5.94
409	600418	江淮汽车	1,150,991.00	5.91
410	300347	泰格医药	1,146,635.00	5.88
411	002179	中航光电	1,136,901.10	5.83
412	300199	翰宇药业	1,133,608.00	5.82
413	601012	隆基绿能	1,130,917.00	5.80
414	688398	赛特新材	1,128,301.75	5.79
415	300699	光威复材	1,127,571.60	5.79
416	688472	阿特斯阳光电 力	1,120,587.52	5.75
417	002611	东方精工	1,109,852.00	5.70
418	600869	远东股份	1,108,850.00	5.69
419	300414	中光防雷	1,103,173.00	5.66
420	688301	奕瑞科技股份	1,101,457.97	5.65
421	600320	振华重工	1,094,160.00	5.62
422	600196	复星医药	1,090,051.00	5.59
423	002449	国星光电	1,087,123.00	5.58
424	603303	得邦照明	1,082,275.00	5.55
425	300248	新开普	1,070,858.00	5.50
426	300114	中航电测	1,070,732.00	5.50
427	300014	亿纬锂能	1,068,799.00	5.49
428	688639	华恒生物	1,068,225.19	5.48
429	688121	卓然技术	1,067,691.07	5.48
430	600563	法拉电子	1,065,151.00	5.47
431	688568	中科星图公司	1,061,610.37	5.45
432	002915	中欣氟材	1,060,146.00	5.44
433	000636	风华高科	1,057,748.00	5.43
434	300246	宝莱特	1,055,280.50	5.42

435	600143	金发科技	1,054,109.00	5.41
436	000541	佛山照明	1,041,349.00	5.34
437	688246	嘉和美康科技	1,039,432.01	5.33
438	600501	航天晨光	1,038,668.00	5.33
439	600391	航发科技	1,034,639.00	5.31
440	688219	会通股份	1,028,911.68	5.28
441	603601	再升科技	1,016,240.00	5.22
442	300872	天阳科技	1,012,629.60	5.20
443	300109	新开源	1,007,147.00	5.17
444	688202	美迪西生物医 药	999,456.94	5.13
445	603628	清源股份	998,292.00	5.12
446	002544	普天科技	981,136.00	5.04
447	002669	康达新材	970,843.00	4.98
448	002518	科士达	967,603.00	4.97
449	300976	达瑞电子	964,821.60	4.95
450	301095	广立微	957,714.00	4.92
451	000938	紫光股份	955,378.00	4.90
452	688153	唯捷创芯	955,147.94	4.90
453	601360	三六零	951,766.00	4.88
454	688718	唯赛勃科技	950,123.02	4.88
455	600537	亿晶光电	949,287.00	4.87
456	300685	艾德生物	949,276.80	4.87
457	688787	海天瑞声	947,985.10	4.87
458	688238	和元生物	945,518.36	4.85
459	002912	中新赛克	942,953.00	4.84
460	002324	普利特	932,515.00	4.79
461	688533	上声电子股份	927,208.99	4.76
462	600851	海欣股份	924,359.00	4.74
463	688503	聚和材料股份 公司	924,070.21	4.74
464	002036	联创电子	921,142.00	4.73
465	002376	新北洋	920,120.00	4.72
466	688157	松井新材料	915,723.45	4.70
467	688256	寒武纪科技	915,233.00	4.70
468	002880	卫光生物	912,176.00	4.68
469	688518	联赢激光股份	910,885.55	4.67
470	300803	指南针	904,649.00	4.64
471	002373	千方科技	902,340.00	4.63
472	300378	鼎捷软件	900,442.00	4.62
473	600732	爱旭股份	897,145.00	4.60
474	688080	映翰通网络	895,131.51	4.59
475	688172	燕东微电子股	893,438.45	4.59

		份		
476	000066	中国长城	889,238.00	4.56
477	603330	天洋新材	884,786.00	4.54
478	600332	白云山	884,616.00	4.54
479	688677	青岛海泰新光	884,310.21	4.54
480	688329	苏州艾隆科技	880,635.81	4.52
481	688133	泰坦股份	879,832.84	4.52
482	000423	东阿阿胶	877,357.00	4.50
483	002145	中核钛白	876,727.00	4.50
484	688073	毕得医药科技 股份	875,395.98	4.49
485	603383	顶点软件	874,133.00	4.49
486	300520	科大国创	867,667.00	4.45
487	688167	西安炬光科技	867,335.48	4.45
488	300628	亿联网络	863,076.00	4.43
489	002838	道恩股份	857,606.00	4.40
490	688076	诺泰生物	856,736.44	4.40
491	688358	祥生医疗科技	851,096.63	4.37
492	688269	西安凯立新材	851,031.81	4.37
493	300533	冰川网络	850,332.00	4.36
494	600775	南京熊猫	836,337.00	4.29
495	600973	宝胜股份	832,599.00	4.27
496	603283	赛腾股份	831,049.00	4.27
497	300426	唐德影视	828,715.00	4.25
498	002522	浙江众成	823,274.00	4.23
499	300230	永利股份	819,436.00	4.21
500	300183	东软载波	806,322.60	4.14
501	002922	伊戈尔	805,000.00	4.13
502	600475	华光环能	804,501.00	4.13
503	688093	世华科技	803,659.06	4.12
504	000875	吉电股份	803,379.00	4.12
505	002923	润都股份	798,728.00	4.10
506	002484	江海股份	798,672.00	4.10
507	002136	安纳达	797,835.00	4.09
508	002335	科华数据	793,679.00	4.07
509	688456	有研粉材	790,404.35	4.06
510	603309	维力医疗	789,181.00	4.05
511	000962	东方钨业	786,193.00	4.03
512	002041	登海种业	785,261.00	4.03
513	300115	长盈精密	784,891.00	4.03
514	603533	掌阅科技	781,288.00	4.01
515	002546	新联电子	781,151.00	4.01
516	688289	圣湘生物	779,232.52	4.00

517	603236	移远通信	778,906.00	4.00
518	600200	江苏吴中	774,471.00	3.97
519	688039	当虹科技	771,963.20	3.96
520	600329	达仁堂	768,901.00	3.95
521	300046	台基股份	768,162.00	3.94
522	600237	铜峰电子	765,693.00	3.93
523	002810	山东赫达	764,116.00	3.92
524	300532	今天国际	761,983.00	3.91
525	688391	钜泉科技	761,918.89	3.91
526	601611	中国核建	759,442.00	3.90
527	300404	博济医药	758,647.00	3.89
528	002869	金溢科技	758,136.00	3.89
529	002446	盛路通信	757,923.00	3.89
530	688200	华峰测控	755,836.24	3.88
531	002169	智光电气	752,013.00	3.86
532	603501	韦尔股份	751,879.70	3.86
533	002970	锐明技术	740,355.96	3.80
534	002465	海格通信	737,815.00	3.79
535	300111	向日葵	736,078.00	3.78
536	688383	新益昌科技	735,917.05	3.78
537	688317	上海之江生物	733,215.58	3.76
538	300308	中际旭创	731,833.00	3.76
539	688102	陕西斯瑞新材股份	730,084.22	3.75
540	002566	益盛药业	729,998.00	3.75
541	000544	中原环保	728,269.00	3.74
542	600085	同仁堂	722,815.00	3.71
543	002288	超华科技	722,334.00	3.71
544	300326	凯利泰	720,768.00	3.70
545	002223	鱼跃医疗	713,369.00	3.66
546	300777	中简科技	713,344.00	3.66
547	000538	云南白药	710,739.60	3.65
548	688260	昀冢科技	704,312.04	3.61
549	688161	威高骨科	702,693.21	3.61
550	688035	德邦科技股份	701,899.00	3.60
551	688551	科威尔股份	701,311.74	3.60
552	603259	药明康德	700,402.00	3.59
553	002452	长高电新	691,527.00	3.55
554	688146	中船派瑞特气	687,936.54	3.53
555	300558	贝达药业	687,763.00	3.53
556	300059	东方财富	686,509.00	3.52
557	300842	帝科股份	683,113.00	3.51
558	688667	菱电电控	680,065.00	3.49

559	603258	电魂网络	675,509.00	3.47
560	601615	明阳智能	671,914.00	3.45
561	688232	国泰新点软件	661,801.21	3.40
562	000657	中钨高新	659,843.00	3.39
563	600363	联创光电	657,120.00	3.37
564	688048	长光华芯	656,755.80	3.37
565	300239	东宝生物	654,804.00	3.36
566	603396	金辰股份	653,659.00	3.35
567	688198	佰仁医疗科技	651,009.94	3.34
568	300638	广和通	647,547.00	3.32
569	600763	通策医疗	639,426.00	3.28
570	601717	郑煤机	630,466.00	3.24
571	601808	中海油服	630,104.00	3.23
572	600645	中源协和	621,190.00	3.19
573	002338	奥普光电	618,838.00	3.18
574	002298	中电兴发	612,438.00	3.14
575	688369	致远互联	609,932.26	3.13
576	688662	广东富信科技	605,708.49	3.11
577	002771	真视通	602,367.00	3.09
578	600292	远达环保	599,654.00	3.08
579	300098	高新兴	598,214.00	3.07
580	300206	理邦仪器	596,687.00	3.06
581	002730	电光科技	595,488.00	3.06
582	300465	高伟达	594,470.00	3.05
583	688517	金冠电气	592,333.66	3.04
584	688189	南新制药	591,364.93	3.03
585	688028	沃尔德金刚石	591,250.36	3.03
586	688522	纳睿雷达科技	591,125.58	3.03
587	002649	博彦科技	589,492.00	3.03
588	000513	丽珠集团	588,864.00	3.02
589	300017	网宿科技	584,823.00	3.00
590	002479	富春环保	581,062.00	2.98
591	300231	银信科技	580,973.00	2.98
592	300292	吴通控股	580,265.00	2.98
593	000625	长安汽车	579,035.00	2.97
594	002851	麦格米特	574,743.00	2.95
595	688636	智明达电子	570,528.26	2.93
596	003035	南网能源	568,064.00	2.92
597	688401	路维光电	567,134.78	2.91
598	300161	华中数控	564,814.00	2.90
599	600812	华北制药	561,578.00	2.88
600	300127	银河磁体	556,595.00	2.86
601	000623	吉林敖东	549,575.00	2.82

602	600435	北方导航	546,353.00	2.80
603	002038	双鹭药业	543,855.00	2.79
604	688585	上纬新材	542,162.86	2.78
605	688275	万润新能源	538,375.56	2.76
606	688170	德龙激光	537,591.02	2.76
607	300706	阿石创	534,634.00	2.74
608	600592	龙溪股份	533,704.00	2.74
609	688733	壹石通	528,696.49	2.71
610	002602	世纪华通	523,231.00	2.69
611	688350	富淼科技	520,010.34	2.67
612	300289	利德曼	517,474.00	2.66
613	000400	许继电气	510,778.00	2.62
614	300310	宜通世纪	509,153.00	2.61
615	000055	方大集团	508,396.00	2.61
616	603663	三祥新材	503,367.00	2.58
617	300020	银江技术	500,656.00	2.57
618	300578	会畅通讯	497,591.00	2.55
619	300380	安硕信息	491,515.00	2.52
620	300150	世纪瑞尔	490,477.00	2.52
621	003021	兆威机电	488,924.00	2.51
622	300493	润欣科技	488,285.00	2.51
623	600850	电科数字	487,008.00	2.50
624	300035	中科电气	486,724.00	2.50
625	600222	太龙药业	483,337.00	2.48
626	300739	明阳电路	483,171.00	2.48
627	688025	杰普特光电	482,980.55	2.48
628	301123	奕东电子	482,387.00	2.48
629	301183	东田微	474,476.00	2.44
630	002097	山河智能	470,156.00	2.41
631	601222	林洋能源	463,938.00	2.38
632	688190	云路先进材料股份	462,707.00	2.37
633	600410	华胜天成	458,843.00	2.35
634	688152	麒麟信安	456,544.11	2.34
635	300466	赛摩智能	456,478.80	2.34
636	688117	圣诺生物	456,287.76	2.34
637	688227	品高股份	455,951.50	2.34
638	603515	欧普照明	452,419.00	2.32
639	300078	思创医惠	451,449.00	2.32
640	600151	航天机电	448,661.00	2.30
641	300133	华策影视	448,308.80	2.30
642	688058	宝兰德软件	447,521.81	2.30
643	600482	中国动力	444,326.00	2.28

644	002119	康强电子	443,960.00	2.28
645	601016	节能风电	443,726.49	2.28
646	688262	苏州国芯科技	439,951.00	2.26
647	603876	鼎胜新材	439,598.00	2.26
648	688338	赛科希德	436,796.65	2.24
649	300314	戴维医疗	435,173.00	2.23
650	300129	泰胜风能	434,272.00	2.23
651	300448	浩云科技	434,260.00	2.23
652	300615	欣天科技	433,156.00	2.22
653	002815	崇达技术	427,773.00	2.20
654	601218	吉鑫科技	424,633.00	2.18
655	300409	道氏技术	422,399.00	2.17
656	603611	诺力股份	422,166.00	2.17
657	002491	通鼎互联	421,383.00	2.16
658	300112	万讯自控	415,835.00	2.13
659	300259	新天科技	414,073.00	2.13
660	688257	新锐股份	412,066.14	2.11
661	688330	宏力达信息	410,091.70	2.10
662	002065	东华软件	404,742.00	2.08
663	300822	贝仕达克	404,164.00	2.07
664	688313	仕佳光子	403,175.40	2.07
665	002414	高德红外	401,116.00	2.06
666	300327	中颖电子	398,979.00	2.05
667	300672	国科微	395,394.00	2.03
668	300776	帝尔激光	394,413.00	2.02
669	688268	广东华特气体	390,823.13	2.01
670	002623	亚玛顿	389,972.00	2.00

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,542,350,978.60
卖出股票收入（成交）总额	1,476,606,064.83

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货。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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	39,421.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,421.24

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	231	242,015.48	29,671,766.69	53.07%	26,233,809.46	46.93%
国泰君安科技创新	124	282,345.88	29,177,988.43	83.34%	5,832,900.39	16.66%

精选三个月持有股票发起 C						
合计	355	256,102.72	58,849,755.12	64.73%	32,066,709.85	35.27%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	5,191,828.73	9.2868%
	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C	1,649,046.66	4.7101%
	合计	6,840,875.39	7.5244%

注：分类基金基金管理人所有从业人员持有本基金份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 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	50~100
	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	50~100
	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C	-
	合计	50~100

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。

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金	34,671,766.69	38.14%	15,009,000.00	16.51%	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	859,969.93	0.95%	-	-	-
基金经理等人员	946,631.86	1.04%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	5,034,273.60	5.54%	-	-	-
合计	41,512,642.08	45.67%	15,009,000.00	16.51%	-

§ 10 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	13,793,631.08	6,468,023.83
本报告期基金总申购份额	49,663,835.08	42,656,446.81
减：本报告期基金总赎回份额	7,551,890.01	14,113,581.82
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	55,905,576.15	35,010,888.82

注：基金总申购份额含红利再投资及转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

【科技创新精选一召开持有人大会修改基金合同一已生效】

2023 年 7 月 31 日至 2023 年 8 月 27 日，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通讯方式召开基金份额持有人大会，大会审议并通过了《关于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调整赎回费率的议案》，决定修改 C 类基金份额的赎回费率。本次大会决议自 2023 年 8 月 29 日起生效。具体持有人大会决议情况请参见基金管理人于 2023 年 8 月 30 日公布的《关于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份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2023 年 4 月 8 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关于完成公司法定代表人变更登记的公告》，公司法定代表人变更为陶耿先生，相关工商变更手续已于 2023 年 4 月 6 日在上海市场监督管理局办理完毕。

2、本报告期内本基金托管人重大人事变动如下：

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 3 万元人民币。其为本基金提供审计服务的连续年限为自 2022 年 11 月 16 日（基金合同生效日）至本报告期末。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期无涉及管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期无涉及托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

			成交总额的 比例		总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	2	3,018,957,043.43	100.00%	215,259.20	100.00%	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于完成公司法定代表人变更登记的公告	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	2023-04-08
2	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下产品参与直销 APP 费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2023-04-17
3	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 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	2023-04-22
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 2023 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-04-23
5	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年 2 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-07-21
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 2023 年第二季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-07-21
7	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-07-22
8	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	证监会指定网站、公司官网	2023-07-22
9	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	证监会指定网站、公司官网	2023-07-22
10	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（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2023-07-25
11	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	证监会指定网站、公司官网	2023-07-25

	基金（C类份额）基金产品资料概要更新		
12	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（更新）（2023年第1号）	证监会指定网站、公司官网	2023-07-25
13	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于以通讯方式召开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份额持有人大会的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2023-07-28
14	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于以通讯方式召开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份额持有人大会的第一次提示性公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2023-07-29
15	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于以通讯方式召开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份额持有人大会的第二次提示性公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2023-07-31
16	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下公募基金的公告	证监会指定网站、公司官网	2023-08-21
17	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下公募基金的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-08-22
18	关于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份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2023-08-30
19	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（更新）（2023年第2号）	证监会指定网站、公司官网	2023-08-30
20	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（A类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2023-08-30
21	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（C类份额）基金产品资料	证监会指定网站、公司官网	2023-08-30

	概要更新		
22	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-08-31
23	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 2023 年中期报告	证监会指定网站、公司官网	2023-08-31
24	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-10-25
25	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 2023 年第 3 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-10-25
26	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（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2023-11-15
27	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（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2023-11-15
28	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（更新）（2023 年第 3 号）	证监会指定网站、公司官网	2023-11-15

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20230101-20231231	15,009,000.00	19,662,766.69	-	34,671,766.69	38.14%
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) 基金在短期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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

在本报告截止日至报告批准送出日之间,基金管理人根据法律法规及《基金合同》等法律文件的相关规定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,决定自 2023 年 7 月 24 日起,调低本基金的管理费率和托管费率并相应修订法律文件。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予国泰君安科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。

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

上海国泰君安证券资产管理有限公司

二〇二四年三月二十九日