

国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资  
基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 08 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年01月01日起至2024年06月30日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>6</b>
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13

<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	51

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	52
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	53
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>53</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件.....	55
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>56</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>57</b>
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57



## § 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	71,848,912.12 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	51,549,465.42 份	20,299,446.70 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		上海市静安区新闻路 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	张金良

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 01 月 01 日-2024 年 06 月 30 日）	
	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C
本期已实现收益	-7,046,283.64	-5,748,766.62
本期利润	-8,188,136.67	-6,790,717.76
加权平均基金份额本期利润	-0.1497	-0.2029
本期加权平均净值利润率	-17.36%	-23.71%
本期基金份额净值增长率	-14.97%	-15.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-8,796,771.83	-3,598,056.13



期末可供分配基金份额利润	-0.1706	-0.1772
期末基金资产净值	42,752,693.59	16,701,390.57
期末基金份额净值	0.8294	0.8228
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末（2024 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-17.06%	-17.72%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-3.93%	1.17%	-4.36%	1.00%	0.43%	0.17%
过去三个月	-4.52%	1.34%	-6.57%	1.17%	2.05%	0.17%
过去六个月	-14.97%	1.77%	-11.86%	1.52%	-3.11%	0.25%
过去一年	-21.43%	1.48%	-21.74%	1.25%	0.31%	0.23%
自基金合同生效起至今	-17.06%	1.34%	-22.12%	1.12%	5.06%	0.22%

#### 国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-3.97%	1.16%	-4.36%	1.00%	0.39%	0.16%
过去三个月	-4.65%	1.34%	-6.57%	1.17%	1.92%	0.17%
过去六个月	-15.18%	1.77%	-11.86%	1.52%	-3.32%	0.25%
过去一年	-21.82%	1.48%	-21.74%	1.25%	-0.08%	0.23%
自基金合同生效起至今	-17.72%	1.34%	-22.12%	1.12%	4.40%	0.22%

### 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-2024年06月30日)



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

(2022年11月16日-2024年06月30日)



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理国泰君安现金管家货币市场基金、国泰君安 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、国泰君安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金、国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金、国泰君安君得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 53 只公开募集证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡崇海	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理。现任量化投资部总经理，兼任量化	2022-11-16	-	13 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士。曾任香港科技大学人工智能实验室访问学者，其后加盟方正证券研究所、国泰君安证券咨询部及研究所从事量化对冲模型的研发工作，2014 年加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，先后在量化投资部、权益与衍生品部担任高级投资经理，从事量化投资和策略研发工作，在 Alpha 量化策略以及基于机器学习的投资方面有独到且深入的研究。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。

	投资部（公募）总经理。				
--	-------------	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 2 次。本基金与本公司管理的其他组合在不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)同向交易的交易价差未出现异常。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

本基金聚焦科技创新类公司，特别是科创板的上市公司，具有典型的成长投资风格，主要投资

于成长潜力较大的科技新兴产业，挖掘 A 股未来最有潜力的结构性 Beta。本基金以量化的方式，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。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A 基金份额净值为 0.8294 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-14.97%，同期业绩比较基准收益率为-11.86%；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 0.8228 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-15.18%，同期业绩比较基准收益率为-11.86%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

重投资者回报的同时，为投资者创造更加透明和公平的投资环境。审视当下的行情，诚然目前市场依然处于风险偏好较低的缩量博弈阶段，市场信心的恢复尚需时日，但是我们认为大多数股票的市场化“出清”较为彻底，过去多年的下跌对当下复杂经济环境和国际政治形势的估值消化已经较为充分，“磨底”的煎熬并不妨碍我们对于下半年的行情变得积极乐观起来。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

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

## § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	6,647,490.70	6,195,015.66
结算备付金		826,590.01	800,633.38
存出保证金		117,563.60	-
交易性金融资产	6.4.7.2	54,561,073.29	81,691,185.22
其中：股票投资		54,561,073.29	81,691,185.22
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-

应收申购款		350.00	39,421.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		62,153,067.60	88,726,255.50
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,473,424.30	-
应付管理人报酬		62,388.42	90,319.84
应付托管费		10,398.08	15,053.28
应付销售服务费		7,026.23	14,546.89
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	145,746.41	110,000.00
负债合计		2,698,983.44	229,920.01
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	71,848,912.12	90,916,464.97
未分配利润	6.4.7.8	-12,394,827.96	-2,420,129.48



净资产合计		59,454,084.16	88,496,335.49
负债和净资产总计		62,153,067.60	88,726,255.50

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 71,848,912.12 份。其中国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A 基金份额净值 0.8294 元，基金份额总额 51,549,465.42 份；国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C 基金份额净值 0.8228 元，基金份额总额 20,299,446.70 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-14,324,042.94	3,248,000.36
1. 利息收入		13,260.27	9,171.71
其中：存款利息收入	6.4.7.9	13,260.27	9,171.71
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）		-12,158,920.48	3,843,815.21
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-12,632,352.80	3,526,512.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.11	156,287.24	-
股利收益	6.4.7.12	317,145.08	317,303.04

其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-2,183,804.17	-623,082.84
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	5,421.44	18,096.28
<b>减：二、营业总支出</b>		654,811.49	661,690.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	451,668.91	445,288.44
2. 托管费	6.4.10.2.2	75,278.09	74,214.71
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	71,220.69	89,738.60
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		909.72	-
8. 其他费用	6.4.7.15	55,734.08	52,448.27
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-14,978,854.43	2,586,310.34
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-14,978,854.43	2,586,310.34
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-14,978,854.43	2,586,310.34

### 6.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	90,916,464.97	-2,420,129.48	88,496,335.49
二、本期期初净资产	90,916,464.97	-2,420,129.48	88,496,335.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-19,067,552.85	-9,974,698.48	-29,042,251.33
（一）、综合收益总额	-	-14,978,854.43	-14,978,854.43
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-19,067,552.85	5,004,155.95	-14,063,396.90
其中：1. 基金申购款	22,680,319.48	-2,404,416.94	20,275,902.54
2. 基金赎回款	-41,747,872.33	7,408,572.89	-34,339,299.44
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	71,848,912.12	-12,394,827.96	59,454,084.16
项 目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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）	50,054,079.62	4,540,889.75	54,594,969.37
（一）、综合收益总额	-	2,586,310.34	2,586,310.34
（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）	50,054,079.62	1,954,579.41	52,008,659.03
其中：1. 基金申购款	54,873,326.06	2,207,890.87	57,081,216.93
2. 基金赎回款	-4,819,246.44	-253,311.46	-5,072,557.90
（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	70,315,734.53	3,764,208.46	74,079,942.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国泰君安科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%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业

务指引》、《国泰君安科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 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

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

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金

融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
活期存款	3,491,492.92
等于：本金	3,491,267.29
加：应计利息	225.63
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-

其他存款	3,155,997.78
等于：本金	3,155,837.86
加：应计利息	159.92
减：坏账准备	-
合计	6,647,490.70

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	56,824,023.09	-	54,561,073.29	-2,262,949.80
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	56,824,023.09	-	54,561,073.29	-2,262,949.80

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	998,360.00	0.00	-	-
—股指期货	998,360.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	998,360.00	-	-	-

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动

IM2407	IM2407	1	971,600.00	-26,760.00
合计				-26,760.00
减：可抵销期货暂收款				-26,760.00
净额				0.00

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

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9,321.95
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	119,781.56
预提审计费	14,918.54
其他应付	1,724.36
合计	145,746.41



#### 6.4.7.7 实收基金

##### 国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	55,905,576.15	55,905,576.15
本期申购	1,773,196.86	1,773,196.86
本期赎回（以“-”号填列）	-6,129,307.59	-6,129,307.59
本期末	51,549,465.42	51,549,465.42

##### 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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,010,888.82	35,010,888.82
本期申购	20,907,122.62	20,907,122.62
本期赎回（以“-”号填列）	-35,618,564.74	-35,618,564.74
本期末	20,299,446.70	20,299,446.70

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,973,403.83	600,547.54	-
本期期初	-1,973,403.83	600,547.54	-
本期利润	-7,046,283.64	-1,141,853.03	-
本期基金份额交易产生的变动数	586,222.79	177,998.34	764,221.13
其中：基金申购款	-247,291.32	27,238.09	-220,053.23
基金赎回款	833,514.11	150,760.25	984,274.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,433,464.68	-363,307.15	-
			8,796,771.83

##### 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	-1,419,646.07	372,372.88	- 1,047,273.19
本期期初	-1,419,646.07	372,372.88	- 1,047,273.19
本期利润	-5,748,766.62	-1,041,951.14	- 6,790,717.76
本期基金份额交易产生的变动数	3,713,577.11	526,357.71	4,239,934.82
其中：基金申购款	-1,346,511.16	-837,852.55	- 2,184,363.71
基金赎回款	5,060,088.27	1,364,210.26	6,424,298.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,454,835.58	-143,220.55	- 3,598,056.13

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	3,052.77
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,795.48
结算备付金利息收入	6,412.02
其他	-
合计	13,260.27

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	477,130,217.05
减：卖出股票成本总额	489,392,637.80
减：交易费用	369,932.05
买卖股票差价收入	-12,632,352.80

#### 6.4.7.11 衍生工具收益

##### 6.4.7.11.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	164,960.00

减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	7,580.97
减：交易费用	1,091.79
合计	156,287.24

#### 6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	317,145.08
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	317,145.08

#### 6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,157,044.17
——股票投资	-2,157,044.17
——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	-26,760.00
——权证投资	-
————期货投资	-26,760.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,183,804.17

#### 6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	5,421.44
合计	5,421.44

#### 6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	14,918.54
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,033.98
合计	55,734.08

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额	成交金额	占当期股票成交总额

		的比例		的比例
国泰君安证券	941,549,787.09	100.00%	1,421,307,367.18	100.00%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券	70,983.55	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券	101,357.12	100.00%	0.00	0.00%

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	451,668.91	445,288.44
其中：应支付销售机构的客户维护费	76,298.24	29,063.34
应支付基金管理人的净管理费	375,370.67	416,225.10

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

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

H 为每日应计提的管理人报酬

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人报酬逐日累计至每月月底，按月支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	75,278.09	74,214.71

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费逐日累计至每月月底，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安科技创新精选 三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选 三个月持有股票发起 C	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	16,100.04	16,100.04
上海国泰君安证券资产管理 有限公司	-	52,022.96	52,022.96
合计	-	68,123.00	68,123.00
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安科技创新精选 三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选 三个月持有股票发起 C	合计
国泰君安证券股份有限公司	-	23,140.36	23,140.36
上海国泰君安证券资产管理 有限公司	-	63,804.72	63,804.72
合计	-	86,945.08	86,945.08

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

其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值  $\times$  0.50% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日(2022 年 11 月 16 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	29,671,766.69	10,009,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	3,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	26,671,766.69	10,009,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	51.74%	40.77%

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日(2022 年 11 月 16 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	24.63%	10.93%

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

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰君安证券	3,155,997.78	3,795.48	4,386,972.71	6,911.08
建设银行	3,491,492.92	3,052.77	1,600,649.22	2,260.63

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。  
2. 本基金的其他存款由基金结算机构国泰君安证券保管，按协议约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须做说明的其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购



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

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金的托管行中国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 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2023 年 12 月 31 日：本基金未持有信用类债券)。

##### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

资产主要为银行存款、存出保证金、结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,647,490.70	-	-	-	6,647,490.70
结算备付金	826,590.01	-	-	-	826,590.01
存出保证金	117,563.60	-	-	-	117,563.60
交易性金融资产	-	-	-	54,561,073.29	54,561,073.29
应收申购款	-	-	-	350.00	350.00
资产总计	7,591,644.31	-	-	54,561,423.29	62,153,067.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,473,424.30	2,473,424.30
应付管理人报酬	-	-	-	62,388.42	62,388.42
应付托管费	-	-	-	10,398.08	10,398.08
应付销售服务费	-	-	-	7,026.23	7,026.23
其他负债	-	-	-	145,746.41	145,746.41
负债总计	-	-	-	2,698,983.44	2,698,983.44
利率敏感度缺口	7,591,644.31	-	-	51,862,439.85	59,454,084.16
上年度末 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

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例 0.00% (2023 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 (2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 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	54,561,073.29	91.77	81,691,185.22	92.31
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投	-	-	-	-

资				
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	54,561,073.29	91.77	81,691,185.22	92.31

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 6.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	3,438,795.10	5,081,987.72
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-3,438,795.10	-5,081,987.72

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	54,561,073.29	81,691,185.22
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	54,561,073.29	81,691,185.22

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	54,561,073.29	87.79
	其中:股票	54,561,073.29	87.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,474,080.71	12.03
8	其他各项资产	117,913.60	0.19
9	合计	62,153,067.60	100.00

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

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	10,770.00	0.02
C	制造业	46,595,575.06	78.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	556,519.00	0.94
E	建筑业	20,179.00	0.03
F	批发和零售业	348,303.20	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	209,346.00	0.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,764,747.81	9.70
J	金融业	105,734.00	0.18
K	房地产业	15,808.00	0.03
L	租赁和商务服务业	124,980.00	0.21
M	科学研究和技术服务业	809,111.22	1.36
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	54,561,073.29	91.77

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	688012	中微半导体设备	13,859	1,957,722.34	3.29

2	688981	中芯国际	40,546	1,869,170.60	3.14
3	688041	海光信息	25,647	1,803,497.04	3.03
4	300750	宁德时代	9,000	1,620,270.00	2.73
5	688111	金山办公	5,872	1,335,880.00	2.25
6	688008	澜起科技	21,728	1,241,972.48	2.09
7	688099	晶晨半导体	20,246	1,200,992.72	2.02
8	688271	联影医疗	8,584	941,664.80	1.58
9	688363	华熙生物	13,838	782,815.66	1.32
10	688169	石头科技	1,855	728,273.00	1.22
11	688187	时代电气	14,335	707,862.30	1.19
12	688019	安集科技	5,400	679,320.00	1.14
13	688088	虹软科技	23,406	675,497.16	1.14
14	688249	晶合集成	44,802	657,245.34	1.11
15	000725	京东方 A	155,500	635,995.00	1.07
16	688586	江航飞机装备	65,584	609,931.20	1.03
17	002241	歌尔股份	29,000	565,790.00	0.95
18	688036	传音控股	7,378	564,712.12	0.95
19	688002	睿创微纳	19,800	553,806.00	0.93
20	688029	南微医学科技	8,936	550,100.16	0.93
21	688120	华海清科	2,900	549,782.00	0.92
22	002422	科伦药业	17,800	539,874.00	0.91
23	688116	天奈科技	22,883	528,139.64	0.89
24	688208	道通科技	21,293	514,013.02	0.86
25	688352	顾中科技	44,129	503,511.89	0.85
26	688055	昆山龙腾光电	157,752	500,073.84	0.84
27	688281	华秦科技实业	5,945	495,337.40	0.83
28	688516	奥特维科技	11,700	489,177.00	0.82
29	688472	阿特斯阳光电 力	46,582	474,204.76	0.80
30	688289	圣湘生物	25,995	456,992.10	0.77
31	688617	惠泰医疗	1,000	456,100.00	0.77
32	601877	正泰电器	23,900	455,534.00	0.77
33	688150	莱特光电股份	23,300	452,020.00	0.76
34	688123	聚辰半导体	7,350	447,100.50	0.75
35	688578	艾力斯医药科 技	6,900	439,806.00	0.74
36	002340	格林美	68,900	438,893.00	0.74
37	688126	上海硅产业集 团	31,700	437,777.00	0.74
38	688728	格科微有限公 司	36,079	436,916.69	0.73
39	688128	中国电器研究 院	24,385	419,665.85	0.71



40	688028	沃尔德金刚石	25,500	418,965.00	0.70
41	688389	深圳普门科技	24,962	405,882.12	0.68
42	688601	力芯微股份	9,222	402,909.18	0.68
43	601633	长城汽车	15,800	399,740.00	0.67
44	688378	奥来德光电	16,830	394,831.80	0.66
45	688138	清溢光电	18,281	393,041.50	0.66
46	688313	仕佳光子	40,074	381,504.48	0.64
47	688127	蓝特光学	20,737	381,353.43	0.64
48	300408	三环集团	12,800	373,632.00	0.63
49	688188	上海柏楚电子科技	2,000	369,100.00	0.62
50	688798	艾为电子	6,500	368,030.00	0.62
51	688253	英诺特生物股份	9,600	365,856.00	0.62
52	688213	思特威电子科技	7,454	361,519.00	0.61
53	688336	三生国健	17,247	350,976.45	0.59
54	688195	腾景科技	14,300	350,493.00	0.59
55	300735	光弘科技	15,900	343,440.00	0.58
56	603501	韦尔股份	3,400	337,858.00	0.57
57	688484	南芯科技	9,014	334,419.40	0.56
58	688222	成都先导	28,591	324,507.85	0.55
59	688362	甬矽电子	16,448	320,078.08	0.54
60	688608	恒玄科技	2,100	307,398.00	0.52
61	688351	微创电生理股份	12,824	282,640.96	0.48
62	688209	英集芯科技	22,400	277,984.00	0.47
63	600809	山西汾酒	1,300	274,144.00	0.46
64	688032	禾迈股份	2,345	269,159.10	0.45
65	688531	日联科技股份	5,723	264,173.68	0.44
66	688233	神工半导体	13,121	252,841.67	0.43
67	688475	萤石网络	7,300	249,003.00	0.42
68	000538	云南白药	4,800	245,520.00	0.41
69	688007	光峰科技	15,205	244,800.50	0.41
70	688105	XD 诺唯赞生物	11,637	232,856.37	0.39
71	301408	华人健康	22,400	229,152.00	0.39
72	600183	生益科技	10,700	225,342.00	0.38
73	688315	诺禾致源科技	20,200	220,584.00	0.37
74	605369	拱东医疗	5,400	215,460.00	0.36
75	000830	鲁西化工	18,100	209,779.00	0.35
76	688779	长远锂科	44,922	207,988.86	0.35
77	688408	中信博新能源	2,200	202,576.00	0.34

78	002601	龙佰集团	10,900	202,413.00	0.34
79	003816	中国广核	43,600	201,868.00	0.34
80	300442	润泽科技	8,400	201,180.00	0.34
81	300502	新易盛	1,900	200,545.00	0.34
82	688787	海天瑞声	3,600	197,568.00	0.33
83	603025	大豪科技	14,100	194,862.00	0.33
84	002475	立讯精密	4,900	192,619.00	0.32
85	688072	拓荆科技	1,600	192,176.00	0.32
86	002245	蔚蓝锂芯	24,500	189,875.00	0.32
87	603229	奥翔药业	18,800	188,940.00	0.32
88	688439	振华风光	2,810	186,724.50	0.31
89	688383	新益昌科技	3,500	182,385.00	0.31
90	600468	百利电气	41,700	179,727.00	0.30
91	688590	新致软件	13,900	179,310.00	0.30
92	688016	心脉医疗	1,800	176,490.00	0.30
93	688582	芯动联科	6,266	176,450.56	0.30
94	688183	生益电子	9,039	175,175.82	0.29
95	688239	贵州航宇科技	5,031	175,078.80	0.29
96	300351	永贵电器	11,400	168,720.00	0.28
97	688380	中微半导	9,691	162,033.52	0.27
98	300034	钢研高纳	10,100	160,489.00	0.27
99	000568	泸州老窖	1,100	157,839.00	0.27
100	688153	唯捷创芯	4,200	155,400.00	0.26
101	300381	溢多利	24,800	152,272.00	0.26
102	688139	海尔生物	4,077	151,664.40	0.26
103	603496	恒为科技	6,100	149,145.00	0.25
104	688050	爱博诺德医疗	2,005	147,006.60	0.25
105	002897	意华股份	3,900	146,874.00	0.25
106	002292	奥飞娱乐	24,500	146,510.00	0.25
107	600406	国电南瑞	5,800	144,768.00	0.24
108	688148	芳源股份	34,300	144,403.00	0.24
109	301260	格力博	10,600	144,372.00	0.24
110	603015	弘讯科技	19,000	143,640.00	0.24
111	601500	通用股份	26,600	142,044.00	0.24
112	688223	晶科能源	19,938	141,559.80	0.24
113	300821	东岳硅材	19,900	136,116.00	0.23
114	688776	国光电气	2,449	135,674.60	0.23
115	688371	菲沃泰纳米科技	13,500	135,540.00	0.23
116	002468	申通快递	15,800	132,720.00	0.22
117	603198	迎驾贡酒	2,300	132,250.00	0.22
118	300751	迈为股份	1,100	131,428.00	0.22
119	688550	瑞联新材料	5,600	129,864.00	0.22

120	688409	富创精密	3,492	128,994.48	0.22
121	601888	中国中免	2,000	124,980.00	0.21
122	688276	长春百克生物 科技	4,356	123,579.72	0.21
123	002907	华森制药	9,700	122,414.00	0.21
124	002284	亚太股份	17,900	121,004.00	0.20
125	688093	世华科技	6,425	116,742.25	0.20
126	688513	苑东生物	2,300	115,667.00	0.19
127	002054	德美化工	23,200	113,912.00	0.19
128	600011	华能国际	11,600	111,592.00	0.19
129	300047	天源迪科	16,400	107,256.00	0.18
130	003021	兆威机电	2,300	106,145.00	0.18
131	600030	中信证券	5,800	105,734.00	0.18
132	600309	万华化学	1,300	105,118.00	0.18
133	688778	厦钨新能源	3,324	103,841.76	0.17
134	603883	老百姓	5,420	99,511.20	0.17
135	688182	灿勤科技	7,400	97,976.00	0.16
136	688486	龙迅股份	1,700	97,410.00	0.16
137	002371	北方华创	300	95,967.00	0.16
138	688122	西部超导	2,439	93,462.48	0.16
139	688523	航天环宇科技	5,400	93,150.00	0.16
140	301301	川宁生物	7,200	92,016.00	0.15
141	688777	中控技术	2,400	90,480.00	0.15
142	688279	峰昭科技	800	88,720.00	0.15
143	688065	凯赛生物	1,898	86,150.22	0.14
144	600617	国新能源	34,100	85,250.00	0.14
145	300634	彩讯股份	5,000	84,150.00	0.14
146	603823	百合花	8,500	82,195.00	0.14
147	300724	捷佳伟创	1,500	81,015.00	0.14
148	688403	汇成股份	9,469	80,297.12	0.14
149	688252	天德钰科技	5,505	79,987.65	0.13
150	300424	航新科技	6,500	79,495.00	0.13
151	688686	奥普特科技	1,200	76,836.00	0.13
152	002120	韵达股份	9,900	76,626.00	0.13
153	600027	华电国际	10,700	74,258.00	0.12
154	002046	国机精工	7,300	74,241.00	0.12
155	688147	微导纳米科技	2,966	73,853.40	0.12
156	600096	云天化	3,800	73,796.00	0.12
157	688819	天能电池集团 股份	2,923	69,742.78	0.12
158	688612	威迈斯	2,616	69,507.12	0.12
159	688595	芯海科技	2,300	69,000.00	0.12
160	300307	慈星股份	11,300	67,235.00	0.11

161	688510	航亚科技	3,616	66,570.56	0.11
162	688579	山大地纬软件	8,433	66,199.05	0.11
163	688107	安路科技	2,600	66,092.00	0.11
164	688690	纳微科技	3,800	66,006.00	0.11
165	300233	金城医药	4,300	64,156.00	0.11
166	300274	阳光电源	1,000	62,030.00	0.10
167	601600	中国铝业	8,100	61,803.00	0.10
168	002906	华阳集团	2,300	61,548.00	0.10
169	688226	威腾电气集团 股份	3,500	61,180.00	0.10
170	000738	航发控制	2,900	58,203.00	0.10
171	688306	均普智能制造	13,900	56,434.00	0.09
172	600760	中航沈飞	1,400	56,140.00	0.09
173	688348	昱能科技	946	55,814.00	0.09
174	300505	川金诺	4,500	54,855.00	0.09
175	600362	江西铜业	2,300	54,464.00	0.09
176	002613	北玻股份	15,500	53,940.00	0.09
177	688388	嘉元科技	5,500	53,625.00	0.09
178	688498	源杰科技	400	52,396.00	0.09
179	603806	福斯特	3,500	51,450.00	0.09
180	300357	我武生物	2,500	50,550.00	0.09
181	601991	大唐发电	16,400	49,364.00	0.08
182	603998	方盛制药	4,700	48,269.00	0.08
183	688236	春立正达医疗	3,300	46,794.00	0.08
184	688231	隆达超合金股 份	3,253	46,387.78	0.08
185	688433	华曙高科	2,200	45,892.00	0.08
186	600602	云赛智联	4,100	45,264.00	0.08
187	688566	吉贝尔药业	1,989	44,752.50	0.08
188	000930	中粮科技	8,600	43,258.00	0.07
189	002378	章源钨业	7,300	41,902.00	0.07
190	603658	安图生物	900	41,463.00	0.07
191	600436	片仔癀	200	41,434.00	0.07
192	600789	鲁抗医药	5,900	41,300.00	0.07
193	300014	亿纬锂能	1,000	39,920.00	0.07
194	601615	明阳智能	4,200	39,648.00	0.07
195	688766	普冉半导体	400	38,868.00	0.07
196	300624	万兴科技	700	37,149.00	0.06
197	000534	万泽股份	3,700	36,741.00	0.06
198	002519	银河电子	7,400	36,334.00	0.06
199	601311	骆驼股份	4,500	36,090.00	0.06
200	600727	鲁北化工	5,500	34,650.00	0.06
201	002185	华天科技	4,200	34,230.00	0.06

202	600819	耀皮玻璃	8,000	33,760.00	0.06
203	603896	寿仙谷	1,400	32,858.00	0.06
204	603790	雅运股份	3,400	32,640.00	0.05
205	002150	通润装备	2,600	31,798.00	0.05
206	600566	济川药业	1,000	31,710.00	0.05
207	688321	微芯生物	1,800	31,680.00	0.05
208	688385	复旦微电	1,000	31,380.00	0.05
209	688581	安杰思医学	640	31,315.20	0.05
210	688102	陕西斯瑞新材股份	2,625	29,977.50	0.05
211	002446	盛路通信	5,300	29,945.00	0.05
212	600062	华润双鹤	1,500	29,370.00	0.05
213	688556	高测科技股份	2,400	28,536.00	0.05
214	300396	迪瑞医疗	1,400	28,434.00	0.05
215	601100	恒立液压	600	27,948.00	0.05
216	300832	新产业	400	26,976.00	0.05
217	688106	金宏气体	1,490	26,104.80	0.04
218	000513	丽珠集团	700	26,047.00	0.04
219	300278	华昌达	8,200	23,534.00	0.04
220	603399	吉翔股份	3,800	23,522.00	0.04
221	600276	恒瑞医药	600	23,076.00	0.04
222	688381	帝奥微电子	1,168	22,752.64	0.04
223	688503	聚和材料股份公司	800	22,480.00	0.04
224	300529	健帆生物	800	21,768.00	0.04
225	002399	海普瑞	2,500	21,675.00	0.04
226	300286	安科瑞	1,000	21,640.00	0.04
227	603633	徕木股份	2,700	21,357.00	0.04
228	600023	浙能电力	3,000	21,330.00	0.04
229	300229	拓尔思	1,500	20,145.00	0.03
230	002979	雷赛智能	1,100	20,020.00	0.03
231	688559	海目星激光	600	19,734.00	0.03
232	603939	益丰药房	800	19,640.00	0.03
233	300747	锐科激光	1,100	19,525.00	0.03
234	600707	彩虹股份	2,800	19,068.00	0.03
235	688533	上声电子股份	723	18,704.01	0.03
236	688561	奇安信集团	779	18,399.98	0.03
237	688248	南方电网电力科技	600	17,778.00	0.03
238	688553	汇宇制药	1,400	17,388.00	0.03
239	002001	新和成	900	17,280.00	0.03
240	000999	华润三九	400	17,032.00	0.03
241	600736	苏州高新	3,800	15,808.00	0.03

242	300481	濮阳惠成	1,100	15,180.00	0.03
243	603203	XD 快克智能	600	14,148.00	0.02
244	688697	纽威数控装备	900	14,121.00	0.02
245	603160	汇顶科技	200	13,750.00	0.02
246	300725	药石科技	500	13,385.00	0.02
247	002294	信立泰	500	13,315.00	0.02
248	688219	会通股份	1,695	13,170.15	0.02
249	600021	上海电力	1,300	12,857.00	0.02
250	688630	芯碁微装	200	12,514.00	0.02
251	603893	瑞芯微	200	11,834.00	0.02
252	600141	兴发集团	600	11,448.00	0.02
253	300433	蓝思科技	600	10,950.00	0.02
254	688358	XD 祥生医疗 科技	421	10,933.37	0.02
255	601168	西部矿业	600	10,770.00	0.02
256	601669	中国电建	1,900	10,621.00	0.02
257	688141	杰华特微电子	600	9,696.00	0.02
258	601231	环旭电子	600	9,630.00	0.02
259	601668	中国建筑	1,800	9,558.00	0.02
260	688525	佰维存储	147	9,430.05	0.02
261	300595	欧普康视	600	9,408.00	0.02
262	600559	老白干酒	500	9,090.00	0.02
263	002534	西子洁能	900	9,009.00	0.02
264	300539	横河精密	1,100	8,855.00	0.01
265	603189	网达软件	800	8,752.00	0.01
266	600031	三一重工	500	8,250.00	0.01
267	601700	风范股份	1,700	7,463.00	0.01
268	688201	信安世纪	600	7,086.00	0.01
269	688789	杭州宏华数码 科技	50	5,390.00	0.01
270	688508	芯朋微电子	105	3,818.85	0.01
271	688366	昊海生物科技	40	2,467.20	0.00
272	688035	德邦科技股份	49	1,578.78	0.00
273	301318	维海德	50	1,373.50	0.00
274	688661	和林微纳科技	30	919.50	0.00
275	688526	武汉科前生物	45	661.05	0.00
276	688049	炬芯科技	14	309.68	0.00
277	688575	XD 亚辉龙生 物	1	23.32	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入 金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688041	海光信息	10,451,656.86	11.81
2	688271	联影医疗	8,171,459.56	9.23
3	688981	中芯国际	7,641,117.47	8.63
4	688111	金山办公	6,495,395.81	7.34
5	688012	中微半导体设备	5,340,596.79	6.03
6	688187	时代电气	5,139,559.86	5.81
7	600276	恒瑞医药	4,511,791.00	5.10
8	688590	新致软件	4,458,412.16	5.04
9	688008	澜起科技	4,428,550.96	5.00
10	688099	晶晨半导体	4,076,218.25	4.61
11	688772	珠海冠宇电池	4,004,278.86	4.52
12	688036	传音控股	3,992,065.06	4.51
13	688139	海尔生物	3,955,700.52	4.47
14	300750	宁德时代	3,945,207.00	4.46
15	688601	力芯微股份	3,639,792.37	4.11
16	688072	拓荆科技	3,508,638.66	3.96
17	688472	阿特斯阳光电力	3,439,964.99	3.89
18	688222	成都先导	3,079,141.28	3.48
19	688169	石头科技	3,038,161.21	3.43
20	688599	天合光能	3,001,506.05	3.39
21	688128	中国电器研究院	2,942,493.97	3.32
22	688778	厦钨新能源	2,916,144.94	3.30
23	688352	硕中科技	2,861,019.49	3.23
24	688561	奇安信集团	2,830,353.55	3.20
25	688183	生益电子	2,828,725.69	3.20
26	688009	中国通号	2,814,955.71	3.18
27	688223	晶科能源	2,774,652.90	3.14
28	688819	天能电池集团股份	2,713,276.06	3.07
29	688408	中信博新能源	2,680,361.40	3.03
30	688525	佰维存储	2,621,198.74	2.96
31	688088	虹软科技	2,593,315.86	2.93
32	688248	南方电网电力科技	2,572,572.42	2.91
33	688313	仕佳光子	2,542,804.59	2.87
34	688105	XD 诺唯赞生物	2,506,237.55	2.83

35	688116	天奈科技	2,494,403.19	2.82
36	601766	中国中车	2,467,392.00	2.79
37	603439	贵州三力	2,459,963.00	2.78
38	688249	晶合集成	2,423,303.06	2.74
39	688065	凯赛生物	2,407,915.96	2.72
40	002938	鹏鼎控股	2,299,658.00	2.60
41	688362	甬矽电子	2,256,613.71	2.55
42	688578	艾力斯医药科技	2,208,599.98	2.50
43	600050	中国联通	2,201,419.00	2.49
44	688018	乐鑫科技	2,145,704.74	2.42
45	688281	华秦科技实业	2,118,016.19	2.39
46	000725	京东方 A	2,069,669.00	2.34
47	688403	汇成股份	2,041,006.88	2.31
48	688146	中船派瑞特气	2,035,076.78	2.30
49	603993	XD 洛阳钼业	2,019,820.00	2.28
50	688389	深圳普门科技	2,015,900.96	2.28
51	688141	杰华特微电子	1,999,553.84	2.26
52	688298	东方基因生物	1,970,886.10	2.23
53	688800	瑞可达连接系统	1,967,818.22	2.22
54	688439	振华风光	1,943,087.61	2.20
55	688252	天德钰科技	1,925,929.42	2.18
56	688003	天准科技	1,898,884.47	2.15
57	688372	伟测科技	1,884,251.37	2.13
58	688363	华熙生物	1,872,809.16	2.12
59	002241	歌尔股份	1,869,443.00	2.11
60	000963	华东医药	1,865,195.00	2.11
61	688029	南微医学科技	1,836,804.39	2.08
62	688687	北京凯因科技	1,833,990.51	2.07
63	688289	圣湘生物	1,818,624.72	2.06
64	688167	西安炬光科技	1,799,310.57	2.03
65	600776	东方通信	1,793,328.00	2.03
66	688106	金宏气体	1,785,159.38	2.02

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688041	海光信息	8,429,924.82	9.53



2	688271	联影医疗	7,310,977.14	8.26
3	688981	中芯国际	7,142,324.14	8.07
4	688187	时代电气	6,774,758.68	7.66
5	688111	金山办公	6,403,525.25	7.24
6	688012	中微半导体设备	5,317,634.51	6.01
7	600276	恒瑞医药	4,636,563.00	5.24
8	688772	珠海冠宇电池	4,600,005.02	5.20
9	688008	澜起科技	4,140,137.78	4.68
10	688599	天合光能	4,080,865.36	4.61
11	688590	新致软件	4,043,356.85	4.57
12	688009	中国通号	3,932,067.29	4.44
13	688036	传音控股	3,925,874.51	4.44
14	688139	海尔生物	3,845,729.47	4.35
15	688099	晶晨半导体	3,821,022.86	4.32
16	688223	晶科能源	3,694,214.00	4.17
17	688472	阿特斯阳光电力	3,664,051.09	4.14
18	688601	力芯微股份	3,608,026.55	4.08
19	688072	拓荆科技	3,423,854.48	3.87
20	688183	生益电子	3,180,509.20	3.59
21	688003	天准科技	3,160,546.47	3.57
22	688819	天能电池集团股份	3,069,771.40	3.47
23	688778	厦钨新能源	2,881,808.32	3.26
24	688222	成都先导	2,851,561.62	3.22
25	688503	聚和材料股份公司	2,846,455.63	3.22
26	601766	中国中车	2,816,655.00	3.18
27	688484	南芯科技	2,707,876.40	3.06
28	688248	南方电网电力科技	2,683,826.09	3.03
29	688128	中国电器研究院	2,670,403.08	3.02
30	688561	奇安信集团	2,647,069.80	2.99
31	688525	佰维存储	2,642,480.80	2.99
32	688707	XD 振华新材料	2,530,493.01	2.86
33	002558	巨人网络	2,519,536.00	2.85
34	002938	鹏鼎控股	2,504,941.00	2.83
35	688408	中信博新能源	2,479,647.40	2.80
36	688018	乐鑫科技	2,473,502.97	2.80
37	688396	华润微电子	2,445,906.98	2.76
38	688385	复旦微电	2,417,989.26	2.73

39	688065	凯赛生物	2,404,229.04	2.72
40	300750	宁德时代	2,395,408.55	2.71
41	603439	贵州三力	2,367,844.00	2.68
42	603993	XD 洛阳钼业	2,361,468.00	2.67
43	688252	天德钰科技	2,343,883.29	2.65
44	688169	石头科技	2,330,670.13	2.63
45	688106	金宏气体	2,327,154.45	2.63
46	688475	萤石网络	2,318,800.69	2.62
47	688336	三生国健	2,298,482.01	2.60
48	600050	中国联通	2,228,375.00	2.52
49	601633	长城汽车	2,190,259.00	2.47
50	688138	清溢光电	2,188,269.73	2.47
51	688105	XD 诺唯赞生物	2,172,883.57	2.46
52	688403	汇成股份	2,118,806.60	2.39
53	688313	仕佳光子	2,118,629.34	2.39
54	688800	瑞可达连接系统	2,103,580.31	2.38
55	688389	深圳普门科技	2,070,679.40	2.34
56	688002	睿创微纳	2,059,717.21	2.33
57	688439	振华风光	2,053,232.52	2.32
58	688298	东方基因生物	2,023,637.35	2.29
59	688352	颀中科技	1,990,517.57	2.25
60	688569	铁科轨道	1,977,420.64	2.23
61	688146	中船派瑞特气	1,974,867.95	2.23
62	688116	天奈科技	1,945,667.76	2.20
63	600776	东方通信	1,944,079.00	2.20
64	688088	虹软科技	1,942,950.99	2.20
65	688234	天岳先进	1,933,514.57	2.18
66	688006	浙江杭可科技	1,931,780.82	2.18
67	688578	艾力斯医药科技	1,930,482.50	2.18
68	002913	奥士康	1,905,117.00	2.15
69	688372	伟测科技	1,894,734.91	2.14
70	000963	华东医药	1,882,328.00	2.13
71	688141	杰华特微电子	1,842,705.33	2.08

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	464,419,570.04
卖出股票收入（成交）总额	477,130,217.05

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

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

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	117,563.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	350.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	117,913.60

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级	持有人	户均持有	持有人结构
-----	-----	------	-------

别	户数 (户)	的基金份 额	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	208	247,833.97	26,671,766.69	51.74%	24,877,698.73	48.26%
国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C	132	153,783.69	15,562,936.82	76.67%	4,736,509.88	23.33%
合计	340	211,320.33	42,234,703.51	58.78%	29,614,208.61	41.22%

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

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	3,896,979.93	7.5597%
	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C	636,757.67	3.1368%
	合计	4,533,737.60	6.3101%

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

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	>100

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

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

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	31,671,766.69	44.08%	15,009,000.00	20.89%	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	55,563.33	0.08%	-	-	-
基金经理等人员	1,073,088.26	1.49%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	3,405,086.01	4.74%	-	-	-
合计	36,205,504.29	50.39%	15,009,000.00	20.89%	-

注：其他为公司普通员工持有份额，持有期限为不低于 6 个月。

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C
基金合同生效日（2022 年 11 月 16 日）基金份额总额	10,009,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	55,905,576.15	35,010,888.82
本报告期基金总申购份额	1,773,196.86	20,907,122.62
减：本报告期基金总赎回份额	6,129,307.59	35,618,564.74
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	51,549,465.42	20,299,446.70

注：基金总申购份额含红利再投资及转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

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

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

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

2、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	2	941,549,787.09	100.00%	70,983.55	100.00%	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024-01-22
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 2023 年第 4 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-01-22
3	上海国泰君安证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-02-28
4	上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-03-20
5	上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-03-20
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 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-03-29
7	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024-03-29



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 2024 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-04-22
9	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年第 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	2024-04-22
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	2024-06-28
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	2024-06-28

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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	20240101-20240630	34,671,766.69	-	3,000,000.00	31,671,766.69	44.08%
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延缓赎回，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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p>							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

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

上海国泰君安证券资产管理有限公司  
二〇二四年八月三十日