

# 国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金

## 2024 年年度报告

2024 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:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2025 年 03 月 31 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独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年03月14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2024年01月01日起至2024年12月31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                 | 7         |
| 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、基金净值表现及利润分配情况</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         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况               | 11        |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                | <b>11</b> |
| 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      | 12        |
| 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        |
| <b>§ 5 托管人报告 .....</b>                        | <b>16</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 17        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..... | 17        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....       | 17        |
| <b>§ 6 审计报告 .....</b>                         | <b>17</b> |
| 6.1 审计报告基本信息 .....                            | 17        |
| 6.2 审计报告的基本内容 .....                           | 17        |
| <b>§ 7 年度财务报表 .....</b>                       | <b>19</b> |
| 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        |
| <b>§ 8 投资组合报告 .....</b>                       | <b>53</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 53        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 54        |
| 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 .....       | 54        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                     | 68        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 70        |
| 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 .....      | 70        |
| 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 .....   | 70        |

|  |           |
|--|-----------|
| 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..... | 70        |
| 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 .....   | 70        |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                   | 70        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 70        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                        | 70        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>                  | <b>71</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                | 71        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 72        |
| 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 .....     | 72        |
| 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                  | 73        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>                 | <b>73</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                   | <b>73</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                     | 74        |
| 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.....      | 74        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....          | 74        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                       | 74        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                | 74        |
| 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 .....        | 74        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....               | 75        |
| 11.8 其他重大事件.....                           | 75        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>           | <b>77</b> |
| 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.....    | 77        |

|                          |           |
|--------------------------|-----------|
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 77        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b> | <b>77</b> |
| 13.1 备查文件目录.....         | 77        |
| 13.2 存放地点 .....          | 77        |
| 13.3 查阅方式 .....          | 77        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                 |                            |                      |
|-----------------|----------------------------|----------------------|
| 基金名称            | 国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金 |                      |
| 基金简称            | 国泰君安中证 1000 优选股票发起         |                      |
| 基金主代码           | 019505                     |                      |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                     |                      |
| 基金合同生效日         | 2023 年 12 月 12 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           | 中国工商银行股份有限公司               |                      |
| 报告期末基金份额总额      | 106,953,988.09 份           |                      |
| 基金合同存续期         | 不定期                        |                      |
| 下属分级基金的基金简称     | 国泰君安中证 1000 优选股票发起 A       | 国泰君安中证 1000 优选股票发起 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 019505                     | 019506               |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 75,865,770.87 份            | 31,088,217.22 份      |

2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。  |
| 投资策略   | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金依据宏观和金融数据以及投资部门对于宏观经济、股市政策、市场趋势的综合分析，重点关注包括 GDP 增速、固定资产投资增速、净出口增速、通胀率、货币供应、利率等宏观指标的变化趋势，同时强调金融市场投资者行为分析，关注资本市场资金供求关系变化等因素，在深入分析基础上评估宏观经济运行及政策对资本市场的影响方向和力度，形成资产配置方案。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>在股票投资方面，本基金在量化策略配置和投资组合管理的框架下，根据量化模型主要精选中证 1000 指数成份股中成长性良好且估值合理的上市公司股票构建投资组合，并根据市场风格变化及股票技术面因素，不定期对策略权重进行优化调整，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。本基金的投资策略还包括债券投资策略、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、参与股指期货交易策略、参与国债期货交易策略、股票期权投资策略、存托凭证投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税  |

|        |  |
|--------|--|
|        | 后) ×5%                                     |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金, 其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。 |

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                  | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 吕巍                                | 郭明                  |
|         | 联系电话 | 021-38676022                      | 010-66105799        |
|         | 电子邮箱 | zgxxpl@gtjas.com                  | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 95521                             | 95588               |
| 传真      |      | 021-38871190                      | 010-66105798        |
| 注册地址    |      | 上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室         | 北京市西城区复兴门内大街 55 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 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 邮政编码    |      | 200120                            | 100140              |
| 法定代表人   |      | 陶耿                                | 廖林                  |

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                                       |
|--------|------------------|--|
| 会计师事务所 | 容诚会计师事务所(特殊普通合伙) | 北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢外经贸大厦 901-22 至 901-26 |
| 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、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 | 2024 年               |                      | 2023 年 12 月 12 日（基金合同生效日）-2023 年 12 月 31 日 |                      |
|---------------|----------------------|----------------------|--|----------------------|
|               | 国泰君安中证 1000 优选股票发起 A | 国泰君安中证 1000 优选股票发起 C | 国泰君安中证 1000 优选股票发起 A                       | 国泰君安中证 1000 优选股票发起 C |
| 本期已实现收益       | 17,272,224.93        | 3,610,057.91         | -694,189.55                                | -288,097.73          |
| 本期利润          | 13,555,669.01        | 2,846,994.10         | -442,889.47                                | -189,021.97          |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0978               | 0.0643               | -0.0026                                    | -0.0028              |
| 本期加权平均净值利润率   | 10.35%               | 6.84%                | -0.26%                                     | -0.28%               |
| 本期基金份额净值增长率   | 14.68%               | 14.22%               | -0.26%                                     | -0.28%               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2024 年末              |                      | 2023 年末                                    |                      |
| 期末可供分配利润      | 10,912,577.43        | 4,321,427.73         | -694,189.55                                | -288,097.73          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1438               | 0.1390               | -0.0040                                    | -0.0042              |
| 期末基金资产净值      | 86,778,348.30        | 35,409,644.95        | 171,833,054.76                             | 67,840,962.76        |
| 期末基金份额净值      | 1.1438               | 1.1390               | 0.9974                                     | 0.9972               |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2024 年末              |                      | 2023 年末                                    |                      |
| 基金份额累计净值增长率   | 14.38%               | 13.90%               | -0.26%                                     | -0.28%               |

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

国泰君安中证 1000 优选股票发起 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  | 8.97%    | 2.33%       | 4.23%      | 2.28%         | 4.74%  | 0.05% |
| 过去六个月  | 27.86%   | 2.14%       | 20.68%     | 2.13%         | 7.18%  | 0.01% |
| 过去一年   | 14.68%   | 2.03%       | 1.41%      | 2.01%         | 13.27% | 0.02% |
| 自基金合同生 | 14.38%   | 1.98%       | -1.56%     | 1.97%         | 15.94% | 0.01% |

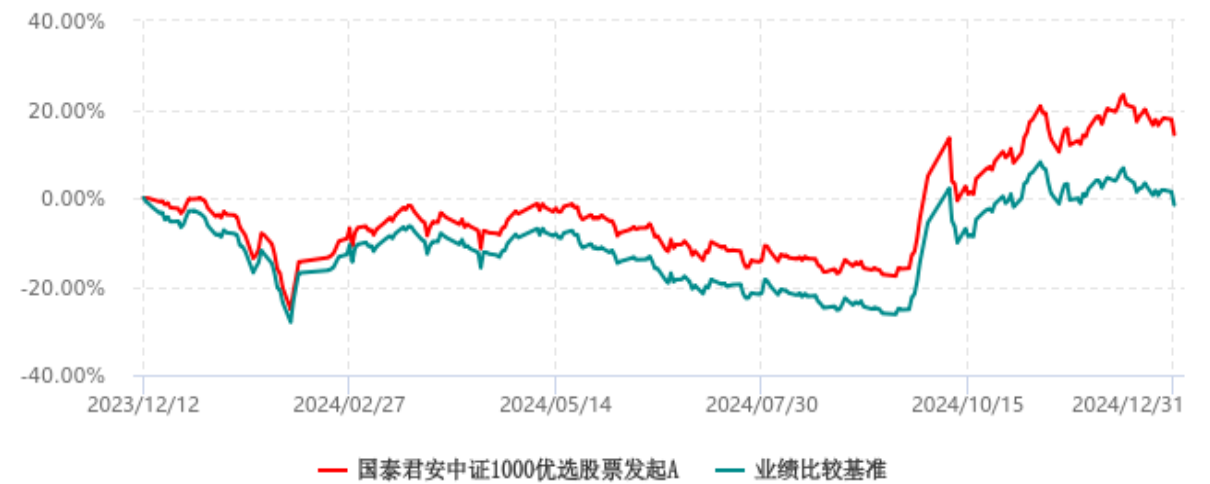
|      |  |  |  |  |  |  |
|------|--|--|--|--|--|--|
| 效起至今 |  |  |  |  |  |  |
|------|--|--|--|--|--|--|

国泰君安中证 1000 优选股票发起 C 净值表现

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①－③    | ②－④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|-------|
| 过去三个月          | 8.87%        | 2.33%               | 4.23%              | 2.28%                     | 4.64%  | 0.05% |
| 过去六个月          | 27.59%       | 2.14%               | 20.68%             | 2.13%                     | 6.91%  | 0.01% |
| 过去一年           | 14.22%       | 2.03%               | 1.41%              | 2.01%                     | 12.81% | 0.02% |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 13.90%       | 1.97%               | -1.56%             | 1.97%                     | 15.46% | 0.00% |

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

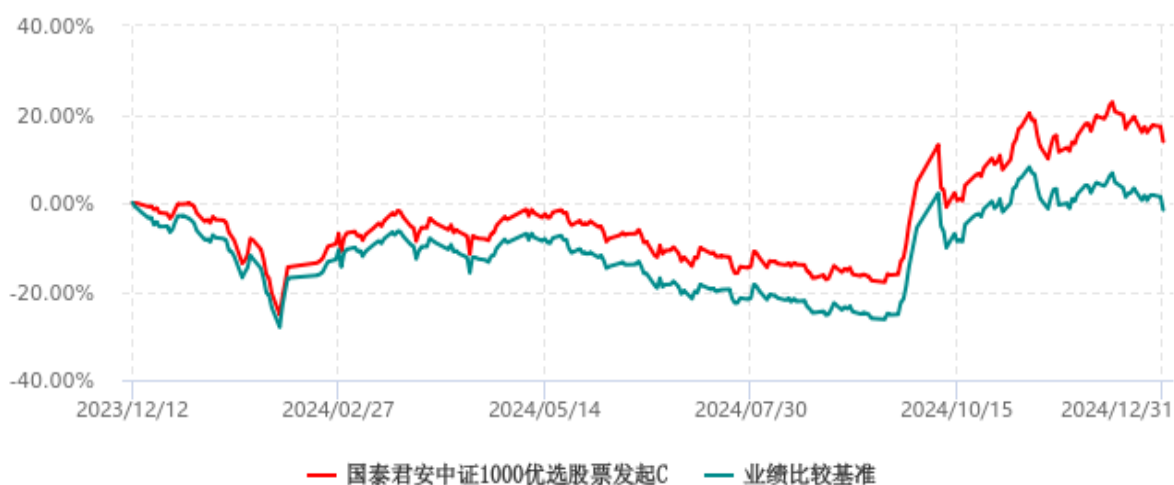
国泰君安中证1000优选股票发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势  
对比图  
(2023年12月12日-2024年12月31日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

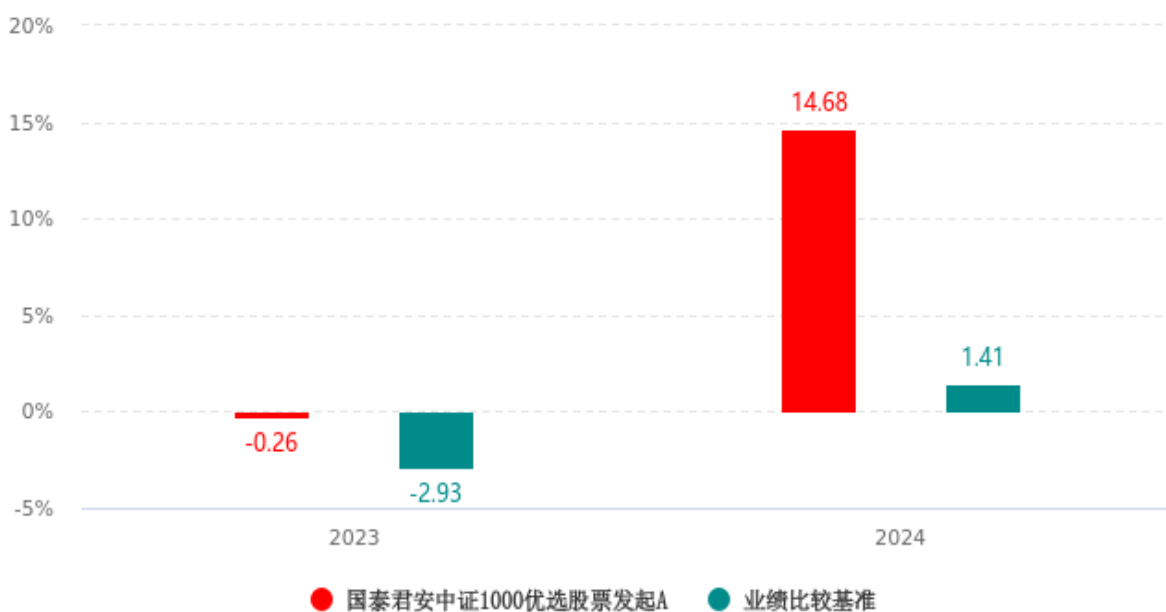
国泰君安中证1000优选股票发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势  
对比图

(2023年12月12日-2024年12月31日)

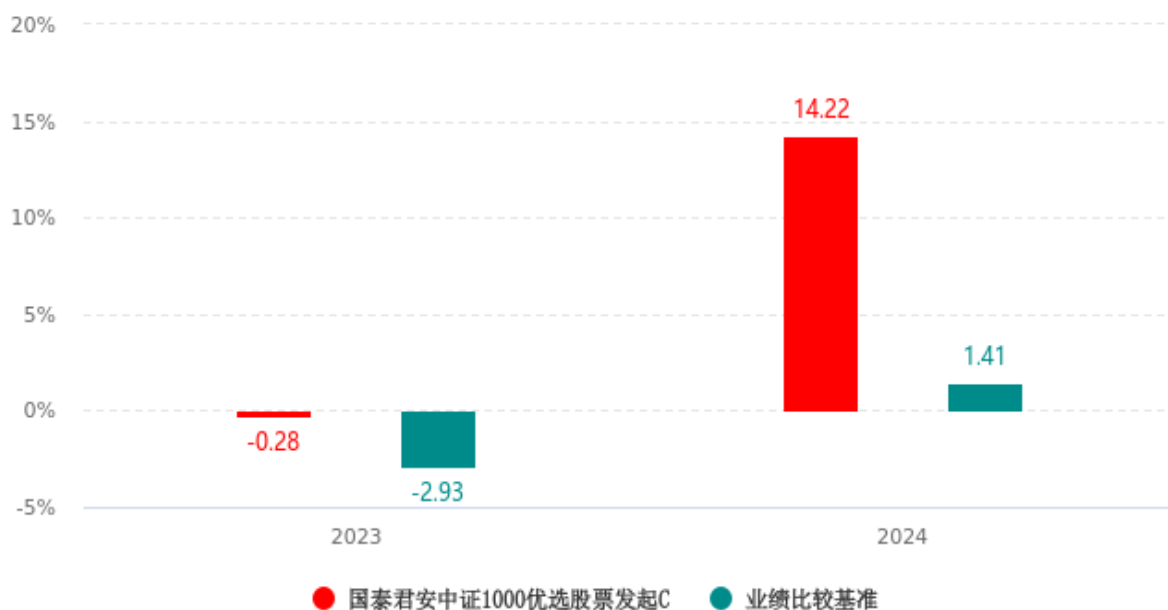


注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

### 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



注：本基金合同生效日为 2023 年 12 月 12 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



注：本基金合同生效日为 2023 年 12 月 12 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

## § 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 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 57 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<br>理（助理）期限 |          | 证<br>券<br>从<br>业<br>年<br>限 | 说明  |
|-----|--|---------------------|----------|----------------------------|---|
|     |  | 任职日期                | 离任<br>日期 |                            |   |
| 胡崇海 | 国泰君安中证 500 指数增强基金经理，国泰君安中证 1000 指数增强基金经理，国泰君安量化选股混合发起基金经理，国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起基金经理，国泰君安沪深 300 指数增强发起基金经理，国泰君安中证 1000 优选股票发起基金经理，国泰君安稳债增利债券发起基金经理，国泰君安科创板量化选股股票发起基金经理，国泰君安红利量化选股混合基金经理，国泰君安中证 A500 指数增强基金经理。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。 | 2023-12-12          | -        | 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。 |

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% 的次數为 8 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

2024 年 A 股市场经历“政策驱动、结构剧变”的深度调整与修复过程，全年呈现“双底反转、风格轮动”的 W 型走势。本年度前两个季度 A 股市场呈现“V 型探底→政策托底→分化加剧”的波动特征，核心矛盾体现为政策对冲与基本面压力的博弈：一季度流动性冲击后政策快速响应稳定市场，二季度政策红利边际递减，市场回归基本面定价逻辑。从九月底开始，政策组合拳（证券基金互换便利等）超预期出台，高 Beta 板块（非银、计算机）引领反弹，风格迅速从价值切换至成长，全年 A 股整体上经历“流动性冲击→政策托底→风格再平衡”过程，监管层通过打击财务造假、优化退市等改革重塑生态，为股市中长期健康发展奠定扎实的基础。从主要宽基指数来看，2024 年，中证 1000 指数涨幅相对有限（1.20%），弱于沪深 300（涨幅 14.68%）和中证 500（涨幅 5.46%）。展望 2025 年，A 股有望在“政策护航与业绩修复”双轮驱动下开启慢牛征程。政策层面，互换便利与专项再贷款等央行创新货币工具进入落地阶段，叠加二十届三中全会提出的科技体制改革以及聚焦科创板高质量发展的“科创板八条”等产业政策深化，将强化流动性支持与成长股

投资逻辑，市场驱动逻辑料从估值修复转向盈利验证，全 A 净利润增速有望企稳回升。结构上，上半年流动性宽松或催化小盘科技股行情，下半年随经济数据验证，顺周期板块或接力。全年看，科技与高端制造的高弹性、消费板块的修复潜力及政策受益方向或成为超额收益来源，市场或沿“震荡螺旋上升”路径演绎。

行业方面表现分化，政策与产业趋势主导结构性机会。大金融板块全年领涨，银行与非银金融受益于低估值修复及政策利好，涨幅超 30%；通信行业延续 TMT 板块强势，商业化落地加速推动估值提升。家电、汽车等可选消费板块凭借政策扶持与消费升级需求释放，表现居前。相比之下，医药生物、农林牧渔及美容护理等板块受需求疲软拖累，收益率排名靠后。2025 年，科技板块中 AI 基础设施建设、半导体周期上行及软硬科技产业化进程或成为主线，家电、汽车及电子行业亦存在业绩与估值双击潜力；消费板块经历连续调整后，困境反转机会值得关注。

从主要风险因子的走势来看，市值因子在年初表现强势，之后趋于稳定，这与年初大跌时大盘股占优，后走向小盘的市场风格相符。动量因子在前半年走强，后半年趋于平稳。全年的风格轮动依然明显，红利和微盘轮番“搭台唱戏”，哑铃型策略占优。Alpha 表现方面，上半年基本面因子表现突出，分红、盈利因子稳步获利，红利低波风格一度成为市场追逐的热点。但进入下半年后基本面因子有所回落，高频量价类因子在这一阶段迎来业绩赶超。鉴于今年市场环境的复杂性，我们更加重视提升业绩稳定性，根据市场的演化过程不断引入新的因子和改良原有的模型，并强化选股模型对不同风格的适应能力，在保持稳重求胜的风格下追求更好的超额收益率。展望未来，随着经济进一步复苏以及政策进一步发力，资本市场信心和活跃度有望逐步恢复，我们认为基本面和量价模型会有较好的发挥空间，同时我们也将合理进行模型配置。

从中证 1000 指数当前的估值水平来看，截至四季度末其加权 PE 和整体 PE 分别在 42 倍和 36 倍左右，整体 PE 在历史上的分位数在 49%，较前有明显提升。采用 PB 估值则处于历史分位数 12% 之内，仍具有向上空间。未来随着经济的全面逐步复苏及政策的逐步落地，有望迎来估值和盈利的双击。我们认为作为一个高成长性、盈利增长潜力较大，行业分布均匀的中小盘宽基指数，中证 1000 指数依然是当前市场环境下进可攻、退可守的选择。

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，以博取 Alpha 为主要目的的宽基增强型产品在当前市场点位仍具有较高的性价比。尽管市场风格和行业走势会发生变化，但我们仍将坚持一贯的投资理念和投资组合管理体系。在本基金中，我们通过挖掘有投资逻辑的 Alpha 因子，不断改进底层量化模型以及定期监控策略的表现等方式来增强策略表现。我们一直坚守一贯的投资体系和理念，并尽可能以此来稳定投资者对我们超额收益率的预期。在量化增强层面，我们将结合财务数据为基础的基本面信号和实时量价信号，通过机器学习模型来有效选择因子，并通过投资组合管理来控制模型在主要市场风险和行业上相对于基准指数的暴露程度，争取以较为稳定的方式增强中证 1000 指数。另外一方面，由于本基金采用的基本面量化信号和实时量价信号在逻辑和数值层面均有较低的相关性，我们相信能够在兼顾两者的情况下追求稳健的 Alpha，更有效发挥两者的协同和共振效应，并根据市场的流动性和波

动率进行及时优化。我们的投资策略是通过积少成多、以概率取胜的方式增厚投资收益，因此更需要投资者长期持有。我们认为中证 1000 指数当前依然处于历史低估阶段，成长性良好，指数未来上涨的空间依然大于下跌的空间，我们将努力通过科学的手段增强量化模型的超额收益率水平，以此不断为客户增厚投资收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安中证 1000 优选股票发起 A 基金份额净值为 1.1438 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 14.68%，同期业绩比较基准收益率为 1.41%；截至报告期末国泰君安中证 1000 优选股票发起 C 基金份额净值为 1.1390 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 14.22%，同期业绩比较基准收益率为 1.41%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年 A 股市场呈现显著的波动性特征，全年经历了流动性冲击、政策驱动反弹及风格切换等多重考验。年初市场因雪球敲入、两融与 DMA 爆仓等风险事件引发流动性危机，中小盘指数承压；春节后政策托底力度加大，ETF 资金加速流入带动市场超跌反弹。9 月政策全面发力（如“并购六条”、市值管理政策），推动市场风险偏好大幅提升，科创板领头带领市场强势反弹。展望 2025 年，市场预计在政策深化与资金面改善的双重驱动下延续结构性行情。政策层面，“1+N”政策体系将推动资本市场高质量发展，并购重组政策引导资源向新质生产力领域集中，科技、高端制造等领域有望迎来整合潮；财政与货币政策协同发力，特别国债及专项债规模扩大，进一步释放流动性。资金面方面，险资、ETF 及外资构成三大增量来源，市场风险偏好回暖，资金供给端的规模有望较 2024 年明显改善。中证 1000 指数作为市场当前中小盘股的典型代表，具有较强的新兴产业属性，盈利增长潜力较大。从量化模型的 Alpha 角度来看，市场交易量的提升，风险偏好的提高有利于 Alpha 的发挥。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、提升实盘模型的逻辑性、加强全方位的综合 Alpha 解决能力以及策略配置能力等，从而巩固通过量化的投资方法在中证 1000 指数上博取超额收益的能力。

#### 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——上海国泰君安证券资产管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对上海国泰君安证券资产管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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     | 容诚审字[2025]200Z2010 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 | 国泰君安中证 1000 优选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    | 我们审计了国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金（以下简称“国泰君安中证 1000 优选股票发起基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。<br>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中证 1000 优选股票发 |

|                 |  |
|-----------------|--|
|                 | 起基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。  |
| 形成审计意见的基础       | 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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国泰君安中证 1000 优选股票发起基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。  |
| 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>国泰君安中证 1000 优选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中证 1000 优选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中证 1000 优选股票发起基金、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中证 1000 优选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>（1）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>（2）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>（3）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>（4）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中证 1000 优选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中证 1000 优选股票发起基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、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。</p> <p>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。</p> |     |
| 会计师事务所的名称 | 容诚会计师事务所（特殊普通合伙）   |     |
| 注册会计师的姓名  | 张振波  | 徐翹楚 |
| 会计师事务所的地址 | 北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢外经贸大厦 901-22 至 901-26   |     |
| 审计报告日期    | 2025-03-25   |     |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产     | 附注号     | 本期末 2024 年 12 月<br>31 日 | 上年度末 2023 年 12<br>月 31 日 |
|---------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资 产：    |         |                         |                          |
| 货币资金    | 7.4.7.1 | 8,479,583.47            | 36,782,079.63            |
| 结算备付金   |         | 938,735.98              | 10,005,917.80            |
| 存出保证金   |         | 280,176.00              | —                        |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 113,073,500.34          | 193,049,949.41           |
| 其中：股票投资 |         | 113,073,500.34          | 193,049,949.41           |
| 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        | 7.4.7.3    | -                           | -                            |
| 买入返售金融资产      | 7.4.7.4    | -                           | -                            |
| 应收清算款         |            | -                           | -                            |
| 应收股利          |            | -                           | -                            |
| 应收申购款         |            | 502,384.23                  | -                            |
| 递延所得税资产       |            | -                           | -                            |
| 其他资产          | 7.4.7.5    | -                           | -                            |
| 资产总计          |            | 123,274,380.02              | 239,837,946.84               |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末 2024 年 12 月 31 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        | 7.4.7.3    | -                           | -                            |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                           | -                            |
| 应付清算款         |            | 0.00                        | 0.00                         |
| 应付赎回款         |            | 924,916.65                  | -                            |
| 应付管理人报酬       |            | 105,706.84                  | 123,617.42                   |
| 应付托管费         |            | 15,856.03                   | 18,542.61                    |
| 应付销售服务费       |            | 9,907.17                    | 13,997.29                    |

|          |         |                |                |
|----------|---------|----------------|----------------|
| 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     | 7.4.7.6 | 30,000.08      | 7,772.00       |
| 负债合计     |         | 1,086,386.77   | 163,929.32     |
| 净资产：     |         |                |                |
| 实收基金     | 7.4.7.7 | 106,953,988.09 | 240,305,928.96 |
| 未分配利润    | 7.4.7.8 | 15,234,005.16  | -631,911.44    |
| 净资产合计    |         | 122,187,993.25 | 239,674,017.52 |
| 负债和净资产总计 |         | 123,274,380.02 | 239,837,946.84 |

注：1、报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 106,953,988.09 份。其中国泰君安中证 1000 优选股票发起 A 基金份额净值 1.1438 元，基金份额总额 75,865,770.87 份；国泰君安中证 1000 优选股票发起 C 基金份额净值 1.1390 元，基金份额总额 31,088,217.22 份。于 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 240,305,928.96 份。其中国泰君安中证 1000 优选股票发起 A 基金份额净值 0.9974 元，基金份额总额 172,275,944.23 份；国泰君安中证 1000 优选股票发起 C 基金份额净值 0.9972 元，基金份额总额 68,029,984.73 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2024 年度和 2023 年 12 月 12 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：国泰君安中证 1000 优选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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目     | 附注号 | 本期 2024 年 01 月<br>01 日至 2024 年 12<br>月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 12 月 12 日<br>(基金合同生效<br>日)至 2023 年 12<br>月 31 日 |
|---------|-----|---|---|
| 一、营业总收入 |     | 18,740,095.60                               | -467,376.12   |

|                        |            |                     |                   |
|------------------------|------------|---------------------|-------------------|
| 1. 利息收入                |            | 68,611.20           | 23,303.51         |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.9    | 68,611.20           | 23,303.51         |
| 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）      |            | 22,883,835.96       | -841,055.47       |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.10   | 21,479,865.67       | -841,055.47       |
| 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                 | 7.4.7.11   | -697,126.89         | -                 |
| 股利收益                   | 7.4.7.12   | 2,101,097.18        | -                 |
| 其他投资收益                 |            | -                   | -                 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.13   | -4,479,619.73       | 350,375.84        |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                   | -                 |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.14   | 267,268.17          | -                 |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |            | <b>2,337,432.49</b> | <b>164,535.32</b> |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 1,736,245.34        | 123,617.42        |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 260,436.79          | 18,542.61         |
| 3. 销售服务费               | 7.4.10.2.3 | 168,054.36          | 13,997.29         |
| 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             | 7.4.7.15 | 172,696.00    | 8,378.00    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 16,402,663.11 | -631,911.44 |
| 减：所得税费用             |          | -             | -           |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 16,402,663.11 | -631,911.44 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |          | -             | -           |
| 六、综合收益总额            |          | 16,402,663.11 | -631,911.44 |

7.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安中证 1000 优选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 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                                      | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 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                                | 240,305,928.96                                      | -631,911.44   | 239,674,017.52  |
| 二、本期期初净资产                                | 240,305,928.96                                      | -631,911.44   | 239,674,017.52  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -133,351,940.87                                     | 15,865,916.60 | -117,486,024.27 |
| （一）、综合收益总额                               | -   | 16,402,663.11 | 16,402,663.11   |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -133,351,940.87                                     | -536,746.51   | -133,888,687.38 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 44,120,058.36                                       | 5,759,897.84  | 49,879,956.20   |
| 2. 基金赎回款                                 | -177,471,999.23                                     | -6,296,644.35 | -183,768,643.58 |
| （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） | -   | 0.00          | -               |
| 四、本期期末净资产                                | 106,953,988.09                                      | 15,234,005.16 | 122,187,993.25  |
| 项 目                                      | 上年度可比期间 2023 年 12 月 12 日（基金合同生效日）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                                | -   | -             | -               |
| 二、本期期初净资产                                | 240,305,928.96                                      | -             | 240,305,928.96  |



|  |                |             |                |
|--|----------------|-------------|----------------|
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -              | -631,911.44 | -631,911.44    |
| （一）、综合收益总额                               | -              | -631,911.44 | -631,911.44    |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -              | -           | -              |
| 其中：1. 基金申购款                              | -              | -           | -              |
| 2. 基金赎回款                                 | -              | -           | -              |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -              | 0.00        | -              |
| 四、本期期末净资产                                | 240,305,928.96 | -631,911.44 | 239,674,017.52 |

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       | 陶耿        | 王红莲     |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国泰君安中证 1000 优选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[2023]2015 号《关于准予国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由上海国泰君安证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安中证 1000 优选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基金，存续期限不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 240,252,220.83 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(2023)第 0576 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金基金合同》于 2023 年 12 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 240,305,928.96 份基金份额，其中认购资金利息折合 53,708.13 份基金份额。本基金的基金管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金根据是否收取认购费、申购费、销售服务费，将基金份额分为不同的类别。投资人在认购、申购时收取认购费、申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；投资人在认购、申购时不收取认购费、申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资

券、证券公司短期公司债券、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，本基金可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 80%-95%；本基金投资于中证 1000 指数的成份股和备选成份股（均含存托凭证）的比例占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 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》、本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 2024 年度和 2023 年 12 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 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 2024 年 12 月 31 日和 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度和 2023 年 12 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 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 2024 年度和 2023 年 12 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 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业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

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

##### 以摊余成本计量：

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

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，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

本基金持有的金融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。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 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

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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 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，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产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[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。

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 2024 年 12 月 31 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------|-----------------------|
| 活期存款           | 6,331,205.23         | 15,317,045.30         |
| 等于：本金          | 6,330,475.66         | 15,314,192.25         |
| 加：应计利息         | 729.57               | 2,853.05              |
| 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           | 2,148,378.24         | 21,465,034.33         |
| 等于：本金          | 2,148,326.87         | 21,463,783.49         |
| 加：应计利息         | 51.37                | 1,250.84              |
| 减：坏账准备         | -                    | -                     |
| 合计             | 8,479,583.47         | 36,782,079.63         |

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末 2024 年 12 月 31 日 |      |                |               |
|---------------|-------|----------------------|------|----------------|---------------|
|               |       | 成本                   | 应计利息 | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            |       | 117,080,904.23       | -    | 113,073,500.34 | -4,007,403.89 |
| 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            |                       | 117,080,904.23 | -    | 113,073,500.34 | -4,007,403.89 |
| 项目            | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |                |      |                |               |
|               |                       | 成本             | 应计利息 | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            |                       | 192,699,573.57 | -    | 193,049,949.41 | 350,375.84    |
| 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            |                       | 192,699,573.57 | -    | 193,049,949.41 | 350,375.84    |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 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 12 月 31 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 | 2,456,640.00          | -    | -  | -  |
| 股指期货   | 2,456,640.00          | -    | -  | -  |
| 其他衍生工具 | -                     | -    | -  | -  |
| 合计     | 2,456,640.00          | -    | -  | -  |
| 项目     | 上年度末 2023 年 12 月 31 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 | -                     | -    | -  | -  |
| 其他衍生工具 | -                     | -    | -  | -  |
| 合计     | -                     | -    | -  | -  |

7.4.7.3.2 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      |
|------------|--------|----------|--------------|-------------|
| IM2502     | IM2502 | 1        | 1,183,520.00 | -36,480.00  |
| IM2506     | IM2506 | 1        | 1,151,280.00 | -85,360.00  |
| 合计         |        |          |              | -121,840.00 |
| 减：可抵销期货暂收款 |        |          |              | -121,840.00 |
| 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末 2024 年 12 月 31 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|-------------|----------------------|-----------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                    | -                     |
| 应付赎回费       | 0.08                 | -                     |
| 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     | -         | -        |
| 预提审计费    | 30,000.00 | -        |
| 预提信息披露费  | -         | 7,772.00 |
| 合计       | 30,000.08 | 7,772.00 |

7.4.7.7 实收基金

国泰君安中证 1000 优选股票发起 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 172,275,944.23                        | 172,275,944.23  |
| 本期申购          | 25,808,844.96                         | 25,808,844.96   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -122,219,018.32                       | -122,219,018.32 |
| 本期末           | 75,865,770.87                         | 75,865,770.87   |

国泰君安中证 1000 优选股票发起 C

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 68,029,984.73                         | 68,029,984.73  |
| 本期申购          | 18,311,213.40                         | 18,311,213.40  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -55,252,980.91                        | -55,252,980.91 |
| 本期末           | 31,088,217.22                         | 31,088,217.22  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

国泰君安中证 1000 优选股票发起 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           | -694,189.55   | 251,300.08    | -442,889.47   |
| 本期期初           | -694,189.55   | 251,300.08    | -442,889.47   |
| 本期利润           | 17,272,224.93 | -3,716,555.92 | 13,555,669.01 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,580,410.62  | -4,780,612.73 | -2,200,202.11 |
| 其中：基金申购款       | 2,841,096.69  | 188,563.09    | 3,029,659.78  |

|         |               |               |               |
|---------|---------------|---------------|---------------|
| 基金赎回款   | -260,686.07   | -4,969,175.82 | -5,229,861.89 |
| 本期已分配利润 | -             | -             | -             |
| 本期末     | 19,158,446.00 | -8,245,868.57 | 10,912,577.43 |

国泰君安中证 1000 优选股票发起 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           | -288,097.73  | 99,075.76     | -189,021.97   |
| 本期期初           | -288,097.73  | 99,075.76     | -189,021.97   |
| 本期利润           | 3,610,057.91 | -763,063.81   | 2,846,994.10  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 4,365,520.75 | -2,702,065.15 | 1,663,455.60  |
| 其中：基金申购款       | 3,104,821.42 | -374,583.36   | 2,730,238.06  |
| 基金赎回款          | 1,260,699.33 | -2,327,481.79 | -1,066,782.46 |
| 本期已分配利润        | -            | -             | -             |
| 本期末            | 7,687,480.93 | -3,366,053.20 | 4,321,427.73  |

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期 2024 年 01 月 01 日至<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2023 年 12 月<br>12 日（基金合同生效日）至<br>2023 年 12 月 31 日 |
|-----------|--|---|
| 活期存款利息收入  | 25,588.86                                | 11,722.34   |
| 定期存款利息收入  | -  | -   |
| 其他存款利息收入  | 11,061.27                                | 5,663.37  |
| 结算备付金利息收入 | 31,961.07                                | 5,917.80  |
| 其他        | -  | -   |
| 合计        | 68,611.20                                | 23,303.51   |

7.4.7.10 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<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2023 年 12 月<br>12 日（基金合同生效日）至<br>2023 年 12 月 31 日 |
|----|--|---|
|    |  |   |

|            |                  |               |
|------------|------------------|---------------|
| 卖出股票成交总额   | 2,189,291,944.63 | 76,161,333.95 |
| 减：卖出股票成本总额 | 2,166,129,149.54 | 76,917,479.99 |
| 减：交易费用     | 1,682,929.42     | 84,909.43     |
| 买卖股票差价收入   | 21,479,865.67    | -841,055.47   |

7.4.7.11 衍生工具收益

7.4.7.11.1 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<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2023 年 12 月<br>12 日（基金合同生效日）至<br>2023 年 12 月 31 日 |
|----------|--|---|
| 股指期货投资收益 | -682,820.00                              | -   |
| 减：交易费用   | 14,306.89                                | -   |
| 合计       | -697,126.89                              | -   |

7.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期 2024 年 01 月 01 日至<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2023 年 12 月<br>12 日（基金合同生效日）至<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|--|---|
| 股票投资产生的股利收益   | 2,101,097.18                             | -   |
| 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            | 2,101,097.18                             | -   |

7.4.7.13 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<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2023 年 12 月<br>12 日（基金合同生效日）至<br>2023 年 12 月 31 日 |
|------------|--|---|
| 1. 交易性金融资产 | -4,357,779.73                            | 350,375.84  |
| ——股票投资     | -4,357,779.73                            | 350,375.84  |
| ——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    | -121,840.00                              | -   |
| ——权证投资     | -  | -   |

|                        |               |            |
|------------------------|---------------|------------|
| 期货投资                   | -121,840.00   | -          |
| 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                     | -4,479,619.73 | 350,375.84 |

7.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2024 年 01 月 01 日至<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2023 年 12 月<br>12 日（基金合同生效日）至<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------|--|---|
| 基金赎回费收入 | 267,268.17                               | -   |
| 合计      | 267,268.17                               | -   |

7.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2024 年 01 月 01 日至<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2023 年 12 月<br>12 日（基金合同生效日）至<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------|--|---|
| 审计费用    | 30,000.00                                | -   |
| 信息披露费   | 142,228.00                               | 7,772.00  |
| 证券出借违约金 | -  | -   |
| 银行汇划费   | 468.00                                   | 206.00  |
| 证券账户开户费 | -  | 400.00  |
| 合计      | 172,696.00                               | 8,378.00  |

7.4.7.16 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。

7.4.8 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         |
| 中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)     | 基金托管人、代销机构    |
| 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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |              | 上年度可比期间 2023 年 12 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 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 | 4,278,329,774.38                      | 100.00%      | 345,778,387.51                                      | 100.00%      |

7.4.10.1.2 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。



7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金报告期及上年度可比期间未有通过关联方单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 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 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 | 313,686.96  | 100.00%    | 0.00     | 0.00%        |
| 关联方名称  | 上年度可比期间 2023 年 12 月 12 日（基金合同生效日）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 | 24,638.74   | 100.00%    | 0.00     | 0.00%        |

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

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

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 2024 年 01 月 01 日至<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2023 年 12 月<br>12 日（基金合同生效日）至<br>2023 年 12 月 31 日 |
|------------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 1,736,245.34                             | 123,617.42  |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 794,325.58                               | 59,705.96   |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 941,919.76                               | 63,911.46   |

注：基金管理人报酬按前一日的基金资产净值的 1.00%的年费率计提。计算方法如下：

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期 2024 年 01 月 01 日至<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2023 年 12 月<br>12 日（基金合同生效日）至<br>2023 年 12 月 31 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 260,436.79                               | 18,542.61   |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 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。

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<br>名称 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日                  |                          |            |
|--------------------|--|--------------------------|------------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                       |                          |            |
|                    | 国泰君安中证 1000 优选<br>股票发起 A                               | 国泰君安中证 1000 优选<br>股票发起 C | 合计         |
| 国泰君安证券             | -  | 134,551.55               | 134,551.55 |
| 中国工商银行             | -  | 4,326.60                 | 4,326.60   |
| 国泰君安资管             | -  | 27,239.59                | 27,239.59  |
| 合计                 | -  | 166,117.74               | 166,117.74 |
| 获得销售服务费的各关联方<br>名称 | 上年度可比期间 2023 年 12 月 12 日（基金合同生效日）至 2023<br>年 12 月 31 日 |                          |            |
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                       |                          |            |
|                    | 国泰君安中证 1000 优选<br>股票发起 A                               | 国泰君安中证 1000 优选<br>股票发起 C | 合计         |
| 国泰君安证券             | -  | 11,254.25                | 11,254.25  |
| 中国工商银行             | -  | 234.25                   | 234.25     |
| 国泰君安资管             | -  | 3,086.71                 | 3,086.71   |
| 合计                 | -  | 14,575.21                | 14,575.21  |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

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 X0.40%/当年天数。

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国泰君安中证 1000 优选股票发起 A

份额单位：份

| 项目                               | 本期 2024 年 01 月 01 日至<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2023 年 12 月<br>12 日（基金合同生效日）至<br>2023 年 12 月 31 日 |
|----------------------------------|--|---|
| 基金合同生效日（2023 年 12 月 12 日）持有的基金份额 | -  | 5,009,225.45  |
| 报告期初持有的基金份额                      | 5,009,225.45                             | -   |
| 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<br>额               | -  | -   |
| 报告期末持有的基金份额                      | 5,009,225.45                             | 5,009,225.45  |
| 报告期末持有的基金份额占基<br>金总份额比例          | 6.60%                                    | 2.91%   |

国泰君安中证 1000 优选股票发起 C

份额单位：份

| 项目                               | 本期 2024 年 01 月 01 日至<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2023 年 12 月<br>12 日（基金合同生效日）至<br>2023 年 12 月 31 日 |
|----------------------------------|--|---|
| 基金合同生效日（2023 年 12 月 12 日）持有的基金份额 | -  | 5,000,225.00  |
| 报告期初持有的基金份额                      | 5,000,225.00                             | -   |
| 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         | 5,000,225.00 | 5,000,225.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 16.08%       | 7.35%        |

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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 12 月 31 日 |           | 上年度可比期间 2023 年 12 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 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    |
| 国泰君安证券 | 2,148,378.24                          | 11,061.27 | 21,465,034.33                                       | 5,663.37  |
| 中国工商银行 | 6,331,205.23                          | 25,588.86 | 15,317,045.30                                       | 11,722.34 |

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国工商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。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 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

本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2024 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

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |                  |           |         |       |        |          |           |           |    |
|----------------------|------|------------------|-----------|---------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日            | 受限期       | 流通受限类型  | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 301626               | 苏州天脉 | 2024 年 10 月 17 日 | 1-6 个月（含） | 创业板打新限售 | 21.23 | 65.78  | 730      | 15,497.90 | 48,019.40 | -  |
| 301611               | 珂玛科技 | 2024 年 08 月 07 日 | 1-6 个月（含） | 创业板打新限售 | 8.00  | 56.10  | 608      | 4,864.00  | 34,108.80 | -  |
| 301551               | 无线传媒 | 2024 年 09 月 19 日 | 1-6 个月（含） | 创业板打新限售 | 9.40  | 43.23  | 652      | 6,128.80  | 28,185.96 | -  |
| 688726               | 拉普拉斯 | 2024 年 10 月 22 日 | 1-6 个月（含） | 科创板打新限售 | 17.58 | 33.06  | 565      | 9,932.70  | 18,678.90 | -  |
| 688615               | 合合信息 | 2024 年 09 月 19 日 | 1-6 个月（含） | 科创板打新限售 | 55.18 | 165.78 | 95       | 5,242.10  | 15,749.10 | -  |
| 301522               | 上大股份 | 2024 年 10 月 09 日 | 1-6 个月（含） | 创业板打新限售 | 6.88  | 24.84  | 590      | 4,059.20  | 14,655.60 | -  |
| 301586               | 佳力奇  | 2024 年 08 月 21 日 | 1-6 个月（含） | 创业板打新限售 | 18.09 | 53.14  | 215      | 3,889.35  | 11,425.10 | -  |
| 688710               | 益诺思  | 2024 年 08 月 27 日 | 1-6 个月（含） | 科创板打新限售 | 19.06 | 33.58  | 259      | 4,936.54  | 8,697.22  | -  |
| 00127                | 强    | 2024 年           | 1-6 个     | 股票      | 9.68  | 27.91  | 265      | 2,565.20  | 7,396.15  | -  |

|        |      |                  |            |         |       |        |     |          |          |   |
|--------|------|------------------|------------|---------|-------|--------|-----|----------|----------|---|
| 9      | 邦新材  | 09 月 27 日        | 月 (含)      | 流通受限    |       |        |     |          |          |   |
| 301613 | 新铝时代 | 2024 年 10 月 18 日 | 1-6 个月 (含) | 创业板打新限售 | 27.70 | 41.77  | 169 | 4,681.30 | 7,059.13 | - |
| 301608 | 博实结  | 2024 年 07 月 25 日 | 1-6 个月 (含) | 创业板打新限售 | 44.50 | 65.38  | 107 | 4,761.50 | 6,995.66 | - |
| 301622 | 英思特  | 2024 年 11 月 26 日 | 1-6 个月 (含) | 创业板打新限售 | 22.36 | 44.92  | 152 | 3,398.72 | 6,827.84 | - |
| 301631 | 壹连科技 | 2024 年 11 月 12 日 | 1-6 个月 (含) | 创业板打新限售 | 72.99 | 101.96 | 51  | 3,722.49 | 5,199.96 | - |
| 301585 | 蓝宇股份 | 2024 年 12 月 10 日 | 1-6 个月 (含) | 创业板打新限售 | 23.95 | 35.85  | 144 | 3,448.80 | 5,162.40 | - |
| 603207 | 小方制药 | 2024 年 08 月 19 日 | 1-6 个月 (含) | 股票流通受限  | 12.47 | 26.65  | 184 | 2,294.48 | 4,903.60 | - |
| 301617 | 博苑股份 | 2024 年 12 月 03 日 | 1-6 个月 (含) | 创业板打新限售 | 27.76 | 39.79  | 113 | 3,136.88 | 4,496.27 | - |
| 603350 | 安乃达  | 2024 年 06 月 26 日 | 1-6 个月 (含) | 股票流通受限  | 20.56 | 36.17  | 100 | 2,056.00 | 3,617.00 | - |
| 603205 | 健尔康  | 2024 年 10 月 29 日 | 1-6 个月 (含) | 股票流通受限  | 14.65 | 27.35  | 128 | 1,875.20 | 3,500.80 | - |
| 603091 | 众鑫股份 | 2024 年 09 月 10 日 | 1-6 个月 (含) | 股票流通受限  | 26.50 | 44.43  | 76  | 2,014.00 | 3,376.68 | - |
| 603310 | 巍华新  | 2024 年 08 月 07 日 | 1-6 个月 (含) | 股票流通受限  | 17.39 | 17.95  | 93  | 1,617.27 | 1,669.35 | - |

|  |   |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|--|---|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
|  | 材 |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|--|---|--|--|--|--|--|--|--|--|--|

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

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

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

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。

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工商银行股份有限公司，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 12 月 31 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)。

#### 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 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、存出保证金、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<br>2024 年 12<br>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                       | 8,479,583.47 | -     | -     | -              | 8,479,583.47   |
| 结算备付金                      | 938,735.98   | -     | -     | -              | 938,735.98     |
| 存出保证金                      | 280,176.00   | -     | -     | -              | 280,176.00     |
| 交易性金融资产                    | -            | -     | -     | 113,073,500.34 | 113,073,500.34 |
| 应收申购款                      | -            | -     | -     | 502,384.23     | 502,384.23     |
| 资产总计                       | 9,698,495.45 | -     | -     | 113,575,884.57 | 123,274,380.02 |
| 负债                         |              |       |       |                |                |
| 应付赎回款                      | -            | -     | -     | 924,916.65     | 924,916.65     |
| 应付管理人                      | -            | -     | -     | 105,706.84     | 105,706.84     |

|                          |               |       |       |                |                |
|--------------------------|---------------|-------|-------|----------------|----------------|
| 报酬                       |               |       |       |                |                |
| 应付托管费                    | -             | -     | -     | 15,856.03      | 15,856.03      |
| 应付销售服务费                  | -             | -     | -     | 9,907.17       | 9,907.17       |
| 其他负债                     | -             | -     | -     | 30,000.08      | 30,000.08      |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 1,086,386.77   | 1,086,386.77   |
| 利率敏感度缺口                  | 9,698,495.45  | -     | -     | 112,489,497.80 | 122,187,993.25 |
| 上年度末<br>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                     | 36,782,079.63 | -     | -     | -              | 36,782,079.63  |
| 结算备付金                    | 10,005,917.80 | -     | -     | -              | 10,005,917.80  |
| 交易性金融资产                  | -             | -     | -     | 193,049,949.41 | 193,049,949.41 |
| 资产总计                     | 46,787,997.43 | -     | -     | 193,049,949.41 | 239,837,946.84 |
| 负债                       |               |       |       |                |                |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 123,617.42     | 123,617.42     |
| 应付托管费                    | -             | -     | -     | 18,542.61      | 18,542.61      |
| 应付销售服务费                  | -             | -     | -     | 13,997.29      | 13,997.29      |
| 其他负债                     | -             | -     | -     | 7,772.00       | 7,772.00       |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 163,929.32     | 163,929.32     |
| 利率敏感度缺口                  | 46,787,997.43 | -     | -     | 192,886,020.09 | 239,674,017.52 |

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 2024 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%(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)。

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 2024 年 12 月 31 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  | 113,073,500.34       | 92.54         | 193,049,949.41        | 80.55         |
| 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            | 113,073,500.34       | 92.54         | 193,049,949.41        | 80.55         |

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 2024 年 12 月 31 日        | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|    | 业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%          | 6,129,523.54                | —                     |
|    | 业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%          | -6,129,523.54               | —                     |

注：于 2023 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 2024 年 12 月 31 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------------|-----------------------|
| 第一层次          | 112,833,775.42       | 192,984,499.41        |
| 第二层次          | -                    | 65,450.00             |
| 第三层次          | 239,724.92           | -                     |
| 合计            | 113,073,500.34       | 193,049,949.41        |

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

单位：人民币元

| 项目        | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日 |            |            |
|-----------|---------------------------------------|------------|------------|
|           | 交易性金融资产                               |            | 合计         |
|           | 债券投资                                  | 股票投资       |            |
| 期初余额      | -                                     | -          | -          |
| 当期购买      | -                                     | -          | -          |
| 当期出售/结算   | -                                     | -          | -          |
| 转入第三层次    | -                                     | 187,904.57 | 187,904.57 |
| 转出第三层次    | -                                     | 189,495.67 | 189,495.67 |
| 当期利得或损失总额 | -                                     | 241,316.02 | 241,316.02 |

|  |   |            |            |
|--|---|------------|------------|
| 其中：计入损益的利得或损失                              | -   | 241,316.02 | 241,316.02 |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | -   | -          | -          |
| 期末余额                                       | -   | 239,724.92 | 239,724.92 |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | -   | 149,602.49 | 149,602.49 |
| 项目   | 上年度可比期间 2023 年 12 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日 |            |            |
|  | 交易性金融资产   |            | 合计         |
|  | 债券投资  | 股票投资       |            |
| 期初余额                                       | -   | -          | -          |
| 当期购买                                       | -   | -          | -          |
| 当期出售/结算                                    | -   | -          | -          |
| 转入第三层次                                     | -   | -          | -          |
| 转出第三层次                                     | -   | -          | -          |
| 当期利得或损失总额                                  | -   | -          | -          |
| 其中：计入损益的利得或损失                              | -   | -          | -          |
| 计入其他综合收益的利得或损失                             | -   | -          | -          |
| 期末余额                                       | -   | -          | -          |
| 期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 | -   | -          | -          |

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

| 项目 | 本期末公允价值   | 采用的估值技术 | 不可观察输入值 |          |            |
|----|-----------|---------|---------|----------|------------|
|    |           |         | 名称      | 范围/加权平均值 | 与公允价值之间的关系 |
| 流动 | 239,724.9 | 亚式期权    | 预期年化波动率 | 34.23%-  | 负相关        |

|                 |   |    |  |         |  |
|-----------------|---|----|--|---------|--|
| 性折扣估值处于限售期的股票投资 | 2 | 模型 |  | 574.44% |  |
|-----------------|---|----|--|---------|--|

7.4.14.3 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。

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     | 113,073,500.34 | 91.73         |
|    | 其中：股票    | 113,073,500.34 | 91.73         |
| 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      | 9,418,319.45   | 7.64   |
| 8 | 其他各项资产            | 782,560.23     | 0.63   |
| 9 | 合计                | 123,274,380.02 | 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         | 78,690.00      | 0.06         |
| B  | 采矿业              | 943,318.00     | 0.77         |
| C  | 制造业              | 76,321,971.30  | 62.46        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,277,349.00   | 2.68         |
| E  | 建筑业              | 3,139,138.00   | 2.57         |
| F  | 批发和零售业           | 3,132,680.00   | 2.56         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 4,481,267.00   | 3.67         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 6,067.00       | 0.00         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 13,561,808.14  | 11.10        |
| J  | 金融业              | 2,200,168.80   | 1.80         |
| K  | 房地产业             | 990,010.00     | 0.81         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 733,593.00     | 0.60         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,518,771.10   | 1.24         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 887,176.00     | 0.73         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 675,325.00     | 0.55         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 1,118,637.00   | 0.92         |
| S  | 综合               | 7,531.00       | 0.01         |
|    | 合计               | 113,073,500.34 | 92.54        |

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<br>（元）      | 占基金资产净值比<br>例（%） |
|----|--------|--------|---------|------------------|------------------|
| 1  | 002249 | 大洋电机   | 215,300 | 1,263,811.0<br>0 | 1.03             |
| 2  | 002396 | 星网锐捷   | 64,800  | 1,230,552.0<br>0 | 1.01             |
| 3  | 002204 | 大连重工   | 244,200 | 1,216,116.0<br>0 | 1.00             |
| 4  | 600267 | 海正药业   | 145,600 | 1,208,480.0<br>0 | 0.99             |
| 5  | 300079 | 数码视讯   | 220,700 | 1,193,987.0<br>0 | 0.98             |
| 6  | 603888 | 新华网    | 51,900  | 1,159,446.0<br>0 | 0.95             |
| 7  | 600210 | 紫江企业   | 174,200 | 1,151,462.0<br>0 | 0.94             |
| 8  | 600428 | 中远海特   | 153,500 | 1,120,550.0<br>0 | 0.92             |
| 9  | 002626 | 金达威    | 73,500  | 1,109,850.0<br>0 | 0.91             |
| 10 | 300618 | 寒锐钴业   | 32,800  | 1,107,656.0<br>0 | 0.91             |
| 11 | 601096 | 宏盛华源   | 254,100 | 1,105,335.0<br>0 | 0.90             |
| 12 | 688347 | 华虹公司   | 23,422  | 1,088,420.3<br>4 | 0.89             |
| 13 | 300398 | 飞凯材料   | 68,700  | 1,082,712.0<br>0 | 0.89             |
| 14 | 002036 | 联创电子   | 114,000 | 1,071,600.0<br>0 | 0.88             |
| 15 | 688128 | 中国电研   | 49,695  | 1,044,091.9<br>5 | 0.85             |
| 16 | 600667 | 太极实业   | 148,400 | 1,026,928.0<br>0 | 0.84             |
| 17 | 002668 | TCL 智家 | 78,200  | 1,025,984.0<br>0 | 0.84             |
| 18 | 000617 | 中油资本   | 147,200 | 1,014,208.0<br>0 | 0.83             |
| 19 | 688209 | 英集芯    | 56,953  | 1,006,359.5<br>1 | 0.82             |
| 20 | 002550 | 千红制药   | 160,300 | 993,860.00       | 0.81             |
| 21 | 002489 | 浙江永强   | 305,500 | 989,820.00       | 0.81             |



|    |        |      |         |            |      |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 22 | 002567 | 唐人神  | 189,900 | 968,490.00 | 0.79 |
| 23 | 603766 | 隆鑫通用 | 106,400 | 968,240.00 | 0.79 |
| 24 | 300232 | 洲明科技 | 139,800 | 960,426.00 | 0.79 |
| 25 | 300315 | 掌趣科技 | 172,100 | 946,550.00 | 0.77 |
| 26 | 000966 | 长源电力 | 198,800 | 944,300.00 | 0.77 |
| 27 | 601068 | 中铝国际 | 199,200 | 878,472.00 | 0.72 |
| 28 | 600531 | 豫光金铅 | 136,000 | 873,120.00 | 0.71 |
| 29 | 002212 | 天融信  | 134,800 | 869,460.00 | 0.71 |
| 30 | 600812 | 华北制药 | 166,300 | 859,771.00 | 0.70 |
| 31 | 002004 | 华邦健康 | 190,100 | 859,252.00 | 0.70 |
| 32 | 002446 | 盛路通信 | 129,500 | 848,225.00 | 0.69 |
| 33 | 300039 | 上海凯宝 | 133,800 | 826,884.00 | 0.68 |
| 34 | 603118 | 共进股份 | 92,300  | 821,470.00 | 0.67 |
| 35 | 600305 | 恒顺醋业 | 102,800 | 820,344.00 | 0.67 |
| 36 | 601083 | 锦江航运 | 85,100  | 810,152.00 | 0.66 |
| 37 | 600073 | 光明肉业 | 111,900 | 776,586.00 | 0.64 |
| 38 | 688348 | 昱能科技 | 15,831  | 772,552.80 | 0.63 |
| 39 | 002151 | 北斗星通 | 28,600  | 759,044.00 | 0.62 |
| 40 | 300346 | 南大光电 | 19,600  | 756,364.00 | 0.62 |
| 41 | 600017 | 日照港  | 232,400 | 743,680.00 | 0.61 |
| 42 | 300579 | 数字认证 | 23,400  | 735,228.00 | 0.60 |
| 43 | 600595 | 中孚实业 | 256,700 | 726,461.00 | 0.59 |
| 44 | 601369 | 陕鼓动力 | 82,200  | 715,140.00 | 0.59 |
| 45 | 000021 | 深科技  | 37,200  | 709,032.00 | 0.58 |
| 46 | 601107 | 四川成渝 | 135,000 | 706,050.00 | 0.58 |
| 47 | 300674 | 宇信科技 | 35,800  | 698,816.00 | 0.57 |
| 48 | 002987 | 京北方  | 48,300  | 687,309.00 | 0.56 |
| 49 | 688088 | 虹软科技 | 17,723  | 683,398.88 | 0.56 |
| 50 | 601949 | 中国出版 | 94,200  | 676,356.00 | 0.55 |
| 51 | 300244 | 迪安诊断 | 59,500  | 675,325.00 | 0.55 |
| 52 | 002061 | 浙江交科 | 164,800 | 672,384.00 | 0.55 |
| 53 | 300438 | 鹏辉能源 | 23,800  | 669,018.00 | 0.55 |
| 54 | 002506 | 协鑫集成 | 250,400 | 668,568.00 | 0.55 |
| 55 | 000969 | 安泰科技 | 56,400  | 628,860.00 | 0.51 |
| 56 | 300598 | 诚迈科技 | 12,900  | 624,360.00 | 0.51 |
| 57 | 002456 | 欧菲光  | 51,500  | 616,970.00 | 0.50 |
| 58 | 002414 | 高德红外 | 82,800  | 615,204.00 | 0.50 |
| 59 | 002434 | 万里扬  | 99,200  | 615,040.00 | 0.50 |
| 60 | 600640 | 国脉文化 | 51,200  | 611,328.00 | 0.50 |
| 61 | 300735 | 光弘科技 | 21,800  | 610,182.00 | 0.50 |
| 62 | 600664 | 哈药股份 | 141,000 | 582,330.00 | 0.48 |
| 63 | 002906 | 华阳集团 | 18,900  | 581,175.00 | 0.48 |
| 64 | 000686 | 东北证券 | 71,820  | 570,250.80 | 0.47 |

|     |        |       |         |            |      |
|-----|--------|-------|---------|------------|------|
| 65  | 002378 | 章源钨业  | 87,800  | 568,066.00 | 0.46 |
| 66  | 300080 | 易成新能  | 128,800 | 562,856.00 | 0.46 |
| 67  | 002226 | 江南化工  | 98,200  | 532,244.00 | 0.44 |
| 68  | 600338 | 西藏珠峰  | 48,900  | 521,763.00 | 0.43 |
| 69  | 002273 | 水晶光电  | 23,300  | 517,726.00 | 0.42 |
| 70  | 002612 | 朗姿股份  | 31,200  | 510,432.00 | 0.42 |
| 71  | 002421 | 达实智能  | 147,000 | 504,210.00 | 0.41 |
| 72  | 300261 | 雅本化学  | 72,500  | 496,625.00 | 0.41 |
| 73  | 600717 | 天津港   | 98,300  | 478,721.00 | 0.39 |
| 74  | 688321 | 微芯生物  | 25,589  | 475,443.62 | 0.39 |
| 75  | 600827 | 百联股份  | 43,400  | 474,362.00 | 0.39 |
| 76  | 600710 | 苏美达   | 50,600  | 470,580.00 | 0.39 |
| 77  | 301175 | 中科环保  | 86,100  | 464,940.00 | 0.38 |
| 78  | 688107 | 安路科技  | 15,700  | 464,406.00 | 0.38 |
| 79  | 601399 | 国机重装  | 150,000 | 462,000.00 | 0.38 |
| 80  | 002015 | 协鑫能科  | 59,500  | 461,720.00 | 0.38 |
| 81  | 300115 | 长盈精密  | 28,400  | 461,216.00 | 0.38 |
| 82  | 000725 | 京东方 A | 104,500 | 458,755.00 | 0.38 |
| 83  | 300666 | 江丰电子  | 6,400   | 444,480.00 | 0.36 |
| 84  | 300570 | 太辰光   | 6,100   | 443,470.00 | 0.36 |
| 85  | 600866 | 星湖科技  | 68,500  | 443,195.00 | 0.36 |
| 86  | 300602 | 飞荣达   | 23,000  | 442,060.00 | 0.36 |
| 87  | 600420 | 国药现代  | 36,700  | 438,198.00 | 0.36 |
| 88  | 688158 | 优刻得   | 31,056  | 434,162.88 | 0.36 |
| 89  | 688658 | 悦康药业  | 30,019  | 432,573.79 | 0.35 |
| 90  | 603171 | 税友股份  | 14,100  | 430,050.00 | 0.35 |
| 91  | 300634 | 彩讯股份  | 19,500  | 425,100.00 | 0.35 |
| 92  | 600780 | 通宝能源  | 74,900  | 421,687.00 | 0.35 |
| 93  | 688362 | 甬矽电子  | 12,400  | 417,632.00 | 0.34 |
| 94  | 002705 | 新宝股份  | 27,700  | 415,500.00 | 0.34 |
| 95  | 002585 | 双星新材  | 77,400  | 413,316.00 | 0.34 |
| 96  | 300768 | 迪普科技  | 23,200  | 406,000.00 | 0.33 |
| 97  | 300184 | 力源信息  | 41,900  | 390,927.00 | 0.32 |
| 98  | 300400 | 劲拓股份  | 24,000  | 389,280.00 | 0.32 |
| 99  | 000415 | 渤海租赁  | 102,400 | 386,048.00 | 0.32 |
| 100 | 000528 | 柳工    | 32,000  | 385,920.00 | 0.32 |
| 101 | 301526 | 国际复材  | 103,900 | 384,430.00 | 0.31 |
| 102 | 300088 | 长信科技  | 58,200  | 380,628.00 | 0.31 |
| 103 | 688066 | 航天宏图  | 18,503  | 377,461.20 | 0.31 |
| 104 | 688372 | 伟测科技  | 6,329   | 370,373.08 | 0.30 |
| 105 | 002145 | 中核钛白  | 87,200  | 369,728.00 | 0.30 |
| 106 | 000550 | 江铃汽车  | 15,700  | 368,165.00 | 0.30 |
| 107 | 300726 | 宏达电子  | 11,600  | 360,760.00 | 0.30 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 108 | 601766 | 中国中车 | 42,700  | 357,826.00 | 0.29 |
| 109 | 000419 | 通程控股 | 62,300  | 355,733.00 | 0.29 |
| 110 | 601022 | 宁波远洋 | 44,200  | 354,926.00 | 0.29 |
| 111 | 301318 | 维海德  | 12,000  | 354,240.00 | 0.29 |
| 112 | 300151 | 昌红科技 | 20,700  | 351,900.00 | 0.29 |
| 113 | 601857 | 中国石油 | 39,300  | 351,342.00 | 0.29 |
| 114 | 000543 | 皖能电力 | 44,200  | 349,622.00 | 0.29 |
| 115 | 600478 | 科力远  | 84,600  | 349,398.00 | 0.29 |
| 116 | 002649 | 博彦科技 | 28,500  | 345,420.00 | 0.28 |
| 117 | 002020 | 京新药业 | 25,700  | 328,960.00 | 0.27 |
| 118 | 002125 | 湘潭电化 | 32,160  | 324,172.80 | 0.27 |
| 119 | 688131 | 皓元医药 | 9,079   | 324,120.30 | 0.27 |
| 120 | 688029 | 南微医学 | 4,794   | 324,026.46 | 0.27 |
| 121 | 300363 | 博腾股份 | 20,500  | 323,285.00 | 0.26 |
| 122 | 300772 | 运达股份 | 24,300  | 321,732.00 | 0.26 |
| 123 | 601187 | 厦门银行 | 55,600  | 313,584.00 | 0.26 |
| 124 | 000837 | 秦川机床 | 34,700  | 311,259.00 | 0.25 |
| 125 | 300459 | 汤姆猫  | 53,000  | 304,220.00 | 0.25 |
| 126 | 002562 | 兄弟科技 | 70,700  | 300,475.00 | 0.25 |
| 127 | 002023 | 海特高新 | 29,500  | 299,425.00 | 0.25 |
| 128 | 300393 | 中来股份 | 47,600  | 297,500.00 | 0.24 |
| 129 | 600340 | 华夏幸福 | 109,500 | 294,555.00 | 0.24 |
| 130 | 300672 | 国科微  | 4,400   | 293,700.00 | 0.24 |
| 131 | 600050 | 中国联通 | 55,200  | 293,112.00 | 0.24 |
| 132 | 300424 | 航新科技 | 16,200  | 292,572.00 | 0.24 |
| 133 | 600480 | 凌云股份 | 26,900  | 290,789.00 | 0.24 |
| 134 | 301370 | 国科恒泰 | 26,800  | 289,440.00 | 0.24 |
| 135 | 600582 | 天地科技 | 46,600  | 287,988.00 | 0.24 |
| 136 | 688586 | 江航装备 | 30,050  | 287,578.50 | 0.24 |
| 137 | 301297 | 富乐德  | 6,766   | 287,555.00 | 0.24 |
| 138 | 000026 | 飞亚达  | 27,300  | 283,101.00 | 0.23 |
| 139 | 300045 | 华力创通 | 13,400  | 279,926.00 | 0.23 |
| 140 | 002349 | 精华制药 | 35,700  | 273,105.00 | 0.22 |
| 141 | 600366 | 宁波韵升 | 36,900  | 271,584.00 | 0.22 |
| 142 | 601718 | 际华集团 | 94,800  | 269,232.00 | 0.22 |
| 143 | 000555 | 神州信息 | 24,000  | 268,800.00 | 0.22 |
| 144 | 603005 | 晶方科技 | 9,300   | 262,725.00 | 0.22 |
| 145 | 600075 | 新疆天业 | 60,120  | 261,522.00 | 0.21 |
| 146 | 688612 | 威迈斯  | 11,000  | 258,940.00 | 0.21 |
| 147 | 600961 | 株冶集团 | 32,800  | 258,136.00 | 0.21 |
| 148 | 002255 | 海陆重工 | 46,300  | 257,428.00 | 0.21 |
| 149 | 603986 | 兆易创新 | 2,400   | 256,320.00 | 0.21 |
| 150 | 600248 | 陕建股份 | 57,100  | 255,808.00 | 0.21 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 151 | 603259 | 药明康德 | 4,600  | 253,184.00 | 0.21 |
| 152 | 300641 | 正丹股份 | 10,100 | 250,884.00 | 0.21 |
| 153 | 002578 | 闽发铝业 | 82,800 | 247,572.00 | 0.20 |
| 154 | 000901 | 航天科技 | 22,500 | 246,825.00 | 0.20 |
| 155 | 688568 | 中科星图 | 4,800  | 244,944.00 | 0.20 |
| 156 | 002267 | 陕天然气 | 28,400 | 239,980.00 | 0.20 |
| 157 | 301221 | 光庭信息 | 4,900  | 238,042.00 | 0.19 |
| 158 | 600037 | 歌华有线 | 31,900 | 237,974.00 | 0.19 |
| 159 | 301376 | 致欧科技 | 12,400 | 237,088.00 | 0.19 |
| 160 | 600662 | 外服控股 | 46,700 | 236,769.00 | 0.19 |
| 161 | 301205 | 联特科技 | 3,100  | 234,639.00 | 0.19 |
| 162 | 300083 | 创世纪  | 36,000 | 234,360.00 | 0.19 |
| 163 | 600722 | 金牛化工 | 50,000 | 234,000.00 | 0.19 |
| 164 | 605365 | 立达信  | 14,900 | 233,930.00 | 0.19 |
| 165 | 000957 | 中通客车 | 20,500 | 225,500.00 | 0.18 |
| 166 | 002548 | 金新农  | 56,800 | 225,496.00 | 0.18 |
| 167 | 003039 | 顺控发展 | 16,200 | 211,896.00 | 0.17 |
| 168 | 002773 | 康弘药业 | 10,800 | 211,680.00 | 0.17 |
| 169 | 688660 | 电气风电 | 23,300 | 209,700.00 | 0.17 |
| 170 | 600853 | 龙建股份 | 51,800 | 207,200.00 | 0.17 |
| 171 | 300101 | 振芯科技 | 9,500  | 205,770.00 | 0.17 |
| 172 | 000931 | 中关村  | 42,900 | 204,204.00 | 0.17 |
| 173 | 301262 | 海看股份 | 8,200  | 203,934.00 | 0.17 |
| 174 | 688380 | 中微半导 | 6,700  | 200,330.00 | 0.16 |
| 175 | 600216 | 浙江医药 | 12,400 | 196,664.00 | 0.16 |
| 176 | 002549 | 凯美特气 | 31,000 | 190,030.00 | 0.16 |
| 177 | 300357 | 我武生物 | 9,300  | 188,976.00 | 0.15 |
| 178 | 002920 | 德赛西威 | 1,700  | 187,187.00 | 0.15 |
| 179 | 603299 | 苏盐井神 | 16,700 | 186,038.00 | 0.15 |
| 180 | 688798 | 艾为电子 | 2,645  | 184,673.90 | 0.15 |
| 181 | 002011 | 盾安环境 | 17,000 | 183,770.00 | 0.15 |
| 182 | 600320 | 振华重工 | 46,400 | 181,888.00 | 0.15 |
| 183 | 300648 | 星云股份 | 7,700  | 177,100.00 | 0.14 |
| 184 | 600383 | 金地集团 | 40,400 | 176,952.00 | 0.14 |
| 185 | 601208 | 东材科技 | 23,400 | 176,436.00 | 0.14 |
| 186 | 301025 | 读客文化 | 18,500 | 176,305.00 | 0.14 |
| 187 | 300352 | 北信源  | 33,300 | 175,824.00 | 0.14 |
| 188 | 002916 | 深南电路 | 1,400  | 175,000.00 | 0.14 |
| 189 | 002237 | 恒邦股份 | 17,200 | 173,720.00 | 0.14 |
| 190 | 600367 | 红星发展 | 14,300 | 165,022.00 | 0.14 |
| 191 | 603043 | 广州酒家 | 9,800  | 162,974.00 | 0.13 |
| 192 | 603083 | 剑桥科技 | 4,000  | 162,400.00 | 0.13 |
| 193 | 603890 | 春秋电子 | 13,800 | 162,150.00 | 0.13 |

|     |        |       |        |            |      |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 194 | 000881 | 中广核技  | 22,100 | 161,993.00 | 0.13 |
| 195 | 688739 | 成大生物  | 6,200  | 159,836.00 | 0.13 |
| 196 | 002745 | 木林森   | 18,300 | 159,576.00 | 0.13 |
| 197 | 002697 | 红旗连锁  | 26,900 | 158,979.00 | 0.13 |
| 198 | 300035 | 中科电气  | 10,600 | 158,470.00 | 0.13 |
| 199 | 688337 | 普源精电  | 4,040  | 157,560.00 | 0.13 |
| 200 | 600328 | 中盐化工  | 19,900 | 156,613.00 | 0.13 |
| 201 | 688409 | 富创精密  | 3,000  | 154,710.00 | 0.13 |
| 202 | 688512 | 慧智微   | 15,200 | 150,632.00 | 0.12 |
| 203 | 000050 | 深天马 A | 16,500 | 148,995.00 | 0.12 |
| 204 | 603530 | 神马电力  | 6,000  | 148,260.00 | 0.12 |
| 205 | 000850 | 华茂股份  | 35,800 | 147,854.00 | 0.12 |
| 206 | 002535 | 林州重机  | 38,300 | 146,689.00 | 0.12 |
| 207 | 000920 | 沃顿科技  | 16,400 | 146,288.00 | 0.12 |
| 208 | 600557 | 康缘药业  | 10,700 | 145,734.00 | 0.12 |
| 209 | 688522 | 纳睿雷达  | 2,500  | 140,850.00 | 0.12 |
| 210 | 600644 | 乐山电力  | 23,000 | 140,760.00 | 0.12 |
| 211 | 300306 | 远方信息  | 12,100 | 140,360.00 | 0.11 |
| 212 | 300663 | 科蓝软件  | 8,000  | 138,880.00 | 0.11 |
| 213 | 605577 | 龙版传媒  | 9,500  | 138,035.00 | 0.11 |
| 214 | 688007 | 光峰科技  | 9,300  | 137,547.00 | 0.11 |
| 215 | 300170 | 汉得信息  | 10,900 | 135,160.00 | 0.11 |
| 216 | 688123 | 聚辰股份  | 2,300  | 134,596.00 | 0.11 |
| 217 | 300215 | 电科院   | 22,500 | 133,425.00 | 0.11 |
| 218 | 600618 | 氯碱化工  | 13,500 | 133,110.00 | 0.11 |
| 219 | 000166 | 申万宏源  | 24,500 | 131,075.00 | 0.11 |
| 220 | 300827 | 上能电气  | 2,900  | 127,310.00 | 0.10 |
| 221 | 603739 | 蔚蓝生物  | 10,600 | 127,094.00 | 0.10 |
| 222 | 688389 | 普门科技  | 8,500  | 126,565.00 | 0.10 |
| 223 | 688523 | 航天环宇  | 6,300  | 126,000.00 | 0.10 |
| 224 | 002033 | 丽江股份  | 14,200 | 125,954.00 | 0.10 |
| 225 | 300917 | 特发服务  | 2,600  | 125,788.00 | 0.10 |
| 226 | 688515 | 裕太微   | 1,266  | 125,334.00 | 0.10 |
| 227 | 603501 | 韦尔股份  | 1,200  | 125,292.00 | 0.10 |
| 228 | 002565 | 顺灏股份  | 41,000 | 124,640.00 | 0.10 |
| 229 | 000913 | 钱江摩托  | 6,900  | 124,269.00 | 0.10 |
| 230 | 688502 | 茂莱光学  | 600    | 120,840.00 | 0.10 |
| 231 | 002984 | 森麒麟   | 4,900  | 120,834.00 | 0.10 |
| 232 | 000017 | 深中华 A | 20,600 | 119,480.00 | 0.10 |
| 233 | 002913 | 奥士康   | 4,900  | 118,139.00 | 0.10 |
| 234 | 600169 | 太原重工  | 47,300 | 117,777.00 | 0.10 |
| 235 | 603386 | 骏亚科技  | 10,500 | 116,760.00 | 0.10 |
| 236 | 600675 | 中华企业  | 41,300 | 116,053.00 | 0.09 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 237 | 688432 | 有研硅  | 10,251 | 115,836.30 | 0.09 |
| 238 | 300890 | 翔丰华  | 3,800  | 114,988.00 | 0.09 |
| 239 | 301078 | 孩子王  | 10,000 | 113,800.00 | 0.09 |
| 240 | 688019 | 安集科技 | 800    | 111,488.00 | 0.09 |
| 241 | 600744 | 华银电力 | 35,800 | 111,338.00 | 0.09 |
| 242 | 300026 | 红日药业 | 29,000 | 109,910.00 | 0.09 |
| 243 | 000727 | 冠捷科技 | 39,200 | 108,976.00 | 0.09 |
| 244 | 002097 | 山河智能 | 14,500 | 108,750.00 | 0.09 |
| 245 | 600114 | 东睦股份 | 6,700  | 108,339.00 | 0.09 |
| 246 | 000049 | 德赛电池 | 4,600  | 108,146.00 | 0.09 |
| 247 | 600602 | 云赛智联 | 6,700  | 105,994.00 | 0.09 |
| 248 | 002536 | 飞龙股份 | 9,100  | 105,378.00 | 0.09 |
| 249 | 688070 | 纵横股份 | 2,900  | 102,370.00 | 0.08 |
| 250 | 601200 | 上海环境 | 12,400 | 101,308.00 | 0.08 |
| 251 | 300978 | 东箭科技 | 9,300  | 101,277.00 | 0.08 |
| 252 | 000062 | 深圳华强 | 4,500  | 100,800.00 | 0.08 |
| 253 | 300781 | 因赛集团 | 1,700  | 100,351.00 | 0.08 |
| 254 | 000559 | 万向钱潮 | 16,300 | 100,245.00 | 0.08 |
| 255 | 600757 | 长江传媒 | 10,400 | 99,528.00  | 0.08 |
| 256 | 600592 | 龙溪股份 | 9,700  | 95,836.00  | 0.08 |
| 257 | 002545 | 东方铁塔 | 13,600 | 95,608.00  | 0.08 |
| 258 | 688312 | 燕麦科技 | 3,100  | 95,480.00  | 0.08 |
| 259 | 603933 | 睿能科技 | 6,100  | 94,794.00  | 0.08 |
| 260 | 600269 | 赣粤高速 | 16,700 | 93,687.00  | 0.08 |
| 261 | 300031 | 宝通科技 | 5,100  | 93,432.00  | 0.08 |
| 262 | 300747 | 锐科激光 | 4,800  | 91,968.00  | 0.08 |
| 263 | 002459 | 晶澳科技 | 6,600  | 90,750.00  | 0.07 |
| 264 | 301036 | 双乐股份 | 2,300  | 90,160.00  | 0.07 |
| 265 | 002376 | 新北洋  | 13,800 | 89,976.00  | 0.07 |
| 266 | 600021 | 上海电力 | 9,800  | 89,866.00  | 0.07 |
| 267 | 000680 | 山推股份 | 9,100  | 88,270.00  | 0.07 |
| 268 | 600727 | 鲁北化工 | 11,800 | 87,438.00  | 0.07 |
| 269 | 600850 | 电科数字 | 3,600  | 86,040.00  | 0.07 |
| 270 | 301121 | 紫建电子 | 1,600  | 84,896.00  | 0.07 |
| 271 | 605299 | 舒华体育 | 10,700 | 84,423.00  | 0.07 |
| 272 | 300682 | 朗新集团 | 6,900  | 84,180.00  | 0.07 |
| 273 | 600941 | 中国移动 | 700    | 82,712.00  | 0.07 |
| 274 | 603236 | 移远通信 | 1,200  | 82,128.00  | 0.07 |
| 275 | 301029 | 怡合达  | 3,300  | 81,576.00  | 0.07 |
| 276 | 300725 | 药石科技 | 2,400  | 80,640.00  | 0.07 |
| 277 | 601608 | 中信重工 | 19,200 | 80,640.00  | 0.07 |
| 278 | 600063 | 皖维高新 | 19,900 | 79,600.00  | 0.07 |
| 279 | 003012 | 东鹏控股 | 12,000 | 79,320.00  | 0.06 |

|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 280 | 000539 | 粤电力 A | 17,300 | 78,369.00 | 0.06 |
| 281 | 301311 | 昆船智能  | 4,300  | 77,787.00 | 0.06 |
| 282 | 600509 | 天富能源  | 12,000 | 77,640.00 | 0.06 |
| 283 | 603612 | 索通发展  | 5,700  | 77,007.00 | 0.06 |
| 284 | 601126 | 四方股份  | 4,400  | 74,624.00 | 0.06 |
| 285 | 600266 | 城建发展  | 14,600 | 74,460.00 | 0.06 |
| 286 | 600875 | 东方电气  | 4,600  | 73,094.00 | 0.06 |
| 287 | 002258 | 利尔化学  | 8,700  | 71,949.00 | 0.06 |
| 288 | 002385 | 大北农   | 16,500 | 71,445.00 | 0.06 |
| 289 | 603383 | 顶点软件  | 1,900  | 71,250.00 | 0.06 |
| 290 | 002293 | 罗莱生活  | 9,100  | 70,980.00 | 0.06 |
| 291 | 688146 | 中船特气  | 2,400  | 69,696.00 | 0.06 |
| 292 | 600399 | 抚顺特钢  | 12,000 | 69,600.00 | 0.06 |
| 293 | 300502 | 新易盛   | 600    | 69,348.00 | 0.06 |
| 294 | 300241 | 瑞丰光电  | 12,600 | 69,174.00 | 0.06 |
| 295 | 301307 | 美利信   | 3,400  | 69,122.00 | 0.06 |
| 296 | 601326 | 秦港股份  | 20,600 | 69,010.00 | 0.06 |
| 297 | 002367 | 康力电梯  | 10,000 | 68,700.00 | 0.06 |
| 298 | 601860 | 紫金银行  | 23,900 | 68,115.00 | 0.06 |
| 299 | 300722 | 新余国科  | 2,500  | 67,550.00 | 0.06 |
| 300 | 688588 | 凌志软件  | 4,800  | 66,240.00 | 0.05 |
| 301 | 300049 | 福瑞股份  | 2,100  | 66,234.00 | 0.05 |
| 302 | 600422 | 昆药集团  | 4,000  | 63,400.00 | 0.05 |
| 303 | 002096 | 易普力   | 5,300  | 62,964.00 | 0.05 |
| 304 | 300968 | 格林精密  | 3,800  | 62,624.00 | 0.05 |
| 305 | 600186 | 莲花控股  | 10,800 | 61,560.00 | 0.05 |
| 306 | 002539 | 云图控股  | 7,800  | 60,996.00 | 0.05 |
| 307 | 688403 | 汇成股份  | 6,800  | 60,928.00 | 0.05 |
| 308 | 688766 | 普冉股份  | 600    | 60,756.00 | 0.05 |
| 309 | 002468 | 申通快递  | 5,900  | 59,767.00 | 0.05 |
| 310 | 002912 | 中新赛克  | 2,300  | 58,857.00 | 0.05 |
| 311 | 603823 | 百合花   | 6,300  | 58,590.00 | 0.05 |
| 312 | 000948 | 南天信息  | 3,500  | 58,555.00 | 0.05 |
| 313 | 002245 | 蔚蓝锂芯  | 5,400  | 57,726.00 | 0.05 |
| 314 | 600665 | 天地源   | 18,400 | 57,592.00 | 0.05 |
| 315 | 600330 | 天通股份  | 8,100  | 57,510.00 | 0.05 |
| 316 | 600887 | 伊利股份  | 1,900  | 57,342.00 | 0.05 |
| 317 | 600641 | 万业企业  | 3,900  | 57,018.00 | 0.05 |
| 318 | 000917 | 电广传媒  | 8,000  | 56,560.00 | 0.05 |
| 319 | 301171 | 易点天下  | 2,000  | 56,380.00 | 0.05 |
| 320 | 300014 | 亿纬锂能  | 1,200  | 56,088.00 | 0.05 |
| 321 | 600335 | 国机汽车  | 9,000  | 56,070.00 | 0.05 |
| 322 | 601106 | 中国一重  | 19,200 | 55,872.00 | 0.05 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 323 | 600742 | 一汽富维 | 6,300  | 55,755.00 | 0.05 |
| 324 | 300200 | 高盟新材 | 6,700  | 55,476.00 | 0.05 |
| 325 | 688010 | 福光股份 | 1,937  | 55,204.50 | 0.05 |
| 326 | 300134 | 大富科技 | 4,700  | 55,131.00 | 0.05 |
| 327 | 002222 | 福晶科技 | 1,700  | 55,080.00 | 0.05 |
| 328 | 002734 | 利民股份 | 6,900  | 54,993.00 | 0.05 |
| 329 | 301500 | 飞南资源 | 3,000  | 54,000.00 | 0.04 |
| 330 | 301327 | 华宝新能 | 700    | 53,697.00 | 0.04 |
| 331 | 300341 | 麦克奥迪 | 3,000  | 52,530.00 | 0.04 |
| 332 | 002469 | 三维化学 | 6,900  | 50,370.00 | 0.04 |
| 333 | 605296 | 神农集团 | 1,800  | 49,860.00 | 0.04 |
| 334 | 002284 | 亚太股份 | 6,400  | 49,536.00 | 0.04 |
| 335 | 300160 | 秀强股份 | 9,000  | 48,960.00 | 0.04 |
| 336 | 002613 | 北玻股份 | 12,100 | 48,884.00 | 0.04 |
| 337 | 002837 | 英维克  | 1,200  | 48,480.00 | 0.04 |
| 338 | 002608 | 江苏国信 | 6,300  | 48,321.00 | 0.04 |
| 339 | 301626 | 苏州天脉 | 730    | 48,019.40 | 0.04 |
| 340 | 000737 | 北方铜业 | 6,100  | 47,580.00 | 0.04 |
| 341 | 002003 | 伟星股份 | 3,300  | 46,761.00 | 0.04 |
| 342 | 000895 | 双汇发展 | 1,800  | 46,728.00 | 0.04 |
| 343 | 600098 | 广州发展 | 7,000  | 44,940.00 | 0.04 |
| 344 | 603327 | 福蓉科技 | 3,600  | 43,704.00 | 0.04 |
| 345 | 688720 | 艾森股份 | 1,100  | 43,516.00 | 0.04 |
| 346 | 300821 | 东岳硅材 | 5,600  | 43,456.00 | 0.04 |
| 347 | 688549 | 中巨芯  | 5,100  | 43,452.00 | 0.04 |
| 348 | 301039 | 中集车辆 | 4,800  | 43,440.00 | 0.04 |
| 349 | 688185 | 康希诺  | 700    | 42,735.00 | 0.03 |
| 350 | 300445 | 康斯特  | 2,600  | 42,302.00 | 0.03 |
| 351 | 300738 | 奥飞数据 | 2,900  | 42,050.00 | 0.03 |
| 352 | 002250 | 联化科技 | 7,600  | 41,876.00 | 0.03 |
| 353 | 301031 | 中熔电气 | 400    | 41,608.00 | 0.03 |
| 354 | 688352 | 硕中科技 | 3,400  | 41,242.00 | 0.03 |
| 355 | 002967 | 广电计量 | 2,500  | 41,000.00 | 0.03 |
| 356 | 600795 | 国电电力 | 8,700  | 39,846.00 | 0.03 |
| 357 | 603087 | 甘李药业 | 900    | 39,690.00 | 0.03 |
| 358 | 603266 | 天龙股份 | 2,400  | 38,640.00 | 0.03 |
| 359 | 002471 | 中超控股 | 13,800 | 37,674.00 | 0.03 |
| 360 | 600386 | 北巴传媒 | 8,300  | 37,101.00 | 0.03 |
| 361 | 688141 | 杰华特  | 1,192  | 36,487.12 | 0.03 |
| 362 | 000977 | 浪潮信息 | 700    | 36,316.00 | 0.03 |
| 363 | 300690 | 双一科技 | 1,600  | 36,176.00 | 0.03 |
| 364 | 688110 | 东芯股份 | 1,400  | 34,860.00 | 0.03 |
| 365 | 002060 | 广东建工 | 9,500  | 34,770.00 | 0.03 |



|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 366 | 300638 | 广和通  | 1,700 | 34,255.00 | 0.03 |
| 367 | 301611 | 珂玛科技 | 608   | 34,108.80 | 0.03 |
| 368 | 002866 | 传艺科技 | 2,100 | 33,978.00 | 0.03 |
| 369 | 600639 | 浦东金桥 | 3,000 | 33,300.00 | 0.03 |
| 370 | 002556 | 辉隆股份 | 5,800 | 32,306.00 | 0.03 |
| 371 | 002091 | 江苏国泰 | 4,400 | 32,208.00 | 0.03 |
| 372 | 688079 | 美迪凯  | 3,700 | 32,042.00 | 0.03 |
| 373 | 601600 | 中国铝业 | 4,200 | 30,870.00 | 0.03 |
| 374 | 002703 | 浙江世宝 | 2,600 | 29,562.00 | 0.02 |
| 375 | 601919 | 中远海控 | 1,900 | 29,450.00 | 0.02 |
| 376 | 002458 | 益生股份 | 3,000 | 28,830.00 | 0.02 |
| 377 | 002228 | 合兴包装 | 9,600 | 28,800.00 | 0.02 |
| 378 | 601899 | 紫金矿业 | 1,900 | 28,728.00 | 0.02 |
| 379 | 300788 | 中信出版 | 900   | 28,413.00 | 0.02 |
| 380 | 605599 | 菜百股份 | 2,500 | 28,375.00 | 0.02 |
| 381 | 300777 | 中简科技 | 1,000 | 28,290.00 | 0.02 |
| 382 | 301551 | 无线传媒 | 652   | 28,185.96 | 0.02 |
| 383 | 601886 | 江河集团 | 5,200 | 28,080.00 | 0.02 |
| 384 | 601002 | 晋亿实业 | 6,400 | 27,840.00 | 0.02 |
| 385 | 300533 | 冰川网络 | 1,400 | 27,664.00 | 0.02 |
| 386 | 000736 | 中交地产 | 3,200 | 27,520.00 | 0.02 |
| 387 | 601169 | 北京银行 | 4,200 | 25,830.00 | 0.02 |
| 388 | 600449 | 宁夏建材 | 1,700 | 25,534.00 | 0.02 |
| 389 | 000829 | 天音控股 | 1,900 | 25,042.00 | 0.02 |
| 390 | 601500 | 通用股份 | 4,400 | 23,452.00 | 0.02 |
| 391 | 688322 | 奥比中光 | 500   | 23,250.00 | 0.02 |
| 392 | 603619 | 中曼石油 | 1,200 | 23,232.00 | 0.02 |
| 393 | 002859 | 洁美科技 | 1,100 | 22,825.00 | 0.02 |
| 394 | 000726 | 鲁泰 A | 3,500 | 22,820.00 | 0.02 |
| 395 | 688469 | 芯联集成 | 4,100 | 21,033.00 | 0.02 |
| 396 | 300627 | 华测导航 | 500   | 20,900.00 | 0.02 |
| 397 | 600729 | 重庆百货 | 700   | 20,475.00 | 0.02 |
| 398 | 001208 | 华菱线缆 | 2,200 | 19,976.00 | 0.02 |
| 399 | 601890 | 亚星锚链 | 2,500 | 19,475.00 | 0.02 |
| 400 | 688981 | 中芯国际 | 200   | 18,924.00 | 0.02 |
| 401 | 688726 | 拉普拉斯 | 565   | 18,678.90 | 0.02 |
| 402 | 300002 | 神州泰岳 | 1,600 | 18,544.00 | 0.02 |
| 403 | 600459 | 贵研铂业 | 1,300 | 17,849.00 | 0.01 |
| 404 | 002803 | 吉宏股份 | 1,400 | 17,752.00 | 0.01 |
| 405 | 600938 | 中国海油 | 600   | 17,706.00 | 0.01 |
| 406 | 600094 | 大名城  | 4,800 | 17,472.00 | 0.01 |
| 407 | 688315 | 诺禾致源 | 1,345 | 16,812.50 | 0.01 |
| 408 | 300507 | 苏奥传感 | 2,500 | 16,750.00 | 0.01 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 409 | 600550 | 保变电气 | 2,100 | 16,485.00 | 0.01 |
| 410 | 000001 | 平安银行 | 1,400 | 16,380.00 | 0.01 |
| 411 | 002597 | 金禾实业 | 700   | 15,981.00 | 0.01 |
| 412 | 603323 | 苏农银行 | 3,000 | 15,870.00 | 0.01 |
| 413 | 688615 | 合合信息 | 95    | 15,749.10 | 0.01 |
| 414 | 688591 | 泰凌微  | 500   | 15,700.00 | 0.01 |
| 415 | 300741 | 华宝股份 | 900   | 15,651.00 | 0.01 |
| 416 | 600458 | 时代新材 | 1,200 | 15,372.00 | 0.01 |
| 417 | 001216 | 华瓷股份 | 1,200 | 15,300.00 | 0.01 |
| 418 | 600558 | 大西洋  | 3,700 | 15,059.00 | 0.01 |
| 419 | 301522 | 上大股份 | 590   | 14,655.60 | 0.01 |
| 420 | 688183 | 生益电子 | 367   | 14,408.42 | 0.01 |
| 421 | 300505 | 川金诺  | 1,000 | 14,400.00 | 0.01 |
| 422 | 002406 | 远东传动 | 2,200 | 14,190.00 | 0.01 |
| 423 | 002957 | 科瑞技术 | 900   | 14,121.00 | 0.01 |
| 424 | 300531 | 优博讯  | 1,000 | 13,950.00 | 0.01 |
| 425 | 603288 | 海天味业 | 300   | 13,770.00 | 0.01 |
| 426 | 603025 | 大豪科技 | 900   | 13,725.00 | 0.01 |
| 427 | 300373 | 扬杰科技 | 300   | 13,056.00 | 0.01 |
| 428 | 300054 | 鼎龙股份 | 500   | 13,010.00 | 0.01 |
| 429 | 301016 | 雷尔伟  | 600   | 12,576.00 | 0.01 |
| 430 | 300409 | 道氏技术 | 900   | 12,249.00 | 0.01 |
| 431 | 301586 | 佳力奇  | 215   | 11,425.10 | 0.01 |
| 432 | 301606 | 绿联科技 | 300   | 11,340.00 | 0.01 |
| 433 | 603408 | 建霖家居 | 900   | 11,277.00 | 0.01 |
| 434 | 300236 | 上海新阳 | 300   | 11,211.00 | 0.01 |
| 435 | 688468 | 科美诊断 | 1,600 | 10,960.00 | 0.01 |
| 436 | 603927 | 中科软  | 500   | 10,850.00 | 0.01 |
| 437 | 600651 | 飞乐音响 | 2,500 | 10,350.00 | 0.01 |
| 438 | 600572 | 康恩贝  | 2,200 | 10,252.00 | 0.01 |
| 439 | 600783 | 鲁信创投 | 800   | 10,136.00 | 0.01 |
| 440 | 002823 | 凯中精密 | 700   | 9,919.00  | 0.01 |
| 441 | 300620 | 光库科技 | 200   | 9,720.00  | 0.01 |
| 442 | 688590 | 新致软件 | 600   | 9,618.00  | 0.01 |
| 443 | 603098 | 森特股份 | 1,000 | 9,600.00  | 0.01 |
| 444 | 600282 | 南钢股份 | 2,000 | 9,380.00  | 0.01 |
| 445 | 000965 | 天保基建 | 3,100 | 9,300.00  | 0.01 |
| 446 | 300433 | 蓝思科技 | 400   | 8,760.00  | 0.01 |
| 447 | 688710 | 益诺思  | 259   | 8,697.22  | 0.01 |
| 448 | 601555 | 东吴证券 | 1,100 | 8,580.00  | 0.01 |
| 449 | 000019 | 深粮控股 | 1,300 | 8,541.00  | 0.01 |
| 450 | 600986 | 浙文互联 | 1,400 | 8,372.00  | 0.01 |
| 451 | 002345 | 潮宏基  | 1,400 | 8,134.00  | 0.01 |

|     |        |      |       |          |      |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 452 | 600273 | 嘉化能源 | 1,000 | 7,970.00 | 0.01 |
| 453 | 002241 | 歌尔股份 | 300   | 7,743.00 | 0.01 |
| 454 | 300628 | 亿联网络 | 200   | 7,720.00 | 0.01 |
| 455 | 600999 | 招商证券 | 400   | 7,664.00 | 0.01 |
| 456 | 001270 | 铖昌科技 | 200   | 7,620.00 | 0.01 |
| 457 | 601618 | 中国中冶 | 2,300 | 7,590.00 | 0.01 |
| 458 | 600805 | 悦达投资 | 1,700 | 7,531.00 | 0.01 |
| 459 | 600728 | 佳都科技 | 1,600 | 7,488.00 | 0.01 |
| 460 | 001279 | 强邦新材 | 265   | 7,396.15 | 0.01 |
| 461 | 000009 | 中国宝安 | 800   | 7,320.00 | 0.01 |
| 462 | 688484 | 南芯科技 | 200   | 7,208.00 | 0.01 |
| 463 | 300369 | 绿盟科技 | 1,000 | 7,190.00 | 0.01 |
| 464 | 002375 | 亚厦股份 | 1,850 | 7,141.00 | 0.01 |
| 465 | 301613 | 新铝时代 | 169   | 7,059.13 | 0.01 |
| 466 | 301608 | 博实结  | 107   | 6,995.66 | 0.01 |
| 467 | 002461 | 珠江啤酒 | 700   | 6,923.00 | 0.01 |
| 468 | 000672 | 上峰水泥 | 900   | 6,885.00 | 0.01 |
| 469 | 301622 | 英思特  | 152   | 6,827.84 | 0.01 |
| 470 | 002073 | 软控股份 | 800   | 6,608.00 | 0.01 |
| 471 | 300947 | 德必集团 | 400   | 6,348.00 | 0.01 |
| 472 | 600023 | 浙能电力 | 1,100 | 6,226.00 | 0.01 |
| 473 | 002081 | 金螳螂  | 1,700 | 6,069.00 | 0.00 |
| 474 | 301301 | 川宁生物 | 500   | 5,930.00 | 0.00 |
| 475 | 300691 | 联合光电 | 300   | 5,916.00 | 0.00 |
| 476 | 600835 | 上海机电 | 300   | 5,376.00 | 0.00 |
| 477 | 300406 | 九强生物 | 400   | 5,344.00 | 0.00 |
| 478 | 603439 | 贵州三力 | 400   | 5,200.00 | 0.00 |
| 479 | 301631 | 壹连科技 | 51    | 5,199.96 | 0.00 |
| 480 | 002063 | 远光软件 | 900   | 5,184.00 | 0.00 |
| 481 | 002777 | 久远银海 | 300   | 5,166.00 | 0.00 |
| 482 | 301585 | 蓝宇股份 | 144   | 5,162.40 | 0.00 |
| 483 | 603713 | 密尔克卫 | 100   | 5,120.00 | 0.00 |
| 484 | 000928 | 中钢国际 | 800   | 5,096.00 | 0.00 |
| 485 | 601975 | 招商南油 | 1,600 | 5,008.00 | 0.00 |
| 486 | 601007 | 金陵饭店 | 700   | 4,907.00 | 0.00 |
| 487 | 603207 | 小方制药 | 184   | 4,903.60 | 0.00 |
| 488 | 688306 | 均普智能 | 600   | 4,650.00 | 0.00 |
| 489 | 301617 | 博苑股份 | 113   | 4,496.27 | 0.00 |
| 490 | 603596 | 伯特利  | 100   | 4,459.00 | 0.00 |
| 491 | 605011 | 杭州热电 | 200   | 4,284.00 | 0.00 |
| 492 | 300099 | 尤洛卡  | 700   | 4,200.00 | 0.00 |
| 493 | 601311 | 骆驼股份 | 500   | 4,145.00 | 0.00 |
| 494 | 002010 | 传化智联 | 900   | 4,077.00 | 0.00 |

|     |        |      |       |          |      |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 495 | 605009 | 豪悦护理 | 100   | 3,996.00 | 0.00 |
| 496 | 601188 | 龙江交通 | 1,100 | 3,960.00 | 0.00 |
| 497 | 000035 | 中国天楹 | 800   | 3,896.00 | 0.00 |
| 498 | 002126 | 银轮股份 | 200   | 3,744.00 | 0.00 |
| 499 | 300121 | 阳谷华泰 | 300   | 3,627.00 | 0.00 |
| 500 | 603350 | 安乃达  | 100   | 3,617.00 | 0.00 |
| 501 | 601688 | 华泰证券 | 200   | 3,518.00 | 0.00 |
| 502 | 000700 | 模塑科技 | 500   | 3,510.00 | 0.00 |
| 503 | 603205 | 健尔康  | 128   | 3,500.80 | 0.00 |
| 504 | 601528 | 瑞丰银行 | 600   | 3,378.00 | 0.00 |
| 505 | 603091 | 众鑫股份 | 76    | 3,376.68 | 0.00 |
| 506 | 600821 | 金开新能 | 600   | 3,240.00 | 0.00 |
| 507 | 300729 | 乐歌股份 | 200   | 3,176.00 | 0.00 |
| 508 | 601818 | 光大银行 | 800   | 3,096.00 | 0.00 |
| 509 | 002901 | 大博医疗 | 100   | 3,084.00 | 0.00 |
| 510 | 603013 | 亚普股份 | 200   | 2,996.00 | 0.00 |
| 511 | 002519 | 银河电子 | 500   | 2,970.00 | 0.00 |
| 512 | 688238 | 和元生物 | 600   | 2,964.00 | 0.00 |
| 513 | 603799 | 华友钴业 | 100   | 2,926.00 | 0.00 |
| 514 | 000921 | 海信家电 | 100   | 2,890.00 | 0.00 |
| 515 | 301090 | 华润材料 | 400   | 2,776.00 | 0.00 |
| 516 | 002895 | 川恒股份 | 100   | 2,460.00 | 0.00 |
| 517 | 605589 | 圣泉集团 | 100   | 2,358.00 | 0.00 |
| 518 | 300685 | 艾德生物 | 100   | 2,280.00 | 0.00 |
| 519 | 600495 | 晋西车轴 | 600   | 2,280.00 | 0.00 |
| 520 | 002194 | 武汉凡谷 | 200   | 2,244.00 | 0.00 |
| 521 | 300482 | 万孚生物 | 100   | 2,241.00 | 0.00 |
| 522 | 300812 | 易天股份 | 100   | 2,204.00 | 0.00 |
| 523 | 600141 | 兴发集团 | 100   | 2,170.00 | 0.00 |
| 524 | 603100 | 川仪股份 | 100   | 2,155.00 | 0.00 |
| 525 | 605507 | 国邦医药 | 100   | 2,083.00 | 0.00 |
| 526 | 002332 | 仙琚制药 | 200   | 1,988.00 | 0.00 |
| 527 | 600645 | 中源协和 | 100   | 1,930.00 | 0.00 |
| 528 | 688208 | 道通科技 | 47    | 1,840.52 | 0.00 |
| 529 | 000690 | 宝新能源 | 400   | 1,792.00 | 0.00 |
| 530 | 002833 | 弘亚数控 | 100   | 1,683.00 | 0.00 |
| 531 | 603310 | 巍华新材 | 93    | 1,669.35 | 0.00 |
| 532 | 300525 | 博思软件 | 100   | 1,558.00 | 0.00 |
| 533 | 300514 | 友讯达  | 100   | 1,444.00 | 0.00 |
| 534 | 300869 | 康泰医学 | 100   | 1,394.00 | 0.00 |
| 535 | 002810 | 山东赫达 | 100   | 1,285.00 | 0.00 |
| 536 | 002043 | 兔宝宝  | 100   | 1,188.00 | 0.00 |
| 537 | 600125 | 铁龙物流 | 200   | 1,186.00 | 0.00 |

|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 538 | 603915 | 国茂股份 | 100 | 1,172.00 | 0.00 |
| 539 | 002948 | 青岛银行 | 300 | 1,164.00 | 0.00 |
| 540 | 002186 | 全聚德  | 100 | 1,160.00 | 0.00 |
| 541 | 600497 | 驰宏锌锗 | 200 | 1,114.00 | 0.00 |
| 542 | 002534 | 西子洁能 | 100 | 1,111.00 | 0.00 |
| 543 | 603588 | 高能环境 | 200 | 1,048.00 | 0.00 |
| 544 | 600352 | 浙江龙盛 | 100 | 1,029.00 | 0.00 |
| 545 | 000883 | 湖北能源 | 200 | 996.00   | 0.00 |
| 546 | 002100 | 天康生物 | 100 | 655.00   | 0.00 |
| 547 | 600583 | 海油工程 | 100 | 547.00   | 0.00 |
| 548 | 000875 | 吉电股份 | 100 | 526.00   | 0.00 |
| 549 | 688097 | 博众精工 | 17  | 446.25   | 0.00 |
| 550 | 002666 | 德联集团 | 100 | 436.00   | 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  | 688183 | 生益电子 | 8,404,695.67 | 3.51           |
| 2  | 002036 | 联创电子 | 6,563,927.00 | 2.74           |
| 3  | 688128 | 中国电研 | 6,405,350.79 | 2.67           |
| 4  | 603299 | 苏盐井神 | 6,169,947.00 | 2.57           |
| 5  | 000969 | 安泰科技 | 5,794,797.00 | 2.42           |
| 6  | 600602 | 云赛智联 | 5,639,510.00 | 2.35           |
| 7  | 600428 | 中远海特 | 5,635,428.00 | 2.35           |
| 8  | 300113 | 顺网科技 | 5,510,754.00 | 2.30           |
| 9  | 600216 | 浙江医药 | 5,415,026.00 | 2.26           |
| 10 | 000550 | 江铃汽车 | 5,339,096.00 | 2.23           |
| 11 | 300768 | 迪普科技 | 5,277,031.00 | 2.20           |
| 12 | 000600 | 建投能源 | 5,230,576.00 | 2.18           |
| 13 | 601068 | 中铝国际 | 5,215,522.00 | 2.18           |
| 14 | 600335 | 国机汽车 | 5,190,164.00 | 2.17           |
| 15 | 300463 | 迈克生物 | 5,172,797.00 | 2.16           |
| 16 | 688362 | 甬矽电子 | 5,134,740.10 | 2.14           |
| 17 | 600812 | 华北制药 | 5,129,705.00 | 2.14           |
| 18 | 002249 | 大洋电机 | 5,104,328.00 | 2.13           |
| 19 | 600776 | 东方通信 | 5,050,563.00 | 2.11           |
| 20 | 688088 | 虹软科技 | 4,974,094.99 | 2.08           |
| 21 | 000422 | 湖北宣化 | 4,883,144.00 | 2.04           |
| 22 | 002292 | 奥飞娱乐 | 4,862,547.05 | 2.03           |
| 23 | 002468 | 申通快递 | 4,822,716.00 | 2.01           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 24 | 603533 | 掌阅科技 | 4,807,925.00 | 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  | 688183 | 生益电子 | 9,101,647.24 | 3.80           |
| 2  | 600602 | 云赛智联 | 6,597,300.00 | 2.75           |
| 3  | 000969 | 安泰科技 | 6,240,328.00 | 2.60           |
| 4  | 300113 | 顺网科技 | 6,185,616.28 | 2.58           |
| 5  | 688128 | 中国电研 | 6,088,176.77 | 2.54           |
| 6  | 000550 | 江铃汽车 | 5,994,184.00 | 2.50           |
| 7  | 603299 | 苏盐井神 | 5,954,000.00 | 2.48           |
| 8  | 300768 | 迪普科技 | 5,834,842.50 | 2.43           |
| 9  | 002036 | 联创电子 | 5,690,968.00 | 2.37           |
| 10 | 603533 | 掌阅科技 | 5,634,574.00 | 2.35           |
| 11 | 300463 | 迈克生物 | 5,447,321.00 | 2.27           |
| 12 | 600776 | 东方通信 | 5,396,598.99 | 2.25           |
| 13 | 600216 | 浙江医药 | 5,391,774.00 | 2.25           |
| 14 | 000795 | 英洛华  | 5,369,813.00 | 2.24           |
| 15 | 000600 | 建投能源 | 5,313,023.00 | 2.22           |
| 16 | 600335 | 国机汽车 | 5,289,546.00 | 2.21           |
| 17 | 000422 | 湖北宜化 | 5,281,809.00 | 2.20           |
| 18 | 301301 | 川宁生物 | 5,237,156.00 | 2.19           |
| 19 | 603328 | 依顿电子 | 5,217,960.00 | 2.18           |
| 20 | 688362 | 甬矽电子 | 5,125,268.89 | 2.14           |
| 21 | 600812 | 华北制药 | 5,058,099.00 | 2.11           |
| 22 | 002946 | 新乳业  | 4,961,504.29 | 2.07           |
| 23 | 002468 | 申通快递 | 4,953,233.00 | 2.07           |
| 24 | 600409 | 三友化工 | 4,901,744.00 | 2.05           |
| 25 | 002292 | 奥飞娱乐 | 4,858,282.98 | 2.03           |
| 26 | 000555 | 神州信息 | 4,819,551.00 | 2.01           |
| 27 | 600428 | 中远海特 | 4,806,351.00 | 2.01           |
| 28 | 300319 | 麦捷科技 | 4,796,969.00 | 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 | 2,090,510,480.20 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,189,291,944.63 |

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

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

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

## 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 | 280,176.00 |
| 2  | 应收清算款 | -          |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 502,384.23 |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 782,560.23 |

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 | 809      | 93,777.2  | 13,553,396.6 | 17.86% | 62,312,374.2 | 82.14% |



|                      |       |           |               |        |               |        |
|----------------------|-------|-----------|---------------|--------|---------------|--------|
| 中证 1000 优选股票发起 A     |       | 2         | 2             |        | 5             |        |
| 国泰君安中证 1000 优选股票发起 C | 390   | 79,713.38 | 14,529,534.98 | 46.74% | 16,558,682.24 | 53.26% |
| 合计                   | 1,199 | 89,202.66 | 28,082,931.60 | 26.26% | 78,871,056.49 | 73.74% |

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）。

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 | 国泰君安中证 1000 优选股票发起 A | 381,756.02 | 0.5032%  |
|                  | 国泰君安中证 1000 优选股票发起 C | 10,118.60  | 0.0325%  |
|                  | 合计                   | 391,874.62 | 0.3664%  |

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）。

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 | 国泰君安中证 1000 优选股票发起 A | 0                 |
|                                | 国泰君安中证 1000 优选股票发起 C | 0                 |
|                                | 合计                   | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 国泰君安中证 1000 优选股票发起 A | 0                 |
|                                | 国泰君安中证               | 0                 |

|  |               |   |
|--|---------------|---|
|  | 1000 优选股票发起 C |   |
|  | 合计            | 0 |

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

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   | 10,009,450.45 | 9.36%        | 10,009,450.45 | 9.36%        | 自基金合同生效日起不少于3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -            | -             | -            | -              |
| 基金经理等人员     | -             | -            | -             | -            | -              |
| 基金管理人股东     | -             | -            | -             | -            | -              |
| 其他          | 391,874.62    | 0.37%        | -             | -            | -              |
| 合计          | 10,401,325.07 | 9.73%        | 10,009,450.45 | 9.36%        | -              |

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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                 | 国泰君安中证 1000 优选股票发起 A | 国泰君安中证 1000 优选股票发起 C |
|---------------------------------|----------------------|----------------------|
| 基金合同生效日（2023 年 12 月 12 日）基金份额总额 | 172,275,944.23       | 68,029,984.73        |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 172,275,944.23       | 68,029,984.73        |
| 本报告期基金总申购份额                     | 25,808,844.96        | 18,311,213.40        |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 122,219,018.32       | 55,252,980.91        |
| 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                    | 75,865,770.87        | 31,088,217.22        |

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

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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：

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》，由叶明同志代为履行首席信息官职责，朱晓力同志不再担任公司首席信息官职务，生效日期为 2024 年 2 月 26 日。

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》，陶耿同志兼任公司财务负责人，吕巍同志兼任公司首席风险官；叶明同志不再兼任财务负责人、首席风险官职务，生效日期为 2024 年 3 月 18 日。

2024 年 8 月 15 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》，吴楠同志和周诗宇同志不再担任公司副总裁职务，生效日期为 2024 年 8 月 13 日。

2024 年 9 月 7 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》，丁杰能同志担任公司副总裁职务，生效日期为 2024 年 9 月 5 日。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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于 2024-11-5 日改聘为其审计的会计师事务所。报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 30,000.00 元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为改聘日至今。

### 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

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。

11.6.2 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。

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      | 4,278,329,774.38 | 100.00%      | 313,686.96 | 100.00%    | —  |

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

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 |
| 2  | 国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回和定期定额投资业务的公告 | 上海证券报、证监会指定网站、公司官网                     | 2024-03-12 |
| 3  | 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 |
| 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  | 国泰君安中证 1000 优选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 |
| 6  | 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 |
| 7  | 国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要       | 证监会指定网站、公司官网                           | 2024-06-28 |

|    |   |  |            |
|----|---|--|------------|
| 8  | 国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要                       | 证监会指定网站、公司官网                           | 2024-06-28 |
| 9  | 国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金 2024 年第 2 季度报告                       | 证监会指定网站、公司官网                           | 2024-07-19 |
| 10 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年第 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                  | 2024-07-19 |
| 11 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告                                  | 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 | 2024-08-15 |
| 12 | 国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金 2024 年中期报告                           | 证监会指定网站、公司官网                           | 2024-08-30 |
| 13 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 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                  | 2024-08-30 |
| 14 | 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 | 2024-09-07 |
| 15 | 国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金 2024 年第 3 季度报告                       | 证监会指定网站、公司官网                           | 2024-10-25 |
| 16 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 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                  | 2024-10-25 |
| 17 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在国泰君安资管 APP 开通基金转换业务的公告                 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网     | 2024-10-31 |
| 18 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告                               | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所 | 2024-11-06 |
| 19 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下部分基金在国泰君安资管 APP 转换业务费用计算方法、转换业务适用范围和规则的公告 | 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     | 2024-11-07 |
| 20 | 国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料要更新                      | 证监会指定网站、公司官网                           | 2024-12-11 |
| 21 | 国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金（C 类                                  | 证监会指定网站、公司官网                           | 2024-12-11 |

|    |  |              |            |
|----|--|--------------|------------|
|    | 份额) 基金产品资料要更新                                    |              |            |
| 22 | 国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金招募说明书(更新)(2024 年第 1 号) | 证监会指定网站、公司官网 | 2024-12-11 |
| 23 | 在本报告期内刊登的其他公告                                    | -            | -          |

§ 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 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中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安中证 1000 优选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

二〇二五年三月三十一日