

国泰君安红利量化选股混合型证券投资基金

2024 年第 4 季度报告

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:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2025 年 01 月 22 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年01月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年10月30日起至2024年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰君安红利量化选股混合
基金主代码	021919
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年10月30日
报告期末基金份额总额	197,942,472.88份
投资目标	本基金主要投资于红利主题相关优质上市企业，以数量化投资方法为基础，在严格控制风险的前提下，力求实现长期超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将综合考虑宏观与微观经济、市场与政策等因素，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。在资产配置中，本基金主要考虑：（1）宏观经济因素，包括GDP增长率及其构成、CPI、市场利率水平变化、货币政策等；（2）微观经济因素，包括各行业主要企业的盈利变化情况及其盈利预期；（3）市场因素，包括股票及债券市场的涨跌、市场整体估值水平、大类资产的预期收益率水平及其历史比较、市场资金供求关系及其变化；（4）政策因素，与证券市场密切相关的各种政策出台对市场的影响等。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）主题界定</p> <p>本基金所界定的红利主题包括满足以下所有条件的上市公司：</p> <p>1）稳定的分红政策：过去2年内至少有1次分红（包括现金股</p>

	<p>利和股票股利)；</p> <p>2) 较高的分红回报：最近一年的股息率处于市场前 50%；</p> <p>3) 具有持续分红能力：公司财务质量健康、盈利能力稳定、分红能力强、分红意愿高、具有良好的行业长期竞争力。</p> <p>本基金不主动投资于 ST 及*ST 股票。</p> <p>未来随着政策、法律法规、行业规范或者行业准则等发生变化，红利主题相关上市公司可能会发生变动。基金管理人可在履行适当程序后，对上述主题界定的标准进行动态调整。</p> <p>(2) 量化选股策略</p> <p>本基金重点关注红利主题股票，并通过量化选股策略，尽量追求组合的收益最大化并有效控制回撤。量化选股策略主要通过机器学习模型和对股票因子特征的研究，致力于捕捉市场短期失效带来的盈利空间，在充分控制投资风险的前提下，在以下几个层面通过量化选股的投资策略进行投资，力求实现基金资产的长期、稳定增值。</p> <p>1) 投资逻辑层面：在策略维度上，同时注重基本面量化模型和实时价量模型，并将两者进行结合。一方面，选择基本面优质且被机构看好的公司，争取赚取长期持股的收益。另一方面，通过量价因子尽量刻画股票的技术面特征，以便更准确把握股票的买卖时间点。</p> <p>2) 模型层面：模型结合股票市场的高噪音和时序性的特征自主研发而成，致力于用多个子模型从不同的角度来刻画市场投资逻辑，并通过因子之间的优胜劣汰和风格轮动来捕捉市场的投资机会，提升模型对不同市场风格的普适性，尽量减少单个子模型的失效概率。</p> <p>3) Alpha 因子层面：团队维护的 Alpha 因子库覆盖股票的日频交易数据相关因子、股票定期报告衍生因子、分析师报告衍生因子、事件驱动合成因子、股票实时价量数据相关因子以及互联网和舆情数据因子等。</p> <p>4) 策略配置层面：模型采取将低频因子和价量因子在底层训练和子模型合成两个维度进行融合，而非在策略配置层面。该方式试图保留基本面因子的多头端表现和价量因子的空头端优势，在某些市场阶段可以形成策略互补的效果，使得策略更稳健。</p> <p>5) 行业配置层面：量化行业配置模型综合考虑行业的景气度、估值、资金流、价量和机构行为等视角，由多个相关性较低、具备显著超额收益能力的子模型，形成综合的行业配置信号，以此对部分行业进行适当的高配和低配。</p> <p>6) 组合管理层面：团队运作的 Alpha 量化策略通过自主研发的风险模型和组合优化模型得到日内实时的投资组合在多个不同时间段对持仓进行调仓。在投资组合优化的过程中主要严格控制的风险因子为规模因子、Beta 因子、流动性因子、波动率因子、动量因子、反转因子、估值和行业因子等，将主要市场风险因子以及行业因子相对于基准指数的暴露程度控制在一定范</p>
--	---

	围之内，动态调整投资组合。 本基金的投资策略还包括存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货交易策略、国债期货交易策略、股票期权投资策略、融资策略。	
业绩比较基准	中证红利指数收益率*80%+中债新综合全价(总值)指数收益率*20%	
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。	
基金管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国泰君安红利量化选股混合 A	国泰君安红利量化选股混合 C
下属分级基金的交易代码	021919	021920
报告期末下属分级基金的份额总额	128,122,051.77 份	69,820,421.11 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 10 月 30 日-2024 年 12 月 31 日）	
	国泰君安红利量化选股混合 A	国泰君安红利量化选股混合 C
1. 本期已实现收益	4,953,307.27	2,449,938.70
2. 本期利润	5,505,808.11	3,020,980.39
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0330	0.0292
4. 期末基金资产净值	131,524,432.99	71,625,233.83
5. 期末基金份额净值	1.0266	1.0258

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. 本基金于 2024 年 10 月 30 日成立，本报告期间为 2024 年 10 月 30 日至 2024 年 12 月 31 日。

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

国泰君安红利量化选股混合 A 净值表现

阶段	净值增长率 ①	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	①-③	②-④
----	------------	---------------	----------------	----------------	-----	-----

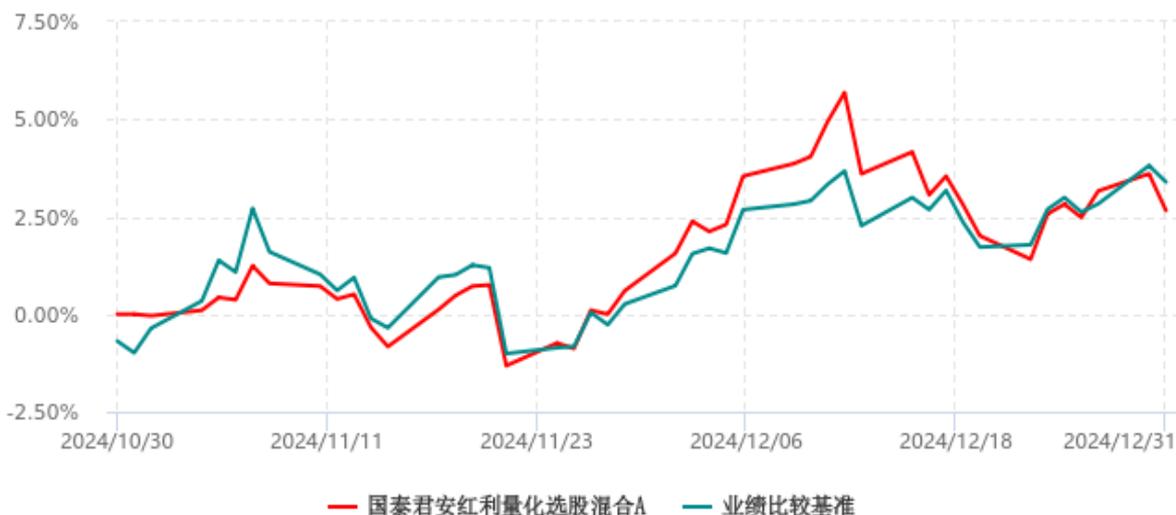
				准差④		
自基金合同生效起至今	2.66%	0.73%	3.39%	0.73%	-0.73%	0.00%

国泰君安红利量化选股混合 C 净值表现

阶段	净值增长率①	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
自基金合同生效起至今	2.58%	0.73%	3.39%	0.73%	-0.81%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

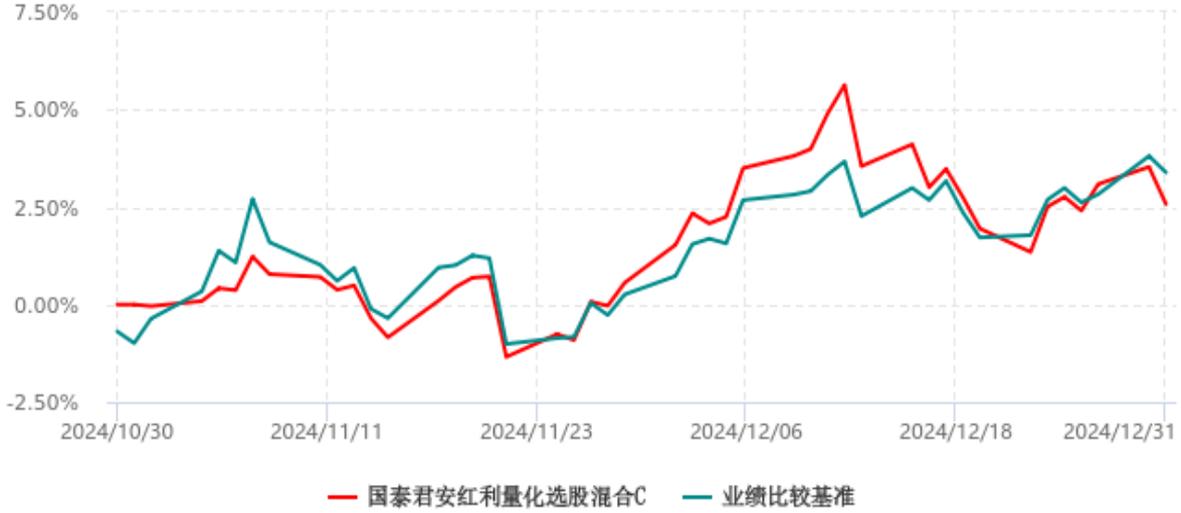
国泰君安红利量化选股混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024年10月30日-2024年12月31日)



注：1、本基金于 2024 年 10 月 30 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

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

国泰君安红利量化选股混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024年10月30日-2024年12月31日)



注：1、本基金于 2024 年 10 月 30 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。
2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，截止本报告期末基金成立未满六个月。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡崇海	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安科技创新精	2024-10-30	-	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，

	<p>选三个月持有期股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安红利量化选股混合型证券投资基金基金经理，国泰君安中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。</p>				<p>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。</p>
--	---	--	--	--	--

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 3 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

在市场方面，A 股四季度走出了先扬后抑的行情。“一行一局一会”的重磅利好在国庆期间不断发酵，市场情绪达到顶峰，致使指数在 10 月初大幅高开，但随后快速回落。随后习近平总书记在考察中强调要推进中国式现代化，叠加央行推出证券、基金、保险公司互换便利操作，并联合金融监管总局、中国证监会设立股票回购增持再贷款，快速提振了资本市场的信心，开启新一轮反弹。进入 11 月后，虽然利好不断，包括 11 月推出的 6+4+2 万亿化债方案、市值管理规定等，12 月的中央经济工作会议提出的“更加积极”的财政政策与“适度宽松”的货币政策，但受美国大选引发的外部不确定性影响，市场维持震荡走势，成交仍保持活跃，维持在每日 2 万亿附近的成交额。12 月中旬，受年底及海内外避险情绪影响，指数出现一定下跌，市场风格也从 9 月末以来的小微盘切换到大盘的防守型风格上。直至四季度末，中证红利指数表现一般（涨幅 12.31%），好于中证 500（涨幅 5.46%）和中证 1000（涨幅 1.20%），但弱于沪深 300（涨幅 14.68%）和上证 50（涨幅 15.42%）等大盘宽基指数。展望 2025 年，央行支持资本市场的货币工具有望进入实质性落地阶段，为市场带

来实质性的资金支持，进一步稳定了投资者和国际资本的信心。不过每一次市场中长期底部都不是一蹴而就的，在当前复杂的国际政治形势和尚未企稳的经济基本面的现实面前，短期出现较大波动依然是难免的。

本基金聚焦高分红股票，跟踪中证红利指数，其作为市场中稳健防御类指数的代表具备高分红、长期收益较为稳定、波动率较低的特点。本基金通过多维度的量化策略实现收益增强，策略所使用的量化模型包括但不限于 Alpha 模型、SmartBeta、行业轮动、事件驱动，力争在保持红利类风格的基础上，从选股、行业、风格等多个层面构建复合量化策略，以实现超越中证红利指数的收益。

从主要风险因子的走势来看，动量在第四季度整体表现强势但在季度末走弱，盈利和市值因子在季度末出现反转；大盘股在年末再度占优。四季度市场反复震荡波动，风格从前期的小微盘强势逐渐切换到“大盘占优、低估为盾、稳扎稳打”的防守型风格。从行业来看，第四季度商贸、计算机等行业延续了第三季度的强势，涨幅依然位居前列，防御性行业如石油石化、煤炭和公用事业等则相对滞涨。从风格角度来看，小微盘股在三季度末一揽子政策发布后一直维持上涨态势，直至 12 月中上旬出于海外等因素的影响，大盘价值重占上风。Alpha 表现方面，三季度末政策发布后，市场交投情绪快速改善、量价齐升，整体量价因子表现优于基本面因子；但由于四季度末散户、游资交投情绪的退潮，市场逐渐切换为防守姿态，基本面因子表现有所反弹。鉴于今年市场环境的复杂性，我们特别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。

以分散化投资为主的量化投资在今年大盘股引领的防御性行情下，阶段性面临一定的挑战。量化投资的逻辑自成体系，尽量不要受市场“宏大叙事”的印象，从投资理念和投资逻辑来讲保持自洽和一致。过去一段时间当中，市场的小盘股呈现出了较大的波动性，而红利类产品相比之下呈现出更高的性价比和更优的投资体验感。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，通过机器学习模型有针对性地有效选择因子，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，力求以较为稳定的方式增强中证红利指数。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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安红利量化选股混合 A 基金份额净值为 1.0266 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.66%，同期业绩比较基准收益率为 3.39%；截至报告期末国泰君安红利量化选股混合 C 基金份额净值为 1.0258 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.58%，同期业绩比较基准收益率为 3.39%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	189,926,661.82	92.06
	其中：股票	189,926,661.82	92.06
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	15,332,812.21	7.43
8	其他资产	1,040,806.29	0.50
9	合计	206,300,280.32	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%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	29,239,659.20	14.39
C	制造业	58,690,573.20	28.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,977,520.00	4.42
E	建筑业	3,429,349.80	1.69
F	批发和零售业	7,130,346.12	3.51
G	交通运输、仓储和邮政业	19,893,115.50	9.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,464,905.00	2.20
J	金融业	48,414,425.00	23.83
K	房地产业	3,069,595.00	1.51
L	租赁和商务服务业	3,759,630.00	1.85
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,294,133.00	0.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,563,410.00	0.77
S	综合	-	-
	合计	189,926,661.82	93.49

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601818	光大银行	1,443,100	5,584,797.00	2.75
2	601288	农业银行	1,043,000	5,569,620.00	2.74
3	601169	北京银行	888,300	5,463,045.00	2.69
4	600188	兖矿能源	377,360	5,347,191.20	2.63
5	600295	鄂尔多斯	540,100	5,271,376.00	2.59

6	601988	中国银行	951,100	5,240,561.00	2.58
7	000937	冀中能源	795,500	5,027,560.00	2.47
8	601857	中国石油	556,900	4,978,686.00	2.45
9	600282	南钢股份	1,051,000	4,929,190.00	2.43
10	600016	民生银行	1,126,100	4,650,793.00	2.29

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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中国光大银行股份有限公司，2024 年 5 月，因违规经营被国家金融监督管理总局罚款，其分支行 2024 年多次因违规，被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行罚款、警示等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国农业银行股份有限公司，2024 年其分支行多次违规，被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局、证监会分局罚款、警示等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国银行股份有限公司，2024 年 1 月因信息报送异常不及时整改被国家金融监督管理总局罚款，其分支行 2024 年多次因违规，被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局、证监会分局罚款、警示等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国民生银行股份有限公司，2024 年其分支行多次因违规被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行罚款、警示等。

本基金持有的前十名证券发行主体北京银行股份有限公司，2024 年 2 月因违规经营被国家金融监督管理总局罚款，其分支行 2024 年多次因违规，被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行罚款、警示等。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,040,806.29
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,040,806.29

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安红利量化选股混合 A	国泰君安红利量化选股混合 C
基金合同生效日（2024 年 10 月 30 日）基金份额总额	184,866,895.09	128,627,168.32
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	6,599,323.88	13,517,539.76
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	63,344,167.20	72,324,286.97
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	128,122,051.77	69,820,421.11

注：本基金合同生效日为 2024 年 10 月 30 日。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	国泰君安红利量化选股混合 A	国泰君安红利量化选股混合 C
基金合同生效日管理人持有的本基金份额	8,004,040.00	-
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	8,004,040.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	6.25	-

注：本报告期期末基金管理人持有的本基金份额占基金总份额比例，分类基金比例的分母采用基金分类份额计算。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予国泰君安红利量化选股混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国泰君安红利量化选股混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安红利量化选股混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安红利量化选股混合型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。

9.2 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>。

9.3 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

二〇二五年一月二十二日