

国泰海通科创板量化选股股票型发起式证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 09 月 30 日

基金管理人:上海国泰海通证券资产管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 10 月 27 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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年10月23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2026年07月01日起至2026年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰海通科创板量化选股股票发起
基金主代码	020698
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 04 月 16 日
报告期末基金份额总额	134,648,952.70 份
投资目标	本基金主要投资科创板上市企业，以数量化投资方法为基础，在严格控制风险的前提下，力求实现长期超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采用数量化投资策略建立投资模型，重点投资于科创板上市公司证券，在投资过程中严格遵守数量化投资纪律，将大类资产配置策略和个股优选策略相结合，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。 本基金其他主要投资策略包括：1、资产配置策略 2、量化选股策略 3、存托凭证投资策略 4、债券投资策略 5、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略 6、资产支持证券投资策略 7、股指期货交易策略 8、国债期货交易策略 9、股票期权投资策略 10、融资策略。
业绩比较基准	上证科创板 50 成份指数收益率*45%+上证科创板 100 指数收益率*45%+中债综合全价（总值）指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	上海国泰海通证券资产管理有限公司

基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国泰海通科创板量化选股股票发起 A	国泰海通科创板量化选股股票发起 C
下属分级基金的交易代码	020698	020699
报告期末下属分级基金的份额总额	48,903,748.67 份	85,745,204.03 份

注：2025 年 7 月 25 日，上海国泰君安证券资产管理有限公司变更名称为上海国泰海通证券资产管理有限公司。国泰海通科创板量化选股股票型发起式证券投资基金由国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金变更而来。国泰海通科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金合同生效日为 2025 年 9 月 29 日。

§ 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（2026 年 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日）	
	国泰海通科创板量化选股股票发起 A	国泰海通科创板量化选股股票发起 C
1. 本期已实现收益	-6,926,217.46	-11,362,481.73
2. 本期利润	-38,770,674.84	-57,394,460.58
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.7319	-0.6883
4. 期末基金资产净值	94,378,693.07	163,852,004.89
5. 期末基金份额净值	1.9299	1.9109

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。

3.2 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

国泰海通科创板量化选股股票发起 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 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-25.94%	2.99%	-25.37%	2.98%	-0.57%	0.01%
过去六个月	10.75%	2.69%	19.46%	2.72%	-8.71%	-0.03%
过去一年	6.74%	2.28%	9.65%	2.27%	-2.91%	0.01%
自基金合同	92.99%	2.16%	99.67%	2.17%	-6.68%	-0.01%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

国泰海通科创板量化选股股票发起 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
过去三个月	-26.02%	2.99%	-25.37%	2.98%	-0.65%	0.01%
过去六个月	10.53%	2.69%	19.46%	2.72%	-8.93%	-0.03%
过去一年	6.30%	2.28%	9.65%	2.27%	-3.35%	0.01%
自基金合同 生效起至今	91.09%	2.16%	99.67%	2.17%	-8.58%	-0.01%

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

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

(2024年04月16日-2026年09月30日)





§ 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		
刘晟	国泰海通中证1000 指数增强基金经理，国泰海通君得盈债券基金经理，国泰海通新锐量化选股混合基金经理，国泰海通中证全指指数增强基金经理，国泰海通科创板量化选股股票发起基金经理。现任量化投资部（公募）基金经理。	2026-09-23	—	5 年	刘晟，北京大学金融学硕士研究生。2021 年 7 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任权益与衍生品部量化研究员助理，量化投资部研究员助理、投资助理，现任量化投资部（公募）基金经理，主要从事领域 Alpha 因子和模型的研究工作。
邓雅琨	国泰海通中证	2026-09-23	—	5 年	邓雅琨，卡耐

	500 指数增强基金经理，国泰海通新锐量化选股混合基金经理，国泰海通中证全指指数增强基金经理，国泰海通稳债增利债券发起基金经理，国泰海通君得盛债券基金经理，国泰海通港股优势精选股票发起（QDII）基金经理，国泰海通中证港股通科技指数发起基金经理，国泰海通科创板量化选股股票发起基金经理。现任量化投资部（公募）基金经理。				基梅隆大学计算金融专业，硕士研究生。2021 年 3 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任权益与衍生品部量化研究员助理，量化投资部研究员助理、投资助理，现任量化投资部（公募）基金经理。
胡崇海	国泰海通中证 500 指数增强基金经理，国泰海通中证 1000 指数增强基金经理，国泰海通量化选股混合发起基金经理，国泰海通沪深 300 指数增强发起基金经理，国泰海通中证 1000 优选股票发起基金经理，国泰海通科创板量	2024-04-16	2026-09-23	15 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

	化选股股票发起基金经理，国泰海通红利量化选股混合基金经理，国泰海通中证 A500 指数增强基金经理，国泰海通上证科创板综合价格指数增强基金经理，国泰海通稳健泰裕债券发起基金经理，国泰海通中证全指指数增强基金经理，国泰海通创业板综指增强基金经理。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。				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。现任本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。

4.1.1 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 0 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，2026 年第三季度 A 股市场震荡调整，风格和结构显著分化。7 月，前期科技成长主线交易拥挤、杠杆资金降温，叠加海外科技产业预期分歧和地缘扰动，市场风险偏好回落，成长板块调整较为明显。与此同时，前期调整较多的红利资产迎来明显修复，低波高股息风格表现突出，市场风格较上半年出现明显切换。8 月，海外科技企业财报和算力需求验证带动电子、通信等方向反弹，主要宽基指数月度收涨。但反弹过程中市场成交热度继续回落，中报披露带来的盈利分化、海外利率预期变化和地缘风险反复，使反弹呈现较强的结构性特征。科技产业景气与股价表现出现背离，业绩和订单增长并未完全抵消前期估值及持仓集中的调整压力。去杠杆带来的卖压虽有所缓解，但资金再平衡仍在延续，制约了反弹的持续性。9 月，海外高利率环境对风险资产估值的约束进一步显现，美债收益率上行和美联储加息预期影响市场情绪；中旬伴随政策预期和外部沟通改善，市场有所修复，下旬则在海外利率压力和节前避险需求影响下再度回落。总体来看，三季度市场经历调整、反弹和再度回落，8 月反弹未能扭转季度跌势，主要宽基指数均录得较大跌幅。科创综指（跌幅 27.98%）弱于创业板综指（跌幅 21.18%）、中证 500 指数（跌幅 17.67%）、中证 1000 指数（跌幅 17.15%）和沪深 300 指数（跌幅 12.49%）。

从主要风险因子表现看，多数风险因子在三季度出现反转，其中动量因子失效严重，三季度累计收益为负。行业层面，三季度煤炭、石油石化、农林牧渔、银行涨幅居前，而前期涨幅巨大的 AI 算力、半导体等科技板块进入调整期，电子、通信、建筑材料、电力设备等行业出现显著回撤。以银行、煤炭为代表的高股息红利板块凭借稳定现金流表现出较强防御性，成为三季度少数表现稳健的领域。Alpha 表现方面，价量类因子整体优于基本面因子。

展望 2026 年四季度，随着稳增长政策逐步落地、上市公司三季报披露和前期交易压力释放，A 股市场有望迎来震荡修复的机会，结构性行情仍将是重要特征。科技创新和先进制造的中长期产业逻辑仍具支撑，后续更需关注订单和盈利兑现、估值与增长的匹配，避免单纯依赖风险偏好扩张。高股息、现金流稳健的价值资产仍具配置意义，消费、地产及相关产业链则需观察政策向实际需求的传导。总体上，市场风格有望进一步趋于均衡，在产业景气、盈利质量和估值之间保持平衡，仍是把握结构性机会的重要基础，同时需关注海外利率、地缘局势及政策落地节奏带来的波动。

本基金聚焦科技创新类公司，特别是科创板的上市公司，具有典型的成长投资风格，主要投资于成长潜力较大的战略新兴产业。以量化的方式，从各个数据维度对科技产业上市公司进行全覆盖，有效挖掘“专精特新”、“小而美”的科技创新企业，发挥量化选股及模型的优势，以期获取超越科创板主流指数的收益。同时，本基金参考中证科创信息、中证科创生物、中证科创芯片、中证科创高装、中证科创材料、中证科创新能和创业板综指等的行业分布，在半导体设备、高端装备、新材料、新能源、节能环保以及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业的科技创新企业上进行均衡配置，充分发挥量化投资分散化的优势，降低基金的整体波动。从中长期的角度看，科技板块依然具有较高的配置价值，原因有如下几点：1)、半导体设备、生物医药、新能源、高端装备等新兴产业，符合中国产业战略转型的方向，在“新质生产力”等产业红利和“科创板八条”等政策红利的双轮驱动下，硬科技属性持续强化，半导体设备、AI 算力、生物制造等领域的技术突破加速，为科技板块打开长期增长空间；2)、在中美科技博弈背景下，科技产业在自主可控的时代使命下发展壮大，俨然成为国内突破“卡脖子”技术的主力军，带领经济从“中国制造”到“中国创造”的产业升级；3)、以科创板为主的科技类相关公司的营收和利润增速显著高于 A 股整体表现，在半导体设备、AI 算力、创新药和智能汽车等赛道表现尤为亮眼，盈利增长动力强劲。本基金采取量化的方式开展科技创新型股票投资，其核心优势在于通过数据驱动的系统化框架，充分利用科技产业的高数据密度特性，通过系统化、纪律化的模型框架捕捉硬科技企业的成长特征，充分利用科技型股票高波动率的同时控制投资组合的整体风险，实现投资决策的标准化、实时化、纪律化和高效化，其底层投资框架采用管理人多年精心打造的量化投资体系，针对于科技类股票在子策略合成、多策略配置和投资组合管理等层面进行有针对性地改良。鉴于近些年市场环境的复杂性，我们更重视提升超额收益率的稳定性，在市场的演化过程中不断引入新的因子和改良原有的模型，并通过多策略配置的形式来强化模型对不同风格的适应能力，在保持稳中求胜的风格下追求更好的超额收益率。

科技板块作为 A 股新质生产力的标杆，有望在 AI 模型持续突破和中美大国博弈的时间点上得到资金的青睐，我们努力追求突出科技创新属性的选股策略从中长期角度形成 Alpha 和 Beta 的共振。需要强调的是，量化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，因此更需要投资者耐心持有，我们将努力通过科学的手段增强量化模型的超额收益能力，力争为投资者创造长期优质的投资体验，而对于高波动率的板块也建议投资者可以通过定投的方式来进一步优化持有体验。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰海通科创板量化选股股票发起 A 基金份额净值为 1.9299 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-25.94%，同期业绩比较基准收益率为-25.37%；截至报告期末国泰海通科

科创板量化选股股票发起 C 基金份额净值为 1.9109 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-26.02%，同期业绩比较基准收益率为-25.37%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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	230,837,179.11	89.18
	其中：股票	230,837,179.11	89.18
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	27,118,632.38	10.48
8	其他资产	878,195.23	0.34
9	合计	258,834,006.72	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	201,416.00	0.08

B	采矿业	1,942,659.75	0.75
C	制造业	182,649,169.36	70.73
D	电力、热力、燃气及 水生产和供应业	1,171,720.00	0.45
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	352,452.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮 政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信 息技术服务业	37,536,280.59	14.54
J	金融业	-	-
K	房地产业	84,078.00	0.03
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务 业	6,806,682.41	2.64
N	水利、环境和公共设 施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其 他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	92,721.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	230,837,179.11	89.39

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	688256	寒武纪	11,170	11,270,641.70	4.36
2	688041	海光信息	44,760	10,151,568.00	3.93
3	688981	中芯国际	61,508	6,888,280.92	2.67
4	688012	中微公司	21,150	6,737,332.50	2.61
5	688072	拓荆科技	6,173	3,950,720.00	1.53

6	688795	摩尔线程	9,975	3,929,551.50	1.52
7	688702	盛科通信	13,192	3,758,532.72	1.46
8	688802	沐曦股份	6,788	3,374,179.04	1.31
9	688008	澜起科技	16,364	3,310,600.84	1.28
10	688126	沪硅产业	141,192	3,301,068.96	1.28

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IC2610	IC2610	2	2,971,680.00	-76,320.00	-
IM2610	IM2610	1	1,459,880.00	-59,080.00	-
IM2612	IM2612	1	1,435,120.00	-43,160.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-178,560.00
股指期货投资本期收益（元）					-546,623.04
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-434,260.00

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。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约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约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	704,001.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	174,193.63
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	878,195.23

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

	国泰海通科创板量化选股股票 发起 A	国泰海通科创板量化选股股票 发起 C
报告期期初基金份额总额	58,159,910.23	82,664,410.04
报告期期间基金总申购份额	10,871,119.15	22,160,099.18
减：报告期期间基金总赎回份 额	20,127,280.71	19,079,305.19
报告期期间基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	48,903,748.67	85,745,204.03

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。

§ 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

	国泰海通科创板量化选股股票 发起 A	国泰海通科创板量化选股股票 发起 C
报告期期初管理人持有的本基 金份额	5,009,901.80	5,000,900.00
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基 金份额	5,009,901.80	5,000,900.00
报告期期末持有的本基金份额 占基金总份额比例（%）	10.24	5.83

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,010,801.80	7.43%	10,010,801.80	7.43%	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	611.71	0.00%	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	1,062,196.87	0.79%	—	—	—
合计	11,073,610.38	8.22%	10,010,801.80	7.43%	—

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260701 — 20260708 , 20260728 — 20260930	28,487,012.61	—	—	28,487,012.61	21.16%
产品特有风险							

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%, 则面临大额赎回的情况, 可能导致:

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对, 可能会产生基金仓位调整困难, 导致流动性风险; 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回, 基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回, 如果连续 2 个开放日以上(含本数) 发生巨额赎回, 基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请, 对剩余投资者的赎回办理造成影响;

(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要, 则可能使基金资产净值受到不利影响, 影响基金的投资运作和收益水平;

(3) 因基金净值精度计算问题, 或因赎回费收入归基金资产, 导致基金净值出现较大波动;

(4) 基金资产规模过小, 可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;

(5) 大额赎回导致基金资产规模过小, 不能满足存续的条件, 基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

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

10.2 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 <https://www.gthtzg.com>。

10.3 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。

上海国泰海通证券资产管理有限公司
二〇二六年十月二十七日