

国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金

2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期:2024 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年01月12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2023年10月01日起至2023年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰君安量化选股混合发起
基金主代码	016466
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 08 月 18 日
报告期末基金份额总额	2, 554, 263, 232. 70 份
投资目标	本基金通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	<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>本基金的投资策略还包括股票投资策略、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、股指期货投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略。</p>
业绩比较基准	中证全指指数收益率*80%+中债综合全价指数收益率*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	中国邮政储蓄银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	国泰君安量化选股混合发起 A	国泰君安量化选股混合发起 C	国泰君安量化选股混合发起 D
下属分级基金的交易代码	016466	016467	018963
报告期末下属分级基金的份额总额	1,006,563,351.58 份	716,584,193.27 份	831,115,687.85 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（2023 年 10 月 01 日-2023 年 12 月 31 日）		
	国泰君安量化选股混合发起 A	国泰君安量化选股混合发起 C	国泰君安量化选股混合发起 D
1. 本期已实现收益	-20,515,664.18	-14,095,480.30	-14,497,913.40
2. 本期利润	-20,684,739.41	-17,676,995.79	-16,870,207.06
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0229	-0.0229	-0.0283
4. 期末基金资产净值	1,036,499,004.33	733,941,009.80	854,505,674.74
5. 期末基金份额净值	1.0297	1.0242	1.0281

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

国泰君安量化选股混合发起 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	-1.57%	0.90%	-3.28%	0.66%	1.71%	0.24%
过去六个月	-6.06%	0.90%	-7.05%	0.67%	0.99%	0.23%
过去一年	8.33%	0.88%	-5.16%	0.65%	13.49%	0.23%
自基金合同 生效起至今	2.97%	0.93%	-12.88%	0.72%	15.85%	0.21%

国泰君安量化选股混合发起 C 净值表现

阶段	净值增长率	净值增长率	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-------	-------	--------	--------	-----	-----

	①	标准差②	收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	-1.67%	0.90%	-3.28%	0.66%	1.61%	0.24%
过去六个月	-6.24%	0.90%	-7.05%	0.67%	0.81%	0.23%
过去一年	7.91%	0.88%	-5.16%	0.65%	13.07%	0.23%
自基金合同生效起至今	2.42%	0.93%	-12.88%	0.72%	15.30%	0.21%

国泰君安量化选股混合发起 D 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	-1.66%	0.90%	-3.28%	0.66%	1.62%	0.24%
自基金合同生效起至今	-6.89%	0.93%	-8.73%	0.68%	1.84%	0.25%

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

国泰君安量化选股混合发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年08月18日-2023年12月31日)



注：本基金于 2022 年 8 月 18 日成立，A 类份额当期的相关数据和指标按实际存续期（即 2022 年 8 月 18 日至 2023 年 12 月 31 日）计算。

国泰君安量化选股混合发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年08月18日-2023年12月31日)



注：本基金于 2022 年 8 月 18 日成立，C 类份额当期的相关数据和指标按实际存续期（即 2022 年 8 月 18 日至 2023 年 12 月 31 日）计算。

国泰君安量化选股混合发起D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08月07日-2023年12月31日)



注：本基金于 2022 年 8 月 18 日成立，D 类份额于 2023 年 8 月 7 日首次申购确认，D 类份额当期的相关数据和指标按实际存续期（即 2023 年 8 月 7 日至 2023 年 12 月 31 日）计算。

§ 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选三个月持有期股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金基金经理。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。	2022-08-18	-	12 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士，12 年证券从业经验，具备基金从业资格。曾任香港科技大学人工智能实验室访问学者，其后加盟方正证券研究所、国泰君安证券咨询部及研究所从事量化对冲模型的研发工作，2014 年加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，先后在量化投资部、权益与衍生品部担任高级投资经理，从事量化投资和策略研发工作，在 Alpha 量化策略以及基于机器学习的投资方面有独到且深入的研究。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 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，无侵害计划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 6 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

本季度市场依然整体呈现弱势，尽管政策层面暖风频吹，缩量博弈的大环境下投资者信心恢复尚需时日，市场在经历了多轮反弹后，依然未能在年内形成有效的反转。期间行业走势的分化大，市场热点整体轮动较快，小微股票和红利低波风格持续亮眼，部分概念股在局部形成较强的热点效应。随着美债收益率持续走高，叠加全球各地冲突不断和国内消费整体低迷，外资净流出幅度较大，带动市场持续走弱，外资重仓股影响较大。三季度数据显示市场整体盈利在二季度触底后，已出现企稳回升态势，当下投资者信心虽然尚需时日，但是我们对国内经济的韧性依然有充足的信心，同时在不断出台长期有利于资本市场健康发展的举措下，我们对 2024 年 A 股市场持乐观态度。展望 2024 年，政策的发力方向会持续在地产等顺周期行业和科技等新兴行业上，同时以大宗消费和文旅消费为抓手的扩内需政策将继续推进。2023 年开年至今，经济已显现见底回升的积极态势且政策呵护有力，同时在连续多年的弱市调整下，A 股市场的估值优势愈发显著，在未来美元降息周期中，A 股将更加有配置价值。

本季度 TMT 行业在经历前期的调整后再次上行，传统能源煤炭由于供需关系等高股息率等特征，本季度表现非常亮眼。然而即使在政策的刺激下，房地产市场本季度仍持续下行，房地产、电力设备、建筑材料等行业表现较差。在整体市场阴跌的趋势下，主题投资在本季度持续火热，华为产业链、人形机器人等热门主题和相关股票展现出强劲的上涨势头。展望 2024 年，科技成长板块和高技术制造业估值已经处于低位，加上持续的政策支持，有不错的成长机会。同时低估值、高分红的策略，在不确定性的市场环境中也有一定的投资价值。

从主要风险因子的走势来看，与三季度大小盘股较为均衡的风格不同，本季度呈现出明显的风格分化，微盘股表现一枝独秀，小盘优于大盘。动量因子在今年三季度表现有所回落，但本季度尤其 12 月表现强劲。四季度由于外部因素的扰动，受风险情绪拖累，投资者避险情绪高涨，估值因子延续了第三季度的较好表现。而流动性和残差波动率具备明显的负向超额收益，成长因子和分析师情

绪因子持续表现弱势。Alpha 表现方面，本季度受制于市场风格的变化，基本面因子表现相比上期减弱。同时，实时量价因子的整体表现受制于缩量下行的低波行情，整体也有所减弱，使得本基金在四季度超额表现差强人意。展望 2024 年，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。

随着 A 股盈利预期改善，美债利率高位回落，中央经济工作会议定调积极，未来稳增长政策进一步推动，近期市场已接近底部，2024 年具备回升条件。我们预计，未来一年市场依然会保持风格切换较快的特点，相对于主观选股来说，量化投资得益于更自由的投资广度和更好的市场风格适应能力仍具有很高的性价比。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。对于投资者而言，主要关注的是市场本身的投资价值以及基金管理人创造 Alpha 的能力和持续性，而在量化投资领域越来越内卷的当下，还需要关注基金管理人面对未来复杂多变的市场环境下的模型迭代能力和控制 Alpha 回撤的能力，以及对行业发展趋势的敏感性和前瞻性，我们也将时刻以这样的标准来要求自己。我们深知得到投资者信任的不易，并以持续给投资者创造价值为己任，也始终保持对市场变幻莫测的敬畏。市场没有一成不变的投资方法论，也没有不回撤的量化模型，我们想要坚持的是，在稳中求胜的投资风格，通过精雕细琢的方式不断完善相对自洽的投资框架和方法论，并通过不断创新来积极拓展自身的能力圈。诚然，在过去很长一段时间，投资本身并不是一件很有成就感的事情，但是我更希望每一次逆水行舟都是蜕变的前奏，每一波模型的回撤都是我们去观察市场变化的重要窗口，并以此为机遇来改进模型。相对来讲，概率取胜是量化投资的主要理念，很少赚运气的钱，我们希望通过自身确定性的努力来尽可能降低每一次交易和每一只持股一丝一毫的不确定性，并通过长期主义将无数微小的偶然性积累成一个更大的确定性。

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。在量化选股层面，我们将结合财务数据为基础、各种另类数据为辅的基本面信号和实时量价信号，通过传统机器学习模型和深度学习模型来有效选择因子，在全市场选股的基础上，通过投资组合管理的方式在控制投资组合整体风险的同时最大化 Alpha 能力的输出。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，并在底层采用多策略的方式降低单策略失效的风险。作为全市场选股的量化基金，相比于通过控制仓位来做择时操作，我们更倾向于通过较稳定的仓位运行来最大程度的兑现我们稳定的 Alpha 能力。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。我们认为当前市场整体估值依然处于历史低估阶段，未来上涨的空间依然远大于下跌的空间，我们将努力通过科学的手段强化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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安量化选股混合发起 A 基金份额净值为 1.0297 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.57%，同期业绩比较基准收益率为-3.28%；截至报告期末国泰君安量化选股混合发起 C 基金份额净值为 1.0242 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.67%，同期业绩比较基准收益率为-3.28%；截至报告期末国泰君安量化选股混合发起 D 基金份额净值为 1.0281 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.66%，同期业绩比较基准收益率为-3.28%。

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	2,444,062,227.49	92.03
	其中：股票	2,444,062,227.49	92.03
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	194,875,991.58	7.34
8	其他资产	16,823,492.21	0.63
9	合计	2,655,761,711.28	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	11,208,752.62	0.43

B	采矿业	48,616,355.00	1.85
C	制造业	1,696,348,598.60	64.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,992,991.10	1.52
E	建筑业	56,536,471.08	2.15
F	批发和零售业	59,974,616.93	2.28
G	交通运输、仓储和邮政业	89,313,491.69	3.40
H	住宿和餐饮业	5,889,658.00	0.22
I	信息传输、软件和信息技术服务业	244,757,395.20	9.32
J	金融业	42,420,542.62	1.62
K	房地产业	4,959,103.42	0.19
L	租赁和商务服务业	13,952,366.72	0.53
M	科学研究和技术服务业	18,041,460.59	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	1,798,873.00	0.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,685,167.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	102,794,442.92	3.92
S	综合	2,771,941.00	0.11
	合计	2,444,062,227.49	93.11

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	002916	深南电路	265,600	18,854,944.00	0.72
2	002913	奥士康	602,800	18,475,820.00	0.70
3	300709	精研科技	564,300	17,600,517.00	0.67
4	601949	中国出版	2,065,800	16,691,664.00	0.64
5	600623	华谊集团	2,544,100	16,384,004.00	0.62
6	002152	广电运通	1,315,500	16,128,030.00	0.61
7	300102	乾照光电	2,193,800	16,124,430.00	0.61
8	002204	大连重工	3,496,000	15,976,720.00	0.61
9	002745	木林森	1,679,900	14,547,934.00	0.55
10	600757	长江传媒	1,905,600	14,196,720.00	0.54

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
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-3,133,410.40
股指期货投资本期公允价值变动（元）					90,839.87

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将按照风险管理原则，以套期保值为目的，依据审慎原则适当参与股指期货投资。本基金将分析股指期货的风险收益特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，利用股指期货的杠杆作用和流动性较好的特点，及时调整投资组合的仓位及风险暴露，以提高组合的运作效率，降低基金资产调整的频率和交易成本，并更好地应对大额申购赎回等流动性风险。

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

本基金将按照风险管理原则，以套期保值为目的，依据审慎原则适度参与国债期货投资。本基金运用国债期货对冲风险，利用国债期货的杠杆作用和流动性较好的特点，灵活运用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，降低基金资产调整的频率和交易成本。

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	16,823,492.21
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	16,823,492.21

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

	国泰君安量化选股混合发起 A	国泰君安量化选股混合发起 C	国泰君安量化选股混合发起 D
报告期期初基金份额总额	848,566,536.63	809,337,601.95	391,163,915.96
报告期期间基金总申购份额	478,517,023.94	131,211,165.30	583,087,114.27
减：报告期期间基金总赎回份额	320,520,208.99	223,964,573.98	143,135,342.38
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	1,006,563,351.58	716,584,193.27	831,115,687.85

§ 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

	国泰君安量化选股混合发起 A	国泰君安量化选股混合发起 C	国泰君安量化选股混合发起 D
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,009,000.00	5,010,000.00	35,071,750.28
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	10,009,000.00	5,010,000.00	35,071,750.28
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.99	0.70	4.22

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

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未发生本基金交易情况。

§ 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	发起份额总数	发起份额占基金总	发起份额承诺持有

		份额比例		份额比例	期限
基金管理人固有资金	50,090,750.28	1.96%	15,019,000.00	0.59%	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	267,159.84	0.01%	-	-	-
基金经理等人员	1,269,856.21	0.05%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	3,882,177.78	0.15%	-	-	-
合计	55,509,944.11	2.17%	15,019,000.00	0.59%	-

§ 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

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。

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、关于准予国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金注册的批复；
- 2、《国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、托管人业务资格批件、营业执照；
- 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

<http://www.gtjazg.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。

上海国泰君安证券资产管理有限公司
二〇二四年一月二十二日