

国泰海通量化选股混合型发起式证券投资基金

2026 年第 1 季度报告

2026 年 03 月 31 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:中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 04 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2026年04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2026年01月01日起至2026年03月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰海通量化选股混合发起
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	1,383,774,671.27 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	上海国泰海通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	国泰海通量化选股混合发起 A	国泰海通量化选股混合发起 C	国泰海通量化选股混合发起 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	634,506,165.19 份	326,935,666.91 份	422,332,839.17 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。国泰海通量化选股混合型发起式证券投资基金由国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金变更而来。国泰海通量化选股混合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 01 月 01 日-2026 年 03 月 31 日）		
	国泰海通量化选股混合发起 A	国泰海通量化选股混合发起 C	国泰海通量化选股混合发起 D
1. 本期已实现收益	45,997,095.27	28,510,277.29	47,128,772.00
2. 本期利润	9,778,912.03	8,903,620.91	18,819,424.70
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0191	0.0307	0.0446
4. 期末基金资产净值	978,098,201.31	496,781,594.97	644,227,969.08
5. 期末基金份额净值	1.5415	1.5195	1.5254

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	4.38%	1.40%	-0.91%	1.03%	5.29%	0.37%
过去六个月	4.43%	1.26%	-0.26%	0.91%	4.69%	0.35%
过去一年	33.32%	1.32%	16.81%	0.93%	16.51%	0.39%

过去三年	39.54%	1.36%	14.23%	1.01%	25.31%	0.35%
自基金合同生效起至今	54.15%	1.30%	10.59%	0.97%	43.56%	0.33%

国泰海通量化选股混合发起 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	4.28%	1.40%	-0.91%	1.03%	5.19%	0.37%
过去六个月	4.23%	1.26%	-0.26%	0.91%	4.49%	0.35%
过去一年	32.80%	1.32%	16.81%	0.93%	15.99%	0.39%
过去三年	37.89%	1.36%	14.23%	1.01%	23.66%	0.35%
自基金合同生效起至今	51.95%	1.30%	10.59%	0.97%	41.36%	0.33%

国泰海通量化选股混合发起 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	4.28%	1.40%	-0.91%	1.03%	5.19%	0.37%
过去六个月	4.22%	1.26%	-0.26%	0.91%	4.48%	0.35%
过去一年	32.79%	1.32%	16.81%	0.93%	15.98%	0.39%
自基金合同生效起至今	38.15%	1.41%	15.86%	1.04%	22.29%	0.37%

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-2026年03月31日)



国泰海通量化选股混合发起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-2026年03月31日)



国泰海通量化选股混合发起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-2026年03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 2026 年 03 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	国泰海通中证 500 指数增强	2022-08-18	-	14 年	胡崇海，浙江大学数学系运

	<p>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。</p>				<p>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。现任本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 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 年第一季度 A 股市场整体呈现先扬后抑、结构分化加剧的走势，核心驱动力源于流动性环境偏宽松与产业景气主线共振，而海外地缘扰动与国内监管控温则构成了阶段性回撤的直接触发因素。具体而言，1 月市场延续跨年“春季躁动”行情，叠加年报预期改善、科技成长主线活跃，风险偏好持续升温，沪深两市单日成交额一度触及历史巅峰水平。但月中融资保证金最低比例上调至 100%，市场内部也由普涨逐步转向高位分化。2 月上中旬，美联储议息会议表态谨慎、美债收益率抬升及部分高位板块获利回吐，A 股震荡整固，成交量收敛。节后复工，宏观数据表现

偏强，叠加国内政策继续偏暖，市场情绪重新修复，科技成长、资源涨价与部分顺周期方向轮动活跃。进入 3 月，上证指数触及季度高点 4197 点，但随后中东地缘冲突升级、霍尔木兹海峡通行受阻引发全球能源价格飙升与滞胀担忧，美元降息预期后移，致市场自高位快速回落，上证指数 3 月末收于 3891 点，市场也从成长风格急剧切换至以贵金属、煤炭和公用事业为主的防御板块。第一季度，科创 50 指数（跌幅 6.54%）和沪深 300 指数（跌幅 3.89%）表现较差，中证红利指数（涨幅 4.07%）、中证 500 指数（涨幅 2.03%）和中证 1000 指数（涨幅 0.32%）则表现较好。

从主要风险因子表现看，年初以来成长风格持续占优，动量因子在一季度亦表现强劲，2 月末至 3 月初尤为突出。行业层面分化显著：受地缘冲突催化，能源链整体走强，煤炭、石油石化行业一季度分别上涨 16.83%和 15.36%；科技成长板块内部则明显分化，AI 算力、人形机器人等主题仍有活跃表现，但板块整体情绪承压。相比之下，金融、消费板块表现偏弱，非银金融指数跌近 15%。资金层面，高估值科技方向出现一定流出，能源金属、电池及医药等兼具景气与防御属性的板块获得资金承接。Alpha 表现方面，价量类因子整体优于基本面因子。

展望 26 年二季度，当前更适合把握主线扩散与业绩确定性的结合。一方面，此前科技 TMT 行情已开始向先进制造扩散，有色主线也在向基础化工等能化方向延伸；另一方面，AI 产业趋势本身并未因地缘事件而被破坏，尽管短期受外部流动性扰动压制估值，但其中盈利增长确定性较强的核心细分方向，仍有望在业绩支撑下穿越波动。结合估值与盈利匹配度看，电力设备、有色金属、传媒、计算机等方向仍具一定配置性价比。中期看，国内经济结构转型与基本面稳中向好趋势未变，市场调整更像上行过程中的阶段性扰动。

本基金充分发挥管理人在多基准、多策略上长期布局的优势，在复杂多变的市场环境下一方面对每一个基准的策略做精做细，另一方面强化管理人的量化策略配置能力。在单个策略层面，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每一个策略表现，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。在策略配置层面，尽量追求高风险偏好的科技成长 and 低风险偏好的红利价值的动态均衡，并通过适当配置全市场最大化 Alpha 策略和中小市值指数增强策略来达到持仓在大中小市值上的均衡，以此进一步增强投资者的持有体验。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，我们一方面通过较稳定的仓位运行来最大程度地兑现我们稳定的 Alpha 能力，另一方面主要通过调整风格迥异的策略配置比例来尽量协调波动和收益的关系。值得一提的是，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，因此更需要投资者长期耐心持有。我们认为当前市场整体估值依然处于历史相对合理区间，从估值与盈利匹配角度看，指数仍具有一定吸引力，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，以此力争为投资者创造长期稳健的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰海通量化选股混合发起 A 基金份额净值为 1.5415 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.38%，同期业绩比较基准收益率为-0.91%；截至报告期末国泰海通量化选股混合发起 C 基金份额净值为 1.5195 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.28%，同期业绩比较基准收益率为-0.91%；截至报告期末国泰海通量化选股混合发起 D 基金份额净值为 1.5254 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.28%，同期业绩比较基准收益率为-0.91%。

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	1,929,439,050.46	90.09
	其中：股票	1,929,439,050.46	90.09
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	202,317,541.69	9.45
8	其他资产	9,872,398.58	0.46
9	合计	2,141,628,990.73	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	17,269,131.19	0.81
B	采矿业	82,011,442.82	3.87
C	制造业	1,281,570,351.44	60.48
D	电力、热力、燃气及 水生产和供应业	57,431,100.00	2.71
E	建筑业	14,959,970.00	0.71
F	批发和零售业	59,969,416.00	2.83
G	交通运输、仓储和邮 政业	42,176,435.66	1.99
H	住宿和餐饮业	1,222,324.00	0.06
I	信息传输、软件和信 息技术服务业	161,793,632.92	7.63
J	金融业	100,320,499.82	4.73
K	房地产业	16,570,555.84	0.78
L	租赁和商务服务业	12,243,086.60	0.58
M	科学研究和技术服务 业	37,879,237.17	1.79
N	水利、环境和公共设 施管理业	17,096,910.00	0.81
O	居民服务、修理和其 他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,449,308.00	0.35
R	文化、体育和娱乐业	19,475,649.00	0.92
S	综合	-	-
	合计	1,929,439,050.46	91.05

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	300750	宁德时代	186,960	75,101,832.0 0	3.54
2	300308	中际旭创	51,500	29,324,615.0	1.38

				0	
3	300502	新易盛	50,200	22,230,568.0 0	1.05
4	300274	阳光电源	132,100	19,915,396.0 0	0.94
5	688336	三生国健	193,791	14,646,723.7 8	0.69
6	601398	工商银行	1,750,400	13,373,056.0 0	0.63
7	300369	绿盟科技	1,509,600	12,303,240.0 0	0.58
8	601998	中信银行	1,475,900	12,249,970.0 0	0.58
9	301292	海科新源	129,300	12,063,690.0 0	0.57
10	601988	中国银行	1,991,400	11,689,518.0 0	0.55

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
IC2605	IC2605	6	9,048,720.00	-36,640.00	-
IC2606	IC2606	1	1,487,680.00	-69,244.44	-
IC2609	IC2609	2	2,907,600.00	-82,840.00	-
IF2604	IF2604	9	11,982,600.00	-420,660.00	-
IF2605	IF2605	2	2,651,400.00	-15,420.00	-
IF2606	IF2606	2	2,627,520.00	-105,394.29	-
IM2605	IM2605	6	9,005,040.00	-48,640.00	-
IM2609	IM2609	2	2,865,520.00	-172,432.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					-951,270.73
股指期货投资本期收益 (元)					2,691,054.30
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					1,099,598.23

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中国工商银行股份有限公司,及其分支行 2025 年 4 月至 2026 年 3 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行及分支行、国家外汇管理局地方分局、地方财政局罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体中信银行股份有限公司,及其分支行 2025 年 4 月至 2026 年 3 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行及分支行、国家外汇管理局地方分局罚款、警告等。

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	5,109,129.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,763,268.98
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	9,872,398.58

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

	国泰海通量化选股混 合发起 A	国泰海通量化选股混 合发起 C	国泰海通量化选股混 合发起 D
报告期期初基金份额	478,507,976.94	255,405,751.78	305,926,030.12

总额			
报告期期间基金总申购份额	392,375,045.70	163,699,059.69	255,292,393.33
减：报告期期间基金总赎回份额	236,376,857.45	92,169,144.56	138,885,584.28
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	634,506,165.19	326,935,666.91	422,332,839.17

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

	国泰海通量化选股混合发起 A	国泰海通量化选股混合发起 C	国泰海通量化选股混合发起 D
报告期期初管理人持有的本基金份额	8,671,430.55	-	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	8,671,430.55	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	-	-

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

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	赎回	2026-03-04	8,671,430.55	- 13,798,014.98	0.0050

合计			8,671,430.55	13,798,014.98	-
----	--	--	--------------	---------------	---

注：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。

§ 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	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	294,516.00	0.02%	-	-	-
基金经理等人员	1,074,816.68	0.08%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	4,366,618.44	0.32%	-	-	-
合计	5,735,951.12	0.42%	-	-	-

注：本基金的发起份额承诺持有期已满 3 年，发起份额已全部赎回。

§ 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、《国泰海通量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰海通量化选股混合型发起式证券投资基金托管协议》；

- 4、《国泰海通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 <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
二〇二六年四月二十二日