

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

2023 年第 3 季度报告

2023 年 09 月 30 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:2023 年 10 月 25 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2023年10月20日复核了本报告中的主要财务指标、净值表现、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07月01日起至2023年09月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起
基金主代码	017209
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 11 月 16 日
报告期末基金份额总额	87,208,220.12 份
投资目标	本基金主要投资于科技创新相关主题的股票，把握中国创新驱动发展的投资机遇，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	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。 本基金的投资策略还包括股票投资策略、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、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、融资策略。
业绩比较基准	中国战略新兴产业综合指数收益率*90%+中债新综合财富(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	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C
下属分级基金的交易代码	017209	017210
报告期末下属分级基金的份额总额	46,783,231.49 份	40,424,988.63 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 07 月 01 日-2023 年 09 月 30 日)	
	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C
1. 本期已实现收益	-1,424,147.50	-2,363,035.72
2. 本期利润	-1,684,632.36	-2,621,083.13
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0531	-0.0614
4. 期末基金资产净值	46,809,820.66	40,276,499.40
5. 期末基金份额净值	1.0006	0.9963

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

###### 国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 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	-5.21%	1.18%	-8.26%	0.92%	3.05%	0.26%
过去六个月	-5.84%	1.18%	-11.20%	0.92%	5.36%	0.26%
自基金合同 生效起至今	0.06%	1.11%	-8.70%	0.89%	8.76%	0.22%

###### 国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 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	-5.33%	1.18%	-8.26%	0.92%	2.93%	0.26%
过去六个月	-6.09%	1.18%	-11.20%	0.92%	5.11%	0.26%
自基金合同生效起至今	-0.37%	1.11%	-8.70%	0.89%	8.33%	0.22%

### 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

国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起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

(2022年11月16日-2023年09月30日)



国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起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

(2022年11月16日-2023年09月30日)



注：本基金合同生效日为 2022 年 11 月 16 日，截至本报告期末基金合同生效不满一年。

## § 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。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。	2022-11-17	-	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遵规守信情况的说明

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，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 16 次。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。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

分行业来看，三季度行业走出反转行情，年初走势较好的计算机、通讯、传媒等科技行业跌幅较大，相对而言大金融、周期资源等传统行业逐渐走强。主要的推动力可能是稳增长政策的逐步落地和前期 TMT 行业的超涨。随着房地产和资本市场政策的逐渐出台和落地，未来短期消费、地产、券商等行业基本面将受益，但是中长期看来，科技成长仍然是市场的主线。

三季度科创 50 指数（跌幅 11.67%）和创业板指数（跌幅 9.53%）表现较差，相对于沪深 300 指数（跌幅 3.98%），中证 500 指数（跌幅 5.13%）和中证 2000 指数（跌幅 5.73%）有更大程度的回调，差于主要的宽基指数。从市场表现来看，三季度是市场相互博弈的过程，市场经历了两轮连续缩量及两次的政策刺激。但由于经济形势的脆弱性和企业盈利不及预期，市场信心仍然偏弱。叠加国际形势和汇率走势偏弱，外资避险情绪严重，北向资金三季度持续流出 800 亿元，市场整体处于震荡阴跌的阶段。与市场整体相反，部分热点板块的赚钱效应显著，比如 AI，华为产业链，新型工业化等市场热点不断涌出。展望后市，由于宽松政策的密集加码，政策底部的逐渐明确，企业基本面和盈利的企稳回升，流动性的逐步改善，四季度有望迎来修复性行情，科技成长可能会成为市场的主线。

本基金聚焦科创板，投资于成长潜力较大的科技新兴产业，挖掘 A 股未来最有潜力的结构性 Beta。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，获取大幅超越科创板主流指数（如科创 50、科创 100）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、中证创新能等的行业分布，在高端装备、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。

我们预计，未来一年将继续科技创新的主题，但是科技创新风格中的行业板块也会有轮动。相对于主观选股来说，量化投资依然有较大的可为空间和较高的性价比。在行业和个股走势出现较大的变化下，我们依然维持一贯的投资理念和投资组合管理体系，本基金在投资组合的配置和交易方面严格遵循量化模型的建议，基金经理则主要从挖掘有投资逻辑的 Alpha 因子、随着市场演变不断改进底层量化模型以及模型的日常跟踪和分析等层面不断增强策略的表现，常年来我们坚守整体一贯的投资体系和理念，也尽可能以此稳定投资者在不同市场环境下对我们超额收益率的预期。在量化增强层面，我们尽量结合以财务数据为基础的基本面信号和以高频量价为主的技术面信号，通过机器学习模型来进行有效因子的选择和因子之间的轮动，得益于基本面量化和高频量价在信号层面较低的相关性，使得我们有信心在兼顾两者的情况下追求稳健的 Alpha。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A 基金份额净值为 1.0006 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.21%，同期业绩比较基准收益率为-8.26%；截至报告期末国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C 基金份额净值为 0.9963 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.33%，同期业绩比较基准收益率为-8.26%。

#### 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	81,371,173.19	92.98
	其中：股票	81,371,173.19	92.98
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	6,030,564.13	6.89
8	其他资产	110,452.57	0.13
9	合计	87,512,189.89	100.00

## 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	-	-
C	制造业	62,183,084.21	71.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	181,956.00	0.21
E	建筑业	1,195,887.00	1.37
F	批发和零售业	-	-
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	16,681,854.83	19.16
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,117,067.15	1.28
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	11,324.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	81,371,173.19	93.44

### 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	688599	天合光能	83,088	2,540,000.16	2.92
2	688099	晶晨股份	36,500	2,301,325.00	2.64
3	688772	珠海冠宇	107,221	1,973,938.61	2.27
4	688006	杭可科技	69,688	1,822,341.20	2.09
5	688981	中芯国际	35,168	1,798,843.20	2.07
6	688083	中望软件	14,517	1,757,137.68	2.02
7	688368	晶丰明源	15,807	1,699,726.71	1.95
8	688002	睿创微纳	34,900	1,664,730.00	1.91
9	688111	金山办公	4,430	1,642,644.00	1.89
10	688187	时代电气	39,825	1,584,238.50	1.82

### 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

本基金可投资股指期货。若本基金投资股指期货，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

本基金可投资国债期货。若本基金投资国债期货，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上海晶丰明源半导体股份有限公司，2023 年 6 月因未及时披露收购协议安排，被上海证券交易所处以监管警示的处罚。

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	110,452.57
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	110,452.57

#### 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

	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C
报告期期初基金份额总额	24,551,253.38	45,764,481.15
报告期期间基金总申购份额	22,714,641.80	1,314,720.86
减：报告期期间基金总赎回份额	482,663.69	6,654,213.38
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	46,783,231.49	40,424,988.63

### § 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

	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 A	国泰君安科技创新精选三个月持有股票发起 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,009,000.00	5,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	19,662,766.69	-
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	29,671,766.69	5,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	63.42	12.37

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

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	申购	2023-09-01	19,662,766.69	19,999,000.00	0
合计			19,662,766.69	19,999,000.00	

注：本基金 A 类份额当申购金额大于或等于 500 万时，每笔收取固定费用 1000 元。

## § 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	34,671,766.69	39.76%	15,009,000.00	17.21%	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	859,969.93	0.99%	-	-	-
基金经理等人员	873,552.67	1.00%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	5,394,534.21	6.19%	-	-	-
合计	41,799,823.50	47.94%	15,009,000.00	17.21%	-

## § 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	20230701-20230930	15,009,000.00	19,662,766.69	-	34,671,766.69	39.76%
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技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金注册的批复；
- 2、《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合同》；
- 3、《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托管协议》；
- 4、《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 <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  
二〇二三年十月二十五日