

**国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金**  
**2023 年第 2 季度报告**  
**2023 年 6 月 30 日**

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年七月二十一日

## §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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 年 7 月 19 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 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |                                                                                                            |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 国泰民福策略价值灵活配置混合                                                                                             |
| 基金主代码      | 002489                                                                                                     |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                     |
| 基金合同生效日    | 2019 年 3 月 30 日                                                                                            |
| 报告期末基金份额总额 | 114,017,155.10 份                                                                                           |
| 投资目标       | 在严格控制风险的前提下，追求稳健的投资回报。                                                                                     |
| 投资策略       | 1、资产配置策略； 2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、固定收益类投资工具投资策略； 5、中小企业私募债投资策略；6、资产支持证券投资策略； 7、权证投资策略；8、股指期货投资策略；9、股票期权投资策略。 |
| 业绩比较基准     | 50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率                                                                            |
| 风险收益特征     | 本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。                                                                |
| 基金管理人      | 国泰基金管理有限公司                                                                                                 |

|                 |                  |                  |
|-----------------|------------------|------------------|
| 基金托管人           | 中国银行股份有限公司       |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 国泰民福策略价值灵活配置混合 A | 国泰民福策略价值灵活配置混合 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 002489           | 014998           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 110,280,319.16 份 | 3,736,835.94 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<br>(2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) |                  |
|----------------|-----------------------------------------|------------------|
|                | 国泰民福策略价值灵活配置混合 A                        | 国泰民福策略价值灵活配置混合 C |
|                |                                         |                  |
| 1.本期已实现收益      | -1,994,991.88                           | -28,294.04       |
| 2.本期利润         | -2,788,861.36                           | -42,320.78       |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0226                                 | -0.0120          |
| 4.期末基金资产净值     | 163,986,450.02                          | 5,526,689.93     |
| 5.期末基金份额净值     | 1.4870                                  | 1.4790           |

注：(1)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。

(2)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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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

##### 1、国泰民福策略价值灵活配置混合 A：

| 阶段 | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----|------------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|
|----|------------|---------------|----------------|-----------------------|-----|-----|

|            |        |       |        |       |        |        |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去三个月      | -1.34% | 0.15% | -1.69% | 0.41% | 0.35%  | -0.26% |
| 过去六个月      | -0.63% | 0.14% | 1.08%  | 0.42% | -1.71% | -0.28% |
| 过去一年       | -2.37% | 0.16% | -5.21% | 0.49% | 2.84%  | -0.33% |
| 过去三年       | 17.48% | 0.25% | 3.20%  | 0.60% | 14.28% | -0.35% |
| 自基金合同生效起至今 | 40.95% | 0.34% | 10.74% | 0.61% | 30.21% | -0.27% |

## 2、国泰民福策略价值灵活配置混合 C：

| 阶段               | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月            | -1.43%     | 0.15%         | -1.69%         | 0.41%                 | 0.26%  | -0.26% |
| 过去六个月            | -0.82%     | 0.14%         | 1.08%          | 0.42%                 | -1.90% | -0.28% |
| 过去一年             | -2.75%     | 0.16%         | -5.21%         | 0.49%                 | 2.46%  | -0.33% |
| 自新增 C 类<br>份额起至今 | -2.53%     | 0.19%         | -5.63%         | 0.58%                 | 3.10%  | -0.39% |

### 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

国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
 (2019 年 3 月 30 日至 2023 年 6 月 30 日)

#### 1. 国泰民福策略价值灵活配置混合 A：



注：本基金的合同生效日为 2019 年 3 月 30 日。

## 2. 国泰民福策略价值灵活配置混合 C:



注: (1)本基金的合同生效日为 2019 年 3 月 30 日;

(2)自 2022 年 2 月 15 日起, 本基金增加 C 类基金份额并分别设置对应的基金代码。

## §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 |        |                                                                                                                                                                                                                                     |
| 戴计辉 | 国泰国策驱动灵活配置混合、国泰睿吉灵活配置混合、国泰民福策略价值灵活配置混 | 2019-08-16  | -    | 11 年   | 硕士研究生。2012 年 5 月至 2014 年 5 月在长江证券股份有限公司工作, 任分析师。2014 年 6 月至 2015 年 9 月在招商证券股份有限公司工作, 历任分析师、首席分析师。2015 年 9 月加入国泰基金, 历任研究员、基金经理助理。2018 年 12 月起任国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2019 年 8 月起兼任国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金和国泰睿 |

|  |                                                                        |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--|------------------------------------------------------------------------|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 合、国泰民利策略收益灵活配置混合、国泰融信灵活配置混合（LOF）、国泰合益混合、国泰诚益混合、国泰惠元混合、国泰悦益六个月持有混合的基金经理 |  |  |  | 吉灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 7 月至 2022 年 6 月任国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 8 月起兼任国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理，2021 年 2 月起兼任国泰合益混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 5 月起兼任国泰诚益混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 10 月起兼任国泰惠元混合型证券投资基金的基金经理，2023 年 1 月起兼任国泰悦益六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。 |
|--|------------------------------------------------------------------------|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，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。

#### 4.2 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，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

#### 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，本基金管理人严格遵守《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，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，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，本基金与本基金管理人管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。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业绩表现说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度，国内经济恢复弱于我们预期。消费、工业企业利润、物价、PMI 等各项数据不及预期，地产新开工低迷，同时部分地方政府的偿债能力有隐忧。在各项不及预期的经济数据和事件冲击下，市场对中国经济前景极度悲观。同时美元走强、人民币贬值，外资持续流出，也加剧了市场的调整。整个二季度，WIND 全 A 跌幅 3.2%，上证指数跌 2.2%，上证 50 跌 6.4%。

结构上，今年流动性宽松和走弱的经济，使得大量资金都被虹吸到主题投资上，量化则成为这一趋势的放大器，主题演绎非常猛烈，AI 相关的算力、应用方向表现最佳，如通信、传媒、人形机器人等，而消费、地产链、周期等表现较差。另外，家电、公用事业、汽车等有正收益。

二季度，受到宏观经济弱复苏、货币政策宽松以及信贷投放减速等因素的影响，债券市场整体上涨。如前述，各项经济数据持续低于市场预期，货币政策偏向宽松，央行通过利率自律机制不断调降银行各类存款利率。6 月份，央行将逆回购与 MLF 利率下调 10BP，随后 LPR 也等幅降低 10BP。利率债方面，十年国债收益率从一季度末的 2.85% 下降 18BP 至 2.67%；十年国开债收益率从 3.02% 下降 20BP 至 2.82%。由于资金利率相对一季度有所降低，国债收益率曲线陡峭，十年减一年利差走阔 6BP。信用债方面，在一季度信用利差快速修复后，二季度信用利差持窄幅震荡，长久期略有走阔。

4 月以来，考虑经济、市场弱于我们之前判断，我们对组合做了更多调整，一是分散化，二是提升估值权重对组合的保护。具体操作上，基于一季报减了部分军工、医药、建材和金融，加了低位的家电、化工、新能源、电子、公用事业，组合更分散，增加了组合持仓个股数量，而降低了单只个股持仓比例。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类本报告期内的净值增长率为-1.34%，同期业绩比较基准收益率为-1.69%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-1.43%，同期业绩比较基准收益率为-1.69%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对未来保持乐观。过度悲观的经济预期有望修复。前期，青年失业率等数据被关注，我们认为经济可能已经触及政策目标的下限，后续政策托底的可能性提升，即便没有政策支持，结构上服务业在持续恢复，工业端下半年有补库存需求，草根调研的部分行业出口也在恢复中，因此我们倾向于认为经济预期最差的阶段正在过去。另外，大量具备成长阿尔法的优秀公司，估值跌到了极具性价比的位置。

在经济没有大的起色，主题投资出现交易拥挤时，业绩能改善或高增长的板块和个股将弥足珍贵，他们集中在驾校、医药、民航发动机、轮胎、家电、消费电子、公用事业、新能源等行业，支撑业绩改善的因素主要有：出行及线下消费场景恢复、外需拉动、补库存、成本下降等，这是我们短期重点关注的方向。另外，我们依然关注估值极具性价比有自身成长性的优质个股，集中在金融、机械、化工、半导体、有色、电气设备等行业。

债券市场方面，我们预计将进入震荡格局。主线是“弱实际、强预期”，后续要密切关注稳增长政策的出台和落地情况。经济复苏力度较弱，基本面情况对债市有利，但政策方面可能会推出特别国债、政金工具以及地方债余额限额等财政刺激措施，这可能会带来收益率上升的风险。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §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   | 24,666,137.19  | 14.51        |
|    | 其中：股票  | 24,666,137.19  | 14.51        |
| 2  | 固定收益投资 | 122,962,158.14 | 72.32        |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 其中：债券             | 122,962,158.14 | 72.32  |
|   | 资产支持证券            | -              | -      |
| 3 | 贵金属投资             | -              | -      |
| 4 | 金融衍生品投资           | -              | -      |
| 5 | 买入返售金融资产          | -              | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -      |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计      | 21,893,574.01  | 12.88  |
| 7 | 其他各项资产            | 513,705.89     | 0.30   |
| 8 | 合计                | 170,035,575.23 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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              | 1,053,767.00  | 0.62         |
| C  | 制造业              | 14,907,910.29 | 8.79         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,998,492.00  | 1.18         |
| E  | 建筑业              | 454,608.00    | 0.27         |
| F  | 批发和零售业           | 349,650.00    | 0.21         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 330,848.00    | 0.20         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,533,034.90  | 0.90         |
| J  | 金融业              | 2,396,059.00  | 1.41         |
| 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       | -             | -            |
| 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               | 1,641,768.00  | 0.97         |

|   |           |               |       |
|---|-----------|---------------|-------|
| Q | 卫生和社会工作   | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业 | -             | -     |
| S | 综合        | -             | -     |
|   | 合计        | 24,666,137.19 | 14.55 |

### 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  | 603377 | 东方时尚 | 204,200 | 1,641,768.00 | 0.97         |
| 2  | 688169 | 石头科技 | 3,839   | 1,231,090.52 | 0.73         |
| 3  | 688036 | 传音控股 | 7,878   | 1,158,066.00 | 0.68         |
| 4  | 000333 | 美的集团 | 16,800  | 989,856.00   | 0.58         |
| 5  | 601658 | 邮储银行 | 196,800 | 962,352.00   | 0.57         |
| 6  | 600276 | 恒瑞医药 | 17,440  | 835,376.00   | 0.49         |
| 7  | 600863 | 内蒙华电 | 200,400 | 831,660.00   | 0.49         |
| 8  | 603308 | 应流股份 | 42,080  | 770,064.00   | 0.45         |
| 9  | 601058 | 赛轮轮胎 | 67,100  | 764,269.00   | 0.45         |
| 10 | 002459 | 晶澳科技 | 18,160  | 757,272.00   | 0.45         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 9,722,635.75   | 5.74         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 20,232,196.16  | 11.94        |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | 46,170,755.35  | 27.24        |
| 5  | 企业短期融资券   | 5,066,557.38   | 2.99         |
| 6  | 中期票据      | 28,588,859.75  | 16.87        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 13,181,153.75  | 7.78         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 122,962,158.14 | 72.54        |

### 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

| 序号 | 债券代码      | 债券名称                  | 数量（张）   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-----------------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 155510    | 19 恒健 01              | 100,000 | 10,411,059.18 | 6.14         |
| 2  | 132100093 | 21 鲁能源<br>GN005(碳中和债) | 100,000 | 10,377,430.14 | 6.12         |
| 3  | 188541    | 国电投 08                | 100,000 | 10,273,928.77 | 6.06         |
| 4  | 175299    | 20 扬子 G3              | 100,000 | 10,241,666.85 | 6.04         |
| 5  | 175840    | 21 南网 01              | 100,000 | 10,162,958.36 | 6.00         |

### 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

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“国泰君安、华泰证券”违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

国泰君安及下属分支机构因投资银行类业务内部控制不完善、廉洁从业风险防控机制不完善、聘请第三方廉洁从业风险防控不到位、违反反洗钱法、员工不具备基金从业资格、发布证券研究报告业务质量控制和合规审查的制度规定不完善，未建立有效的证券研究报告市场影响评估机制，未对某证券研究报告相关敏感信息可能对市场产生的影响进行审慎评估等问题，受到证监会、地方证监局、央行派出机构责令改正、罚款、出具警示函等处罚。

华泰证券下属分支机构因分公司经纪业务管理存在四项问题、营业部存在不相容岗位未分离、合规管理岗从事营销活动、“双录”工作不完整、不全面等问题，受到地方证监局责令改正、警示函等处罚。

本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

5.11.2 基金投资的前十名证券中，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   | 25,558.95  |
| 2  | 应收证券清算款 | 486,272.25 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 1,874.69   |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 513,705.89 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 110082 | 宏发转债    | 5,620,499.65 | 3.32         |
| 2  | 110059 | 浦发转债    | 4,816,591.73 | 2.84         |
| 3  | 110053 | 苏银转债    | 2,319,463.23 | 1.37         |
| 4  | 113053 | 隆 22 转债 | 50,362.93    | 0.03         |

### 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

| 项目             | 国泰民福策略价值灵活<br>配置混合A | 国泰民福策略价值灵活<br>配置混合C |
|----------------|---------------------|---------------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 151,850,744.62      | 4,876,117.13        |
| 报告期期间基金总申购份额   | 170,002.95          | 3,414,553.71        |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 41,740,428.41       | 4,553,834.90        |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -                   | -                   |
| 本报告期末基金份额总额    | 110,280,319.16      | 3,736,835.94        |

## §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

|                          |           |
|--------------------------|-----------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 67,046.60 |
| 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         | 67,046.60 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 0.06      |

### 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，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §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

| 投资者<br>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<br>额      | 申购份<br>额 | 赎回份<br>额      | 持有份额         | 份额占比  |
| 机构        | 1              | 2023 年 04 月 01 日至 2023 年 05 月 07 日 | 33,674,445.44 | -        | 28,674,445.44 | 5,000,000.00 | 4.39% |

| 产品特有风险                                                        |
|---------------------------------------------------------------|
| 当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。 |

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰民福保本混合型证券投资基金注册的批复
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

### 9.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层。

基金托管人住所。

### 9.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇二三年七月二十一日