

**国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金**  
**2023 年第 3 季度报告**  
**2023 年 9 月 30 日**

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

## §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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 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。

为更好地满足广大投资者的投资理财需求，降低投资者的理财成本，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，本基金管理人决定自 2023 年 7 月 24 日起，调低本基金的托管费率并对基金合同有关条款进行修订。具体可查阅本基金管理人于 2023 年 7 月 22 日发布的《国泰基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 国泰浓益灵活配置混合   |
| 基金主代码      | 000526   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2014 年 3 月 4 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 90,864,645.86 份  |
| 投资目标       | 在严格控制风险的前提下，追求稳健的绝对回报。   |
| 投资策略       | 本基金采用积极灵活的投资策略，通过前瞻性地判断不同金融资产的相对收益，完成大类资产配置。在大类资产配置的基础上，精选个股，完成股票组合的构建，并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合 |

|                 |  |                |
|-----------------|--|----------------|
|                 | 的构建。在严格的风险控制基础上，力争实现长期稳健的绝对收益。<br><br>本基金主要投资策略包括：1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、固定收益品种投资策略；5、股指期货投资策略；6、权证投资策略。 |                |
| 业绩比较基准          | 三年期银行定期存款利率（税后）+2%   |                |
| 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           | 中国农业银行股份有限公司   |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 国泰浓益灵活配置混合 A   | 国泰浓益灵活配置混合 C   |
| 下属分级基金的交易代码     | 000526   | 002059         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 85,731,720.63 份  | 5,132,925.23 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 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日) |               |
|                | 国泰浓益灵活配置混合 A                     | 国泰浓益灵活配置混合 C  |
| 1.本期已实现收益      | -2,622,509.93                    | -2,097,992.21 |
| 2.本期利润         | -1,801,542.86                    | -1,130,092.44 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0176                          | -0.0308       |
| 4.期末基金资产净值     | 108,966,202.00                   | 11,970,668.62 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.271                            | 2.332         |

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、国泰浓益灵活配置混合 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          | -1.32%     | 0.19%         | 1.20%          | 0.01%                 | -2.52% | 0.18% |
| 过去六个月          | -1.63%     | 0.20%         | 2.38%          | 0.01%                 | -4.01% | 0.19% |
| 过去一年           | -2.12%     | 0.20%         | 4.75%          | 0.02%                 | -6.87% | 0.18% |
| 过去三年           | 11.36%     | 0.25%         | 14.25%         | 0.01%                 | -2.89% | 0.24% |
| 过去五年           | 32.34%     | 0.43%         | 23.75%         | 0.01%                 | 8.59%  | 0.42% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 73.23%     | 0.44%         | 46.90%         | 0.01%                 | 26.33% | 0.43% |

#### 2、国泰浓益灵活配置混合 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            | -1.27%     | 0.19%         | 1.20%          | 0.01%                 | -2.47%  | 0.18% |
| 过去六个月            | -1.56%     | 0.19%         | 2.38%          | 0.01%                 | -3.94%  | 0.18% |
| 过去一年             | -2.07%     | 0.20%         | 4.75%          | 0.02%                 | -6.82%  | 0.18% |
| 过去三年             | 11.13%     | 0.25%         | 14.25%         | 0.01%                 | -3.12%  | 0.24% |
| 过去五年             | 31.92%     | 0.43%         | 23.75%         | 0.01%                 | 8.17%   | 0.42% |
| 自新增 C 类<br>份额起至今 | 158.76%    | 2.12%         | 37.39%         | 0.01%                 | 121.37% | 2.11% |

### 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

国泰浓益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

(2014 年 3 月 4 日至 2023 年 9 月 30 日)

#### 1. 国泰浓益灵活配置混合 A：



注：1、本基金自 2014 年 3 月 4 日合同生效。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

2、本基金自 2015 年 3 月 23 日起业绩比较基准由原“五年期银行定期存款利率（税后）+1%”，变更为“三年期银行定期存款利率（税后）+2%”。

## 2. 国泰浓益灵活配置混合 C:



注：1、本基金自 2014 年 3 月 4 日合同生效。本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产

配置比例符合合同约定。自 2015 年 11 月 16 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。

2、本基金自 2015 年 3 月 23 日起业绩比较基准由原“五年期银行定期存款利率（税后）+1%”，变更为“三年期银行定期存款利率（税后）+2%”。

## §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 |        |   |
| 樊利安 | 国泰浓益灵活配置混合、国泰民益灵活配置混合（LOF）、国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）、国泰宏益一年持有期混合、国泰同益 18 个月持有期混合、国泰浩益混合、国泰科创板两年 | 2014-10-21  | -    | 17 年   | 硕士。曾任职上海鑫地投资管理有限公司、天治基金管理有限公司等。2010 年 7 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2014 年 10 月起任国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原国泰淘新灵活配置混合型证券投资基金）和国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 1 月至 2018 年 8 月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月至 2019 年 1 月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，2015 年 5 月至 2020 年 5 月任国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月至 2019 年 12 月任国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月至 2018 年 2 月任国泰生益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2015 年 6 月至 2017 年 1 月任国泰金泰平衡混合型证券投资基金（由金泰证券投资基金转型而来）的基金经理，2016 年 5 月至 2017 年 11 月任国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 8 月至 2018 年 |

|  |   |  |  |  |   |
|--|---|--|--|--|---|
|  | 定期开<br>放混<br>合、国<br>泰安璟<br>债券、<br>国泰慧<br>益一年<br>持有混<br>合的基<br>金经理 |  |  |  | <p>8 月任国泰添益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 10 月至 2018 年 4 月任国泰福益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 11 月至 2018 年 12 月任国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2019 年 12 月任国泰普益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2020 年 5 月任国泰安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 3 月任国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 5 月任国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 6 月任国泰景益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 8 月任国泰信益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 9 月任国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 5 月任国泰嘉益灵活配置混合型证券投资基金、国泰众益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 9 月任国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 7 月至 2018 年 11 月任国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 7 月至 2018 年 9 月任国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月至 2018 年 9 月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 11 月起兼任国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）的基金经理，2018 年 1 月至 2018</p> |
|--|---|--|--|--|---|

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | <p>年 5 月任国泰瑞益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月至 2018 年 8 月任国泰恒益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 9 月至 2020 年 8 月任国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）的基金经理，2019 年 5 月至 2020 年 6 月任国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金和国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 8 月至 2020 年 10 月任国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 6 月起兼任国泰宏益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 8 月至 2022 年 2 月任国泰浩益 18 个月封闭运作混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 4 月起兼任国泰同益 18 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理，2022 年 2 月起兼任国泰浩益混合型证券投资基金（由国泰浩益 18 个月封闭运作混合型证券投资基金变更而来）和国泰科创板两年定期开放混合型证券投资基金的基金经理，2023 年 1 月起兼任国泰安璟债券型证券投资基金的基金经理，2023 年 8 月起兼任国泰慧益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月至 2016 年 1 月任研究部副总监，2016 年 1 月至 2018 年 7 月任研究部副总监（主持工作），2018 年 7 月至 2019 年 7 月任研究部总监。</p> |
|--|--|--|--|--|--|

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法律法规及行业协会的相关规定。

#### 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

今年三季度，市场总体处于弱势调整过程中。低估值、高股息行业表现较好，电力设备、TMT 行业调整幅度较大。最终上证指数下跌 2.86%，深证成指下跌 8.32%，创业板指下跌 9.53%。从申万一级行业来看，非银、煤炭、石油石化行业表现较好，逆市上涨，而电力设备、通信、传媒及计算机行业下跌幅度超过 10%。

下半年经济数据走弱得到进一步验证，而美国经济表现强劲，10 年美债收益率创出本轮上行新高，美元指数亦持续上行，人民币面临较大贬值压力，外资持续流出，资本市场上北向资金三季度净卖出约 800 亿元。7 月 24 日政治局会议提出“要活跃资本市场，提振投资者信心”，8 月 27 日监管层调降印花税、收紧 IPO 和再融资、规范减持、降低融资保证金比例“四箭齐发”，这些政策一度显著提振投资者情绪，但对市场风险偏好改善总体有限。三季度新能源电池、光伏板块在

对供给过剩的担忧下出现一波快速调整，TMT 行业下跌较多主要是 AI 相关股票在二季度大幅上涨后出现的一波回调。

本基金以绝对收益策略为主，在股票方面，三季度适当降低了仓位，调低了部分成长行业股票的配置，增加了高股息品种配置比例，提高了组合的防御性。债券方面，本基金主要以高等级信用债票息策略为主。

#### 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-1.32%，同期业绩比较基准收益率为 1.20%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-1.27%，同期业绩比较基准收益率为 1.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，我们认为国内经济有望持续改善，PPI 已经出现触底回升迹象，国内对于房地产的扶持政策效应有望开始显现。美国非农就业人数表现强劲，但美元紧缩周期已经接近末期，市场普遍预期本轮最多再有 1-2 次加息。人民币汇率在 7.3 一线已经企稳，央行表示要坚决防范汇率超调风险，保持汇率在合理均衡水平。同时 A 股估值水平在过去两年经过充分消化，已经处于相对低位。

我们认为四季度 A 股市场表现将有所改善，但总体表现为区间震荡的概率更大。一方面国内经济增长动能逐步修复，市场估值处于低位，存在修复的空间；另一方面，目前缺乏提振市场情绪的产业趋势主线。如果美国经济四季度超预期走弱，市场或迎来较大幅度反弹。

#### 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  | 21,573,186.20 | 17.77        |
|    | 其中：股票 | 21,573,186.20 | 17.77        |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 2 | 固定收益投资            | 93,530,242.52  | 77.06  |
|   | 其中：债券             | 93,530,242.52  | 77.06  |
|   | 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      | 6,243,162.89   | 5.14   |
| 7 | 其他各项资产            | 24,716.18      | 0.02   |
| 8 | 合计                | 121,371,307.79 | 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              | 4,771,522.15  | 3.95         |
| C  | 制造业              | 13,578,807.05 | 11.23        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 998,980.00    | 0.83         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -             | -            |
| J  | 金融业              | 1,390,018.00  | 1.15         |
| K  | 房地产业             | 382,851.00    | 0.32         |
| 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    | 451,008.00    | 0.37         |
| 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 | -             | -     |
| S | 综合        | -             | -     |
|   | 合计        | 21,573,186.20 | 17.84 |

### 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  | 000603 | 盛达资源 | 118,715 | 1,710,683.15 | 1.41         |
| 2  | 605377 | 华旺科技 | 62,900  | 1,405,186.00 | 1.16         |
| 3  | 688036 | 传音控股 | 9,218   | 1,343,431.32 | 1.11         |
| 4  | 688531 | 日联科技 | 8,819   | 1,173,015.19 | 0.97         |
| 5  | 601058 | 赛轮轮胎 | 91,500  | 1,153,815.00 | 0.95         |
| 6  | 600519 | 贵州茅台 | 600     | 1,079,130.00 | 0.89         |
| 7  | 000333 | 美的集团 | 19,100  | 1,059,668.00 | 0.88         |
| 8  | 301035 | 润丰股份 | 12,457  | 890,675.50   | 0.74         |
| 9  | 600988 | 赤峰黄金 | 56,500  | 821,510.00   | 0.68         |
| 10 | 002475 | 立讯精密 | 27,100  | 808,122.00   | 0.67         |

### 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      | 6,589,457.81  | 5.45         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 4,983,897.27  | 4.12         |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | 10,192,948.49 | 8.43         |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | 71,763,938.95 | 59.34        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -            |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |

|    |    |               |       |
|----|----|---------------|-------|
| 10 | 合计 | 93,530,242.52 | 77.34 |
|----|----|---------------|-------|

### 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  | 102282240 | 22 海淀国资 MTN001 | 100,000 | 10,377,312.33 | 8.58         |
| 2  | 102001968 | 20 河钢集 MTN013  | 100,000 | 10,373,449.86 | 8.58         |
| 3  | 102282571 | 22 晋能电力 MTN006 | 100,000 | 10,314,616.44 | 8.53         |
| 4  | 102380274 | 23 兴泰金融 MTN001 | 100,000 | 10,297,802.74 | 8.52         |
| 5  | 155784    | 19 义乌 01       | 100,000 | 10,192,948.49 | 8.43         |

### 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。

5.11.2 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   | 24,408.56 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | 307.62    |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 24,716.18 |

#### 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

| 项目             | 国泰浓益灵活配置混合<br>A | 国泰浓益灵活配置混合<br>C |
|----------------|-----------------|-----------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 115,754,975.90  | 44,000,670.99   |
| 报告期期间基金总申购份额   | 3,898,244.07    | 52,355.22       |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 33,921,499.34   | 38,920,100.98   |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -               | -               |
| 本报告期期末基金份额总额   | 85,731,720.63   | 5,132,925.23    |

## §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

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

### 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              | 2023 年 07 月 01 日至 2023 年 09 月 30 日 | 32,000,000.00 | 3,860,231.66 | -             | 35,860,231.66 | 39.47% |
|   | 2              | 2023 年 07 月 01 日至 2023 年 09 月 25 日 | 32,647,554.53 | -            | 32,647,554.53 | -             | -      |
|   | 3              | 2023 年 07 月 01 日至 2023 年 09 月 30 日 | 43,623,935.04 | -            | 15,500,000.00 | 28,123,935.04 | 30.95% |
| 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、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、关于核准国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金募集的批复
- 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

二〇二三年十月二十五日