

国泰多资产增益先锋 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

2026 年中期报告

2026 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：江苏银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 04 月 09 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 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	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.8 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贵金属投资明细	48
7.9 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	48
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.11 本报告期投资基金情况	48
7.12 投资组合报告附注	50
8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51

8.2 盈利投资者数量占比	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	52
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	52
9 开放式基金份额变动	53
10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	54
10.8 其他重大事件	55
11 影响投资者决策的其他重要信息	55
12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰多资产增益先锋 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	
基金简称	国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）	
基金主代码	026570	
交易代码	026570	
基金运作方式	契约型开放式。 本基金对每份基金份额设置 3 个月的最短持有期限，在最短持有期限内该份基金份额不可赎回或转换转出。 对于每份基金份额，最短持有期限指自基金合同生效日（对认购份额而言）、基金份额申购确认日（对申购份额而言）或基金份额转换转入确认日（对转换转入份额而言）起至 3 个月后的月度对日的前一日（含该日）的期间。最短持有期限内基金份额持有人不可办理赎回或转换转出业务，最短持有期限届满后的下一个工作日起（含该日）可以办理赎回或转换转出业务。	
基金合同生效日	2026 年 4 月 9 日	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	江苏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,021,886.20 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）A	国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）C
下属分级基金的交易代码	026570	026571
报告期末下属分级基金的份额总额	10,001,883.14 份	20,003.06 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过资产配置及优选基金，在严格控制风险的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、资产配置策略；2、基金投资策略；3、股票投资策略；4、存托凭证投资策略；5、债券投资策略；6、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率*70%+中证港股通综合指数（港元）收益率*9%+MSCI 全球指数（MSCI All Country World Index）收益率*8%+上海黄金交易所 AU99.99 现货实盘合约价格收益率*8%+活期存款基准利率*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金（FOF），理论上其预期风险与预期收益水平高于货币市场基金、货币型基金中基金（FOF）、债券型基金和债券型基

	金中基金（FOF），低于股票型基金和股票型基金中基金（FOF）。 本基金投资港股通标的证券时，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国泰基金管理有限公司	江苏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	倪莹	田作全
	联系电话	021-31081600转	025-58588321
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tianzuoquan@jsbchina.cn
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	95319
传真		021-31081800	025-58588155
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室	南京市中华路26号
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦15-20层	南京市中华路26号
邮政编码		200082	210001
法定代表人		周向勇	袁军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金中期报告置备地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层和本基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国泰基金管理有限公司	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15 层-20 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 4 月 9 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日)	
	国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起	国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起 (FOF) C

	(FOF) A	
本期已实现收益	649,888.80	1,284.95
本期利润	1,599,761.29	3,183.77
加权平均基金份额本期利润	0.1599	0.1592
本期加权平均净值利润率	15.09%	15.02%
本期基金份额净值增长率	15.99%	15.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起 (FOF) A	国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起 (FOF) C
期末可供分配利润	649,888.80	1,284.95
期末可供分配基金份额利润	0.0650	0.0642
期末基金资产净值	11,601,644.43	23,186.83
期末基金份额净值	1.1599	1.1592
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起 (FOF) A	国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起 (FOF) C
基金份额累计净值增长率	15.99%	15.92%

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)本基金合同生效日为 2026 年 4 月 9 日，截至 2026 年 6 月 30 日运作未满一年。

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

国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自基金合同生效起至今	15.99%	1.67%	4.96%	1.06%	11.03%	0.61%

国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自基金合同生效起至今	15.92%	1.67%	4.96%	1.06%	10.96%	0.61%

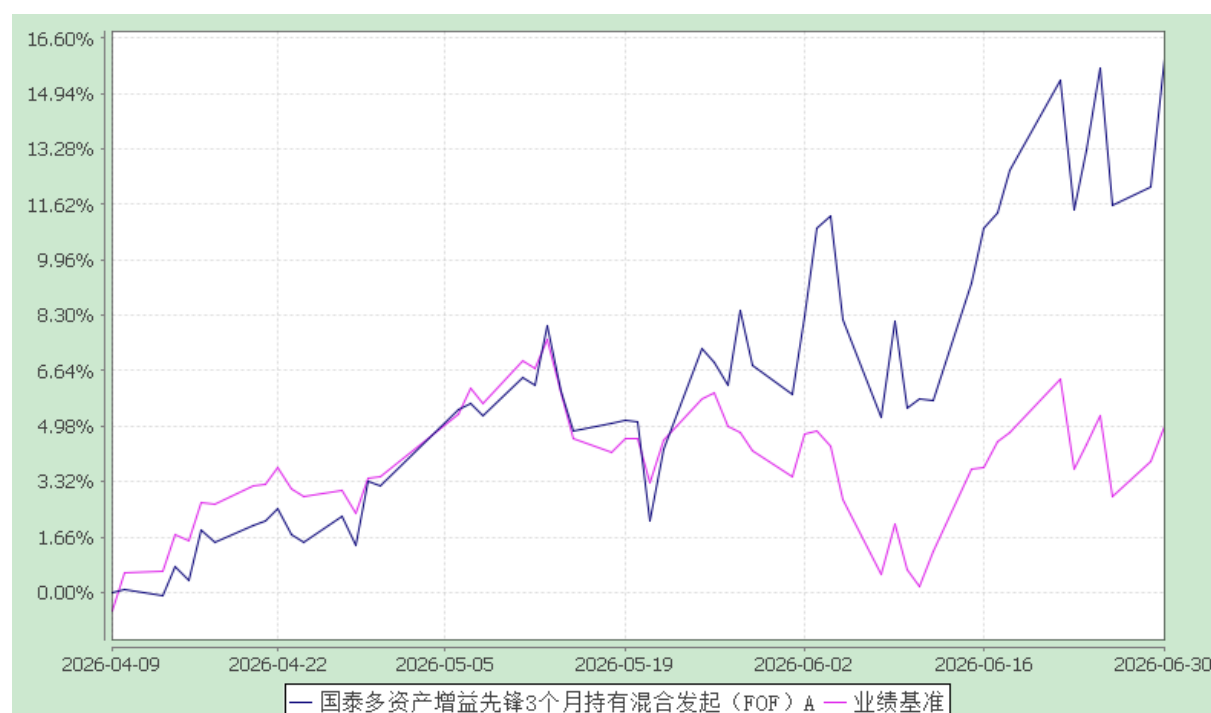
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰多资产增益先锋 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2026 年 4 月 9 日至 2026 年 6 月 30 日）

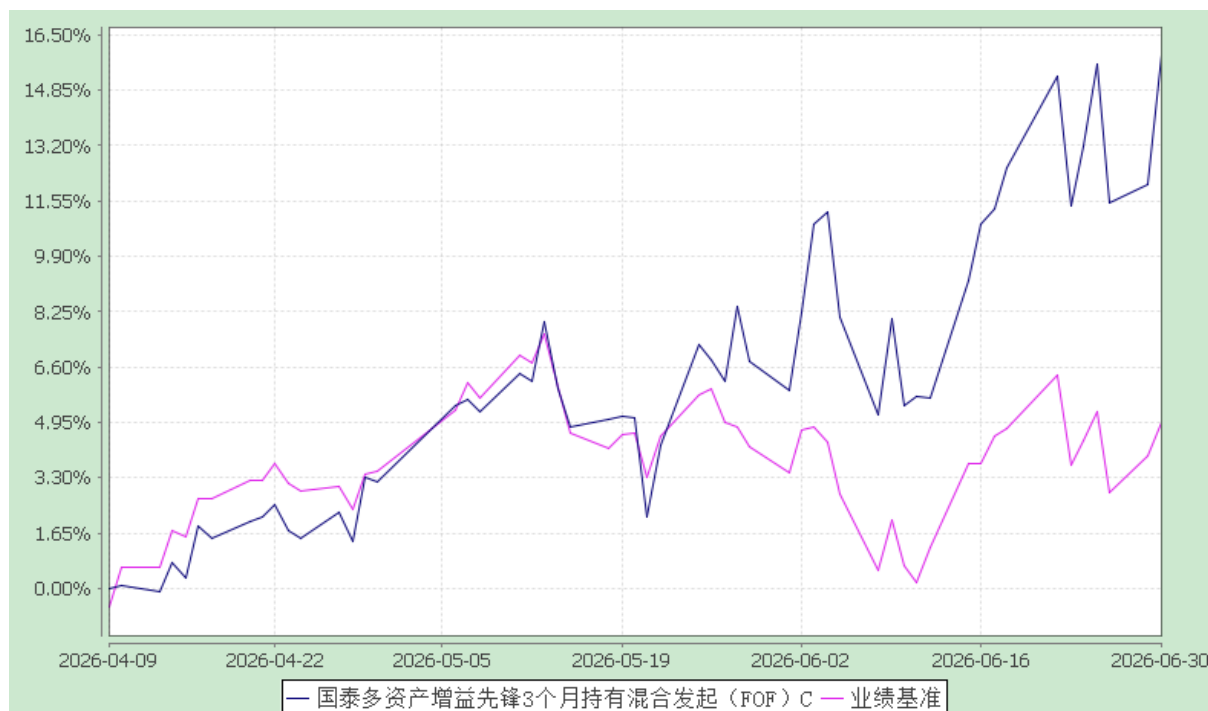
国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）A



注：（1）本基金合同生效日为 2026 年 4 月 9 日，截止至 2026 年 6 月 30 日，本基金运作时间未满一年；

（2）本基金的建仓期为 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在 6 个月建仓期结束时，确保各项资产配置比例符合合同约定。

国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）C



注：（1）本基金合同生效日为 2026 年 4 月 9 日，截止至 2026 年 6 月 30 日，本基金运作时间未满一年；

（2）本基金的建仓期为 6 个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在 6 个月建仓期结束时，确保各项资产配置比例符合合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 319 只公开募集证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘健琦	国泰稳健收益一年持有混合（FOF）、国泰优选领航一年持有期混合（FOF）、国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）的基金经理	2026-04-09	-	5 年	硕士研究生。2021 年 7 月加入国泰基金，历任助理研究员、研究员、基金经理助理。2025 年 11 月起任国泰稳健收益一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理，2026 年 1 月起兼任国泰优选领航一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理，2026 年 4 月起兼任国泰多资产增益先锋 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，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。

本报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）公司管理

的不同投资组合间向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下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% 的交易共 10 次，为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，本基金以科技成长为主线，优选部分周期和资源板块进行阶段性对冲。

海外算力方面，Anthropic 的 ARR 从 2 月的 140 亿美元飙升至 5 月的 470 亿美元。大模型收入爆发背后是模型能力的跃升，更长的上下文窗口、更强的 Agent 能力、更复杂的多模态推理，直接驱动算力需求的增长。另一方面，随着模型规模扩大，数据中心高速互联需求快速增长，光通信在 AI 基础设施投资中的占比持续提升。

国产算力方面，今年 2 月，中国 AI 大模型 Token 调用量首超美国，算力资源消耗持续快速上升，为本土算力创造持续性增量空间；政策方面，多部委“AI+制造”专项等最新政策明确要求国产大模型加速适配国产芯片；另一方面，华为韬（ τ ）定律通过系统级创新和优化，在成熟制程上实现等效先进性能，为国产算力产业链带来新的成长动力。

半导体设备方面，板块呈现出“国产替代加速、存储扩产驱动、设备出海打开空间”三重逻辑共振。国内主流存储厂商的大规模扩产释放了极强的设备采购需求，叠加部分海外设备产能紧张、交期拉长，国产设备在成熟工艺环节的替代率显著提升。

二季度本基金在海外算力方面维持超配，同时配置了国产算力和半导体设备板块；阶段性布局煤炭、有色金属等高景气度资源品板块来分散风险。本基金上半年超配 AI 算力板块，核心考量在于，美伊冲突引发全球能源价格剧烈波动，传统制造业面临显著的成本上升压力，而 AI 产业链凭借其业绩兑现的确定性，成为地缘扰动环境下相对确定的方向。

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 15.99%，同期业绩比较基准收益率为 4.96%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为 15.92%，同期业绩比较基准收益率为 4.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下阶段，我们倾向于均衡配置。

从产业趋势来看，我们持续看好全球人工智能的发展方向。AI 产业链正在经历从“模型驱动”向“基础设施效率提升”的阶段演变。随着开源模型能力提升以及模型调用成本下降，未来 AI 应用有望呈现更加多元化的发展路径，不同场景将通过模型路由、算力调度以及软硬件协同实现更高效率。云厂商凭借基础设施、客户入口和平台能力，有望在 AI 时代获得更强的算力资源整合能力和商业变现能力。

在 AI 基础设施领域，随着全球云厂商持续加大资本开支，算力集群规模不断扩大，数据中心互联架构也正在发生变化。以光互联为代表的新型高速连接技术，有望成为解决大规模 AI 集群通信瓶颈的重要方向。随着 AI 训练及推理规模持续扩大，网络带宽需求不断提升，光模块、先进封装以及高速互联产业链有望持续受益。

投资策略方面，下半年我们倾向于均衡配置，在关注长期产业趋势的基础上，积极寻找结构性投资机会。一方面，将通过 QDII 基金等方式配置海外优质资产，重点关注美股 AI 硬件以及云厂商；另一方面，结合国内产业链优势，重点关注 A 股光通信、半导体设备，以及港股互联网。除 AI 相关产业链外，我们也将关注基本面良好、供需格局持续改善的资源品行业。其中，有色金属板块具备中长期配置价值。以铜板块为例，供给侧面临矿山扰动和长期资本开支不足，需求侧受益于数据中心与配套电网建设以及能源转型，中长期供需格局仍偏紧；黄金板块上半年经历阶段性调整，下半年若全球货币政策出现边际变化，存在超跌修复机会，我们将积极把握相关机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

不适用。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人——江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金托管人——江苏银行股份有限公司未发现 (管理人公司名称) 公司在基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的定期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国泰多资产增益先锋 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
资产：		
货币资金	6.4.7.1	230,914.70
结算备付金		190,846.60
存出保证金		20,394.99
交易性金融资产	6.4.7.2	11,520,328.19
其中：股票投资		2,341,425.42
基金投资		8,470,918.20

债券投资		707,984.57
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收清算款		984,140.76
应收股利		850.08
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		12,947,475.32
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		600,156.18
应付清算款		659,152.67
应付赎回款		-
应付管理人报酬		6,969.79
应付托管费		1,808.85
应付销售服务费		5.40
应付投资顾问费		-
应交税费		17,054.15
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	37,497.02
负债合计		1,322,644.06
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	10,021,886.20
未分配利润	6.4.7.8	1,602,945.06
净资产合计		11,624,831.26
负债和净资产总计		12,947,475.32

注：1、报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 10,021,886.20 份，其中 A 类基金份额净值 1.1599 元，份额总额 10,001,883.14 份；C 类基金份额净值 1.1592 元，份额总额 20,003.06 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2026 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：国泰多资产增益先锋3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2026年4月9日（基金合同生效日）至2026年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026年4月9日（基金合同生效日）至2026 年6月30日
一、营业总收入		1,657,502.54
1.利息收入		2,073.84
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,073.84
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		703,657.39
其中：股票投资收益	6.4.7.10	117,753.72
基金投资收益	6.4.7.11	571,460.62
债券投资收益	6.4.7.12	683.62
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	13,759.43
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	951,771.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-
减：二、营业总支出		54,557.48
1. 管理人报酬		17,857.89
2. 托管费		4,767.18
3. 销售服务费		14.24
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		156.18
其中：卖出回购金融资产支出		156.18
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		1,914.63
8. 其他费用	6.4.7.18	29,847.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,602,945.06
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,602,945.06
五、其他综合收益的税后净额		-

六、综合收益总额		1,602,945.06
----------	--	--------------

注：本基金合同生效日为 2026 年 4 月 9 日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰多资产增益先锋 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2026 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	10,021,886.20	-	10,021,886.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	1,602,945.06	1,602,945.06
（一）、综合收益总额	-	1,602,945.06	1,602,945.06
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	10,021,886.20	1,602,945.06	11,624,831.26

注：本基金合同生效日为 2026 年 4 月 9 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：李昇，主管会计工作负责人：吴洪涛，会计机构负责人：张洁清

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰多资产增益先锋 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]2934 号《关于准予国泰多资产增益先锋 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)注册的批复》准予注册,由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰多资产增益先锋 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 10,020,049.80 元,业经立信会计师事务所(特殊普通合伙)信会师报字[2026]第 ZA31996 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰多资产增益先锋 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》于 2026 年 4 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 10,021,886.20 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,836.40 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为江苏银行股份有限公司。

根据《国泰多资产增益先锋 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》的有关规定,本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购基金份额时可以收取认购、申购费用,不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额称为 A 类基金份额;在投资人认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用,可以从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码,分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择认购、申购的基金份额类别。本基金不同类别基金份额之间如开通互相转换业务,相关约定见届时公告,无需召开基金份额持有人大会。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰多资产增益先锋 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(包括香港互认基金、QDII 基金、商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)、公开募集基础设施证券投资基金及其他经中国证监会核准或注册的基金)、股票(包括主板、创业板、科创板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、港股通标的证券(包括股票和 ETF)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券(含

分离交易可转债)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。基金的投资组合比例为:本基金投资于证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%,投资于股票(含存托凭证)、股票型基金(含股票指数基金)、偏股混合型基金的合计占基金资产的 60-95%,投资于港股通标的股票的比例不超过全部股票资产的 50%,投资于 QDII 基金和香港互认基金的比例合计不高于基金资产的 20%,投资于货币市场基金的比例不高于基金资产的 15%。本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。上述偏股混合型基金指满足下述条件之一的混合型基金:(1)基金合同约定股票资产投资比例应不低于基金资产的 60%;(2)最近四个季度中任意一个季度定期报告披露的股票资产投资比例均不低于基金资产的 60%。本基金的业绩比较基准为:中证 A500 指数收益率×70%+中证港股通综合指数(港元)收益率×9%+MSCI 全球指数(MSCI All Country World Index)收益率×8%+上海黄金交易所 AU99.99 现货实盘合约价格收益率×8%+活期存款基准利率×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2026 年 8 月 27 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 04 月 09 日(基金合同生效日)至 2026 年 06 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 04 月 09 日(基金合同生效日)至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 04 月 9 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购

和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计

算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、基金投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

(4) 对于基金投资，根据中基协发[2017]3 号《关于发布<基金中基金估值业务指引(试行)>的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》，按采用如下方法估值：

(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

(b) 对于境内上市开放式基金(LOF)及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

(c) 对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份(百份)收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益；

(d) 对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：

(a) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值；

(b) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值；

(c) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据中华人民共和国主席令第 41 号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(2) 自 2025 年 8 月 8 日起，对基金取得的在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税；对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(3) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(4) 对于内地投资者持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用

20%的税率计征个人所得税。

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别，对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向该内地基金分配利息时按照 7%的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照 10%的税率代扣代缴所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(5) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(6) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	230,914.70
等于：本金	230,842.32
加：应计利息	72.38
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	230,914.70

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,951,679.27	-	2,341,425.42	389,746.15
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	700,524.20	7,644.57	707,984.57	-184.20
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	700,524.20	7,644.57	707,984.57	-184.20
资产支持证券		-	-	-	-
基金		7,893,223.53	-	8,470,918.20	577,694.67
其他		-	-	-	-
合计		10,545,427.00	7,644.57	11,520,328.19	967,256.62

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	7,654.37
其中：交易所市场	7,654.37
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	29,842.65
合计	37,497.02

6.4.7.7 实收基金

国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年4月9日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	10,001,883.14	10,001,883.14
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	10,001,883.14	10,001,883.14

国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年4月9日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	20,003.06	20,003.06
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	20,003.06	20,003.06

6.4.7.8 未分配利润

国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	649,888.80	949,872.49	1,599,761.29
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	649,888.80	949,872.49	1,599,761.29

国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,284.95	1,898.82	3,183.77
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,284.95	1,898.82	3,183.77

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,947.71
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	98.94
其他	27.19
合计	2,073.84

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	7,324,136.69
减：卖出股票成本总额	7,192,113.11
减：交易费用	14,269.86
买卖股票差价收入	117,753.72

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	52,892,749.42
减：卖出/赎回基金成本总额	52,293,727.01
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	15,946.70
减：交易费用	11,615.09
基金投资收益	571,460.62

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月9日（基金合同生效日）至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	943.42
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-259.80
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	683.62

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月9日（基金合同生效日）至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	406,411.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	401,809.80
减：应计利息总额	4,861.70
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-259.80

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月9日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	13,759.43
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	13,759.43

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年4月9日（基金合同生效日）至2026年6月30日
1.交易性金融资产	967,256.62
——股票投资	389,746.15
——债券投资	-184.20
——资产支持证券投资	-
——基金投资	577,694.67
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	15,485.31
合计	951,771.31

6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.17 持有基金产生的费用

项目	本期 2026 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	757.34
当期持有基金产生的应支付管理费	7,918.72

（元）	
当期持有基金产生的应支付托管费 （元）	1,542.93
当期交易基金产生的交易费（元）	4,322.35
当期交易基金产生的转换费（元）	3,124.36

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月9日（基金合同生效日）至2026年6月30日
审计费用	1,865.01
信息披露费	27,977.64
证券出借违约金	-
深港通证券组合费	4.71
合计	29,847.36

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
国泰基金管理有限公司旗下基金	与本基金受同一基金管理人管理
国泰全球投资管理有限公司	基金管理人的控股子公司
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
国网英大国际控股集团有限公司	基金管理人的股东
江苏银行股份有限公司（“江苏银行”）	基金托管人、基金销售机构
意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)	基金管理人的股东
中国建银投资有限责任公司(“中国建投”)	基金管理人的控股股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月9日（基金合同生效日）至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	17,857.89
其中：应支付销售机构的客户维护费	23.51
应支付基金管理人的净管理费	17,834.38

注：1.本基金基金财产中投资于本基金管理人管理的基金的部分不收取管理费，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中本基金管理人管理的基金份额所对应的资产净值后剩余部分(若为负数，则取 0)的 1.00%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=(前一日基金资产净值-基金财产中本基金管理人管理的基金份额所对应的资产净值)×1.00%/当年天数。

2.本基金本报告期因投资于基金管理人所管理的其他基金而已在管理费计算基数中扣除部分对应的管理费金额为 6,042.97 元。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月9日（基金合同生效日）至2026年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,767.18

注：1.本基金基金财产中投资于本基金托管人托管的基金的部分不收取托管费，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中本基金托管人托管的基金份额所对应的资产净值后剩余部分(若为负数，则取 0)的 0.20%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=(前一日基金资产净值-基金财产中本基金托管人托管的基金份额所对应的资产净值)×0.20%/当年天数。

2.本基金本报告期因投资于基金托管人所托管的其他基金而已在托管费计算基数中扣除部分对应的托管费金额为 0.00 元。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年4月9日（基金合同生效日）至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）A	国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）C	合计
江苏银行	-	14.24	14.24
合计	-	14.24	14.24

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日各类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提。对于投资者通过直销机构认购、申购的 C 类基金份额计提的销售服务费，或者通过其他销售机构认购、申购且持续持有期限超过一年(即 365 天,下同)的 C 类基金份额继续计提的销售服务费，都将在投资者赎回、转出相应基金份额或基金合同终止时随赎回款(或清算款)一并返还给投资者。对于投资者持续持有期限未超过一年的 C 类基金份额，计提的销售服务费逐日累计至每月月末，按月支付给国泰基金管理有限公司，再由国泰基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.30%。其计算公式为：

日销售服务费=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026年4月9日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	国泰多资产增益先锋3个月持有混合发起（FOF）A	国泰多资产增益先锋3个月持有混合发起（FOF）C
基金合同生效日（2026 年 4 月 9 日）持有的基金份额	10,001,833.33	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-

减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,001,833.33	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	99.80%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年4月9日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
江苏银行	230,914.70	1,947.71

注：本基金的银行活期存款由基金托管人江苏银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有基金管理人国泰基金管理有限公司所管理的公开募集证券投资基金合计 2,363,059.58 元，占本基金资产净值比例为 20.33%。

6.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期 2026 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
当期交易基金产生的申购费（元）		-
当期交易基金产生的赎回费（元）		-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）		-
当期持有基金产生的应支付管		2,689.51

理费（元）	
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	556.92
当期交易基金产生的交易费（元）	1,460.36

注：本基金申购、赎回本基金的基金管理人管理的其他基金(ETF 除外)，应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费(按规定应当收取并记入被投资基金其他收入部分的赎回费除外)、销售服务费等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，故当期交易基金产生的申购费和当期交易基金产生的赎回费为零。相关销售服务费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，由基金管理人从被投资基金收取后向本基金返还，当期持有基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 600,156.18 元，于 2026 年 7 月 1 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算

为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金中基金（FOF），理论上其预期风险与预期收益水平高于货币市场基金、货币型基金中基金（FOF）、债券型基金和债券型基金中基金（FOF），低于股票型基金和股票型基金中基金（FOF）。本基金投资港股通标的证券时，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的投资目标是通过资产配置及优选基金，在严格控制风险的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人江苏银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，在场外申赎基金份额

均通过该基金的基金管理人的直销柜台办理，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于锁定期届满后要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人自基金合同生效日满 3 个月起对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2026 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 600,156.18 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。于开放期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、债券投资、存出保证金及结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
------------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
货币资金	230,914.70	-	-	-	230,914.70
结算备付金	190,846.60	-	-	-	190,846.60
存出保证金	20,394.99	-	-	-	20,394.99
交易性金融资产	707,984.57	-	-	10,812,343.62	11,520,328.19
应收清算款	-	-	-	984,140.76	984,140.76
应收股利	-	-	-	850.08	850.08
资产总计	1,150,140.86	-	-	11,797,334.46	12,947,475.32
负债					
卖出回购金融资 产款	600,156.18	-	-	-	600,156.18
应付清算款	-	-	-	659,152.67	659,152.67
应付管理人报酬	-	-	-	6,969.79	6,969.79
应付托管费	-	-	-	1,808.85	1,808.85
应付销售服务费	-	-	-	5.40	5.40
应交税费	-	-	-	17,054.15	17,054.15
其他负债	-	-	-	37,497.02	37,497.02
负债总计	600,156.18	-	-	722,487.88	1,322,644.0
					6
利率敏感度缺口	549,984.68	-	-	11,074,846.58	11,624,831.26

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 6.09%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日
----	-------------------

	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
应收股利	-	850.08	850.08
资产合计	-	850.08	850.08
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞口净额	-	850.08	850.08

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末
		2026 年 6 月 30 日
	港币相对人民币升值 5%	增加约 42.50
	港币相对人民币贬值 5%	减少约 42.50

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	2,341,425.42	20.14
交易性金融资产—基金投资	8,470,918.20	72.87
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	10,812,343.62	93.01

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金净资产的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	10,812,343.62
第二层次	707,984.57
第三层次	-
合计	11,520,328.19

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,341,425.42	18.08
	其中：股票	2,341,425.42	18.08
2	基金投资	8,470,918.20	65.43
3	固定收益投资	707,984.57	5.47
	其中：债券	707,984.57	5.47
	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	421,761.30	3.26
8	其他各项资产	1,005,385.83	7.77
9	合计	12,947,475.32	100.00

7.2 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	33,792.00	0.29
C	制造业	1,978,950.12	17.02
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	328,683.30	2.83
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,341,425.42	20.14

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	840	509,880.00	4.39
2	688498	源杰科技	200	377,200.00	3.24
3	688256	寒武纪	206	328,683.30	2.83
4	600183	生益科技	700	121,380.00	1.04
5	688981	中芯国际	748	118,797.36	1.02
6	000962	东方钨业	1,200	108,720.00	0.94
7	002475	立讯精密	1,500	105,600.00	0.91
8	688220	翱捷科技	695	86,402.40	0.74
9	603986	兆易创新	100	81,500.00	0.70
10	600961	株冶集团	2,100	68,019.00	0.59
11	300489	光智科技	200	62,390.00	0.54
12	600888	新疆众和	3,800	60,382.00	0.52

13	688786	悦安新材	1,192	54,927.36	0.47
14	300570	太辰光	200	49,342.00	0.42
15	001389	广合科技	200	47,450.00	0.41
16	002463	沪电股份	300	45,840.00	0.39
17	600362	江西铜业	1,000	43,300.00	0.37
18	300620	光库科技	100	37,820.00	0.33
19	601101	昊华能源	3,200	33,792.00	0.29

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	01171	兖矿能源	669,212.05	5.76
2	601918	新集能源	443,074.00	3.81
3	601899	紫金矿业	418,963.00	3.60
4	000807	云铝股份	355,467.00	3.06
5	300502	新易盛	325,706.00	2.80
6	688498	源杰科技	313,629.87	2.70
7	002281	光迅科技	312,781.00	2.69
8	603271	永杰新材	302,625.00	2.60
9	000792	盐湖股份	293,822.00	2.53
10	688256	寒武纪	263,259.82	2.26
11	00883	中国海洋石油	261,605.65	2.25
12	600988	赤峰黄金	259,919.00	2.24
13	300394	天孚通信	239,111.00	2.06
14	002128	电投能源	200,346.00	1.72
15	601101	昊华能源	199,567.00	1.72
16	600188	兖矿能源	199,500.00	1.72
17	300835	龙磁科技	190,769.00	1.64
18	688676	金盘科技	157,962.05	1.36
19	301526	国际复材	156,192.00	1.34
20	688456	有研粉材	139,127.97	1.20

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	--------------------

1	01171	兖矿能源	644,304.54	5.54
2	601918	新集能源	451,936.00	3.89
3	601899	紫金矿业	387,082.00	3.33
4	301526	国际复材	315,598.00	2.71
5	000807	云铝股份	308,606.00	2.65
6	002281	光迅科技	303,112.00	2.61
7	300394	天孚通信	292,798.00	2.52
8	000792	盐湖股份	281,669.00	2.42
9	603271	永杰新材	267,735.00	2.30
10	300835	龙磁科技	259,842.00	2.24
11	00883	中国海洋石油	258,825.55	2.23
12	600988	赤峰黄金	218,644.00	1.88
13	688456	有研粉材	215,461.10	1.85
14	600188	兖矿能源	201,070.00	1.73
15	002128	电投能源	182,113.00	1.57
16	688676	金盘科技	167,035.14	1.44
17	601101	昊华能源	149,046.00	1.28
18	00826	天工国际	125,795.64	1.08
19	300483	首华燃气	125,071.00	1.08
20	600578	京能电力	123,621.00	1.06

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	9,143,792.38
卖出股票的收入（成交）总额	7,324,136.69

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	707,984.57	6.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	707,984.57	6.09

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019792	25 国债 19	4,000	404,196.93	3.48
2	019785	25 国债 13	3,000	303,787.64	2.61

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 本报告期投资基金情况

7.11.1 投资政策及风险说明

本基金为混合型基金中基金（FOF），投资于证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票（含存托凭证）、股票型基金（含股票指数基金）、偏股混合型基金的合计占基金资产的

60-95%，投资于 QDII 基金和香港互认基金的比例合计不高于基金资产的 20%，投资于货币市场基金的比例不高于基金资产的 15%。

对于被动型基金，本基金将综合考虑基金的标的指数、运作时间、流动性、基金规模、跟踪误差以及费率水平等指标，筛选出合适的标的纳入备选基金池。对于主动型基金，本基金将利用基金管理人自主创建的基金数据库作为基金分析平台，重点考察基金经理投资风格、投资业绩、持仓结构、基金的收益来源、基金的流动性特征、基金的风险收益特征（如波动率、夏普值、最大回撤、信息比率等）等，并结合对基金经理的调研进行交叉验证，筛选出风格清晰、中长期收益良好、业绩波动性较低的基金纳入备选基金池。在大类资产配置比例的基础上，在各资产类别内，基金管理人将综合考虑投资性价比、投资便利度等，确定基金的投资比例以及投资类型，构建基金投资组合，同时结合市场行情等对基金投资组合进行动态调整，以实现基金投资组合的优化。

本基金是基金中基金，通过分析中国乃至全球宏观基本面的变化以及货币政策、财政政策的走向，对境内外股票、债券、商品、货币等多类资产的市场变化趋势做出判断，并结合每类资产的风险收益特征等，确定和构造合适的资产配置比例。因此境内外股票、债券、商品、货币等大类资产的变化将影响到本基金及所投资基金的业绩表现。本基金管理人将发挥专业研究优势，持续优化组合配置，以控制特定风险。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金，基金份额净值会由于所持基金份额净值的波动而波动，所持基金面临的风险也将直接或间接成为本基金的风险。

7.11.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例(%)	是否属于基金 管理人及管理 人关联方所管 理的基金
1	515050	通信 ETF 华夏	契约型开 放式	932,664.0 0	1,302,931. 61	11.21%	否
2	515880	通信 ETF 国泰	契约型开 放式	638,100.0 0	1,146,027. 60	9.86%	是
3	159732	消费电子 ETF 华夏	契约型开 放式	582,500.0 0	1,118,400. 00	9.62%	否
4	159558	半导体设 备 ETF 易 方达	契约型开 放式	187,135.0 0	869,242.0 8	7.48%	否
5	021842	国富全球 科技互联 混合	契约型开 放式	89,348.69	747,893.2 1	6.43%	否

		(QDII)人 民币 C					
6	159338	中证 A500ETF 国泰	契约型开 放式	540,600.0 0	726,566.4 0	6.25%	是
7	159994	通信 ETF 银华	契约型开 放式	410,900.0 0	701,817.2 0	6.04%	否
8	020352	国富沪深 300 指数 增强 C	契约型开 放式	350,162.1 8	685,967.7 1	5.90%	否
9	159516	半导体设 备 ETF 国 泰	契约型开 放式	248,337.0 0	490,465.5 8	4.22%	是
10	588200	科创板芯 片 ETF 嘉 实	契约型开 放式	47,100.00	232,485.6 0	2.00%	否
11	008984	财通科技 创新混合 C	契约型开 放式	93,440.29	228,601.6 7	1.97%	否
12	007350	华夏科技 创新混合 C	契约型开 放式	43,190.33	161,147.4 4	1.39%	否
13	159530	机器人 ETF 易方 达	契约型开 放式	36,900.00	59,372.10	0.51%	否

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，易方达基金管理有限公司、华夏基金管理有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。

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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	20,394.99
2	应收清算款	984,140.76

3	应收股利	850.08
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,005,385.83

7.12.4 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。

7.12.5 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）A	2	5,000,941.57	10,001,833.33	100.00%	49.81	0.00%
国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）	1	20,003.06	-	0.00%	20,003.06	100.00%

C						
合计	3	3,340,628.7 3	10,001,833.33	99.80%	20,052.87	0.20%

8.2 盈利投资者数量占比

本基金不适用。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）A	0.00	0.00%
	国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）C	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）A	0
	国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）A	0
	国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）C	0
	合计	0

8.5 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	10,001,833.3 3	99.80%	10,001,833.3 3	99.80%	3 年

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,833.3 3	99.80%	10,001,833.3 3	99.80%	-

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）A	国泰多资产增益先锋 3 个月持有混合发起（FOF）C
基金合同生效日（2026 年 4 月 9 日）基金份额总额	10,001,883.14	20,003.06
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,001,883.14	20,003.06

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2026 年 5 月 9 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第八届董事会第四十三次会议审议通过，吴洪涛先生任公司首席信息官。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为立信会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人未受调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人相关从业人员未受调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	16,467,929.07	100.00%	7,654.37	100.00%	-

注：1、交易单元的选择标准：

- （1）实力雄厚、信誉良好；
- （2）财务状况良好，经营行为稳健、规范，合规风控能力较强；
- （3）具备基金交易所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司管理的基金进行证券交易的需要；
- （4）研究实力较强，能及时为本公司管理的基金提供高质量服务，包括但不限于各类研究分析报告、上市公司路演及反路演、各类研究策略会等。

2、选择程序：

券商按照我司要求提供机构情况介绍说明，该说明作为券商尽调材料进行内部审议，符合要求的券商经批准进入券商白名单，白名单内的券商根据其提供的研究服务情况进行考评，符合交易席位租用标准的，经审批后可成为我司签约券商并签订交易业务单元租用协议。

3、本基金本报告期内所有席位均为新增。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券	1,520,299.97	100.00 %	600,000.00	100.00 %	-	-	108,052,447.58	100.00 %

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰多资产增益先锋 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同生效公告	《证券时报》	2026-04-10
2	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2026-05-09

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	2026 年 04 月 09 日至 2026 年 06 月 30 日	10,001,833.33	-	-	10,001,833.33	99.80%
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。							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰多资产增益先锋 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）注册的批复
- 2、国泰多资产增益先锋 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同
- 3、国泰多资产增益先锋 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议

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

12.2 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 15-20 层。

基金托管人住所。

12.3 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

二〇二六年八月三十一日