

国泰量化策略收益混合型证券投资基金
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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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。

根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定，为更好地反映基金投资风格，提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，经与基金托管人协商一致，本基金管理人决定自 2026 年 7 月 27 日起调整本基金的业绩比较基准，并对基金合同等法律文件有关条款进行修订。修订后的基金合同、托管协议自 2026 年 7 月 27 日起生效。具体可查阅本基金管理人于 2026 年 6 月 27 日发布的《国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》。

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 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	5
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合规守信情况的说明	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	11
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	12
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52
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	53
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	53
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.11 投资组合报告附注	53
8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 盈利投资者数量占比	54

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
9 开放式基金份额变动	55
10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
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	56
10.8 其他重大事件	57
11 影响投资者决策的其他重要信息	58
12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰量化策略收益混合型证券投资基金	
基金简称	国泰量化策略收益混合	
基金主代码	000199	
交易代码	000199	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 12 月 27 日	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	275,834,251.03 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰量化策略收益混合 A	国泰量化策略收益混合 C
下属分级基金的交易代码	000199	015582
报告期末下属分级基金的份额总额	151,778,091.85 份	124,056,159.18 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化多因子选股策略和基本面研究精选个股，在严格控制风险的前提下，力争实现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、股票投资策略； 3、存托凭证投资策略； 4、债券投资策略； 5、权证投资策略； 6、资产支持证券投资策略； 7、中小企业私募债投资策略； 8、股指期货投资策略； 9、股票期权投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中等预期风险和预期收益的产品。本基金将投资港股通标的股票，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	倪莹	王小飞
	联系电话	021-31081600转	021-60637103
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com

客户服务电话	(021) 31089000, 400-888-8688	021-60637228
传真	021-31081800	021-60635778
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码	200082	100033
法定代表人	周向勇	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	国泰量化策略收益混合 A	国泰量化策略收益混合 C
本期已实现收益	36,917,090.01	21,122,028.95
本期利润	59,223,416.79	34,675,023.20
加权平均基金份额本期利润	0.4053	0.3962
本期加权平均净值利润率	21.49%	21.52%
本期基金份额净值增长率	23.27%	22.92%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	国泰量化策略收益混合 A	国泰量化策略收益混合 C
期末可供分配利润	146,641,832.72	93,552,283.35
期末可供分配基金份额利润	0.9662	0.7541
期末基金资产净值	324,810,191.87	257,708,571.21

期末基金份额净值	2.1400	2.0774
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	国泰量化策略收益混合 A	国泰量化策略收益混合 C
基金份额累计净值增长率	143.04%	60.96%

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 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

国泰量化策略收益混合 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
过去三个月	22.26%	1.32%	9.22%	0.94%	13.04%	0.38%
过去六个月	23.27%	1.29%	6.29%	0.85%	16.98%	0.44%
过去一年	47.05%	1.06%	20.06%	0.76%	26.99%	0.30%
过去三年	68.23%	1.08%	26.36%	0.83%	41.87%	0.25%
过去五年	22.27%	1.09%	3.22%	0.83%	19.05%	0.26%
过去七年	96.89%	1.13%	33.94%	0.87%	62.95%	0.26%
自基金合同生效起至今	143.04%	1.14%	61.96%	0.89%	81.08%	0.25%

国泰量化策略收益混合 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
过去三个月	22.09%	1.32%	9.22%	0.94%	12.87%	0.38%
过去六个月	22.92%	1.29%	6.29%	0.85%	16.63%	0.44%
过去一年	46.18%	1.06%	20.06%	0.76%	26.12%	0.30%
过去三年	64.39%	1.08%	26.36%	0.83%	38.03%	0.25%
自新增 C 类份额起至今	60.96%	1.05%	24.47%	0.81%	36.49%	0.24%

3.2.2 自基金转型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

国泰量化策略收益混合型证券投资基金

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

（2018 年 12 月 27 日至 2026 年 6 月 30 日）

国泰量化策略收益混合 A



注：本基金合同生效日为 2018 年 12 月 27 日，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。

国泰量化策略收益混合 C



注：本基金合同生效日为 2018 年 12 月 27 日，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 2022 年 5 月 18 日起，本基金增加 C 类份额并分别设置对应的基金代码。

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		
高崇南	国泰量化策略收益混合、国泰红利智选混合的基金经理	2018-12-27	-	16 年	博士研究生。2010 年 1 月至 2012 年 10 月在中投证券衍生品部任高级经理，2012 年 10 月至 2015 年 3 月在申万宏源证券权益投资部任高级投资经理，2015 年 3 月至 2018 年 6 月在光大永明资管权益投资部任执行总经理，2018 年 6 月加入国泰基金。2018 年 9 月至 2018 年 12 月任国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 12 月起任国泰量化策略收益混合型证券投资基金（由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来）的基金经理，2021 年 8 月至 2025 年 3 月任国泰民裕进取灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2022 年 3 月至 2023 年 3 月任国泰量化成长优选混合

					型证券投资基金的基金经理,2024 年 5 月至 2024 年 12 月任国泰诚益混合型证券投资基金的基金经理, 2024 年 6 月至 2025 年 12 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, 2025 年 9 月起兼任国泰红利智选混合型证券投资基金的基金经理。
贺天元	国泰量化策略收益混合、国泰价值领航股票的基金经理	2022-05-06	-	10 年	硕士研究生。曾任职于光大永明资产管理股份有限公司, 2018 年 7 月加入国泰基金, 历任研究员、投资经理。2022 年 5 月起任国泰量化策略收益混合型证券投资基金的基金经理, 2026 年 7 月起兼任国泰价值领航股票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《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 年上半年上证综指涨 3.16%，沪深 300 涨 7.55%，创业板指涨 35.58%。上半年行情全面处于 risk-on 模式，即使在伊朗冲突期间也未给市场带来较大回撤，以 AI 应用和半导体为内核的硬科技逻辑引领市场，资金向最具备确定性和产业爆发力的科技行业集中，而缺乏业绩支撑或处于传统周期的行业则面临了较长时间的流动性折价，商贸零售、农林牧渔、钢铁等传统行业跌幅均超过 20%，消费与房地产产业链成了明显的资金流出效应。

从最近的数据看经济温和向好。二季度我国 GDP 同比较一季度回落 0.7 个百分点至 4.3%，上半年 GDP 同比增长 4.7%，处于全年目标区间内。预计三季度高技术制造业、出口及政策支持仍是主要支撑。上半年规模以上工业增加值同比增长 5.4%。高技术产业和装备制造业增加值分别增长 13.3% 和 9.3%，仍是工业增长主要支撑。上半年社会消费品零售总额同比增长 1.3%，服务零售额增长 5.3%，服务明显快于商品零售。但汽车消费偏弱、地产后周期品类承压，消费修复仍依赖居民信心改善和新的消费场景、消费业态的培育。

本基金用多维度评估股票质地，使用估值、成长、盈利、市场情绪类因子选择股票，取得了较好的超额收益。

本基金量化模型仅用于资产配置、选股和组合优化等，不基于量化模型进行高频程序化交易。

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 23.27%，同期业绩比较基准收益率为 6.29%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为 22.92%，同期业绩比较基准收益率为 6.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

AI 对行情的引领效应非常显著。AI 行情已步入去伪存真阶段，未来持续性将严格取决于下游应用的盈利能力与资金利用效率。长期乐观派认为 AI 是媲美互联网的产业革命。当前的资本开支由科

技巨头雄厚的现金流和净利润支撑，与当年互联网泡沫有本质不同。AI 带来的降本增效正向各行业扩散，是驱动经济增长的核心新质生产力。中期审慎派则担忧“资本回报陷阱”。他们指出 AI 正从高毛利的软件模式转向重资产的基础设施模式，硬件迭代极快。一旦下游应用变现不及预期，巨额的资本开支可能面临资产减值计提风险，引发投资萧条。观点对立会引发市场从单向发展到双向波动。

中国经济整体稳健，接下来的收益来源一方面是成长风格的持续，另一方面国内消费政策、反内卷政策也带来相关行业的底部反转机会。从基本面角度看如下一些策略线索能够应对可能的投资机会：1) 红利低波类策略，高分红股票是权益资产中的债券，每年提供稳健的股息分红，价值策略会持续有效。2) PB-ROE 类策略，合理的估值能够抵御下行风险，在合理估值中寻找有成长性的股票，向下空间小，向上有戴维斯双击的机会，也能够受益于促销费政策和供给侧改革政策。3) 超预期策略、科技成长策略，从多个角度捕捉成长股的赚钱逻辑，在 beta 和 alpha 两方面发力，获得有较高风险收益比的 alpha+beta 收益。4) 底部反转策略，从基本面、股价长期底部震荡的行业中，选取预期逐渐转好、有政策、供需催化的优质公司，能够捕捉业绩、估值双击的机会。

本基金将坚持多因子量化选股策略，从估值、成长、质量、市场行为和技术类五类因子综合股票质地，精选并持有公司质量优异，增速稳健，估值占优的股票形成组合并持有。注重市场行为因子、提高信息传导效率带来的超额收益。在挖掘因子收益的同时，本基金会关注组合风险，控制风格与行业偏离度，为投资者创造合理的最大价值。

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

无。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

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：国泰量化策略收益混合型证券投资基金

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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	68,779,500.74	16,712,938.74
结算备付金		7,334,352.13	6,593,879.74
存出保证金		105,531.93	265,906.77
交易性金融资产	6.4.7.2	506,431,601.08	369,480,049.19
其中：股票投资		492,269,776.42	354,348,597.68
基金投资		-	-
债券投资		14,161,824.66	15,131,451.51
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		81,710.34	-
应收股利		-	-
应收申购款		867,474.50	9,257.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		583,600,170.72	393,062,032.42
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 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		-	-
应付清算款		-	3,604.09
应付赎回款		96,491.87	4,857,405.74
应付管理人报酬		499,266.06	410,236.22
应付托管费		83,211.04	68,372.72
应付销售服务费		101,467.17	70,409.22
应付投资顾问费		-	-
应交税费		259.06	2,931.03
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	300,712.44	359,932.03
负债合计		1,081,407.64	5,772,891.05
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	252,296,605.40	202,588,745.26
未分配利润	6.4.7.8	330,222,157.68	184,700,396.11
净资产合计		582,518,763.08	387,289,141.37
负债和净资产总计		583,600,170.72	393,062,032.42

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 275,834,251.03 份，其中 A 类基金份额净值 2.1400 元，份额总额 151,778,091.85 份；C 类基金份额净值 2.0774 元，份额总额 124,056,159.18 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰量化策略收益混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至
----	-----	-----------------------	----------------------------

		2026 年 6 月 30 日	2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		97,484,513.02	14,797,042.92
1.利息收入		85,271.32	35,499.05
其中：存款利息收入	6.4.7.9	85,271.32	35,499.05
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）		61,465,898.26	18,510,490.03
其中：股票投资收益	6.4.7.10	58,241,641.55	15,829,330.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	99,381.51	33,953.75
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	95,709.20	-
股利收益	6.4.7.13	3,029,166.00	2,647,206.15
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	35,859,321.03	-3,786,731.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	74,022.41	37,785.38
减：二、营业总支出		3,586,073.03	1,498,569.20
1. 管理人报酬		2,589,224.58	1,177,427.93
2. 托管费		431,537.51	196,238.04
3. 销售服务费		476,546.09	34,175.67
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		491.99	0.05
8. 其他费用	6.4.7.16	88,272.86	90,727.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		93,898,439.99	13,298,473.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		93,898,439.99	13,298,473.72
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		93,898,439.99	13,298,473.72

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰量化策略收益混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 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	202,588,745.26	184,700,396.11	387,289,141.37
二、本期期初净资产	202,588,745.26	184,700,396.11	387,289,141.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	49,707,860.14	145,521,761.57	195,229,621.71
（一）、综合收益总额	-	93,898,439.99	93,898,439.99
（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）	49,707,860.14	51,623,321.58	101,331,181.72
其中：1.基金申购款	102,191,562.32	98,085,388.86	200,276,951.18
2.基金赎回款	-52,483,702.18	-46,462,067.28	-98,945,769.46
（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	252,296,605.40	330,222,157.68	582,518,763.08
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	152,880,451.83	80,299,834.31	233,180,286.14
二、本期期初净资产	152,880,451.83	80,299,834.31	233,180,286.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-22,428,714.78	2,578,082.35	-19,850,632.43
（一）、综合收益总额	-	13,298,473.72	13,298,473.72
（二）、本期基金	-22,428,714.78	-10,720,391.37	-33,149,106.15

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	63,508,160.50	30,229,606.24	93,737,766.74
2.基金赎回款	-85,936,875.28	-40,949,997.61	-126,886,872.89
（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	130,451,737.05	82,877,916.66	213,329,653.71

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

国泰量化策略收益混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据经持有人大会表决通过的《关于修改国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同相关事项的议案》以及相关法律法规的相关规定，由原国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。原基金由原国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更而来。根据《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》的约定以及原基金的基金管理人发布的《关于国泰目标收益保本混合型证券投资基金保本提前到期处理规则及变更为国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的公告》，截止 2014 年 12 月 12 日止，国泰目标收益保本混合型证券投资基金的基金份额累计净值收益率已连续 15 个工作日达到或超过首个保本期的预设目标收益率 15%，触发提前到期条款，国泰目标收益保本混合型证券投资基金首个保本期提前到期，保本期到期日为 2014 年 12 月 29 日。首个保本期提前到期后进入过渡期，过渡期为 2014 年 12 月 30 日至 2015 年 1 月 15 日。过渡期结束后的下一日起，国泰目标收益保本混合型证券投资基金变更为“国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金”。自 2015 年 1 月 16 日起，修订后的《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，《国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同》自同一起失效。本基金存续期限不定，原国泰目标收益保本混合

型证券投资基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 76,067,182.62 元，已于原基金的基金合同生效日全部转为原基金的基金资产净值，2015 年 1 月 16 日原基金折算前的基金份额净值为 1.183 元，精确到小数点后 9 位为 1.183489886。原基金管理人按照 1: 1.183489886 的折算比例将 2015 年 1 月 16 日登记在册的原基金份额进行了折算。折算后当日，基金份额净值调整为 1.0000 元，相应地，折算前每 1 份基金份额将折算为 1.183489886 份。

根据《修改国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同相关事项的议案》以及相关法律法规的定，经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，基金管理人已将《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金托管协议》分别修订为《国泰量化策略收益混合型证券投资基金基金合同》、《国泰量化策略收益混合型证券投资基金托管协议》，并据此编制《国泰量化策略收益混合型证券投资基金招募说明书》。本基金已经中国证监会许可[2018]1354 号(《关于准予国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》)准予变更注册。修改后的《国泰量化策略收益混合型证券投资基金基金合同》、《国泰量化策略收益混合型证券投资基金托管协议》自 2018 年 12 月 27 日起生效，原《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金托管协议》自同一日起失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。原基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 50,491,364.53 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据基金管理人国泰基金管理有限公司 2022 年 5 月 13 日《国泰基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金增加 C 类基金份额、调整基金份额净值计算精度并修改基金合同的公告》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2022 年 5 月 18 日起对本基金增加 C 类基金份额并相应修改法律文件。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费(原基金份额自动转入 A 类基金份额)；C 类基金份额在投资者申购时不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费。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。投资人可自行选择申购的基金份额类别，但不同类别基金份额之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰量化策略收益混合型证券投资基金基金合同》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，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括

国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 60%-95%,其中,投资于港股通标的股票的比例为股票资产的 0%-20%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 X75%+中证综合债指数收益率 X25%。

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 年半年度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 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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》、财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、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；对在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	68,779,500.74
等于：本金	68,773,880.49
加：应计利息	5,620.25
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	68,779,500.74

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		451,005,964.57	-	492,269,776.42	41,263,811.85
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所		155,524.66		
	市场	14,009,900.00		14,161,824.66	-3,600.00
	银行间		-		
	市场	-		-	-
	合计	14,009,900.00	155,524.66	14,161,824.66	-3,600.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		465,015,864.57	155,524.66	506,431,601.08	41,260,211.85

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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	91.48
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	231,196.60
其中：交易所市场	231,196.60
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	69,424.36
合计	300,712.44

6.4.7.7 实收基金

国泰量化策略收益混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	145,739,719.58	123,138,467.49
本期申购	19,269,931.66	16,281,627.87
本期赎回（以“-”号填列）	-13,231,559.39	-11,179,649.14
本期末	151,778,091.85	128,240,446.22

国泰量化策略收益混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	79,450,277.77	79,450,277.77
本期申购	85,909,934.45	85,909,934.45
本期赎回（以“-”号填列）	-41,304,053.04	-41,304,053.04
本期末	124,056,159.18	124,056,159.18

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

国泰量化策略收益混合 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	103,870,924.42	25,997,302.34	129,868,226.76
本期期初	103,870,924.42	25,997,302.34	129,868,226.76
本期利润	36,917,090.01	22,306,326.78	59,223,416.79
本期基金份额交易产生的变动数	5,853,818.29	1,624,283.81	7,478,102.10
其中：基金申购款	16,595,629.92	5,069,527.86	21,665,157.78
基金赎回款	-10,741,811.63	-3,445,244.05	-14,187,055.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	146,641,832.72	49,927,912.93	196,569,745.65

国泰量化策略收益混合 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	40,773,503.17	14,058,666.18	54,832,169.35
本期期初	40,773,503.17	14,058,666.18	54,832,169.35
本期利润	21,122,028.95	13,552,994.25	34,675,023.20
本期基金份额交易产生的变动数	31,656,751.23	12,488,468.25	44,145,219.48
其中：基金申购款	55,364,333.52	21,055,897.56	76,420,231.08
基金赎回款	-23,707,582.29	-8,567,429.31	-32,275,011.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	93,552,283.35	40,100,128.68	133,652,412.03

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	48,271.07
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	36,815.54
其他	184.71
合计	85,271.32

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,591,454,881.64
减：卖出股票成本总额	1,531,768,033.55
减：交易费用	1,445,206.54

买卖股票差价收入	58,241,641.55
----------	---------------

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	90,581.51
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,800.00
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	99,381.51

6.4.7.11.2 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1月1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	8,092,800.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,991,200.00
减：应计利息总额	92,800.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	8,800.00

6.4.7.12 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
买卖股指期货差价收入	95,709.20

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,029,166.00
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	3,029,166.00

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	35,912,951.03
——股票投资	35,926,261.03
——债券投资	-13,310.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-53,630.00
——权证投资	-
——股指期货	-53,630.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	35,859,321.03

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	71,548.36
转换费收入	2,474.05
合计	74,022.41

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和转入基金申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 25%归入基金资产。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	9,916.99
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,000.00
存托服务费	3.50
上清所查询服务费	600.00
银行汇划费用	245.00

合计	88,272.86
----	-----------

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构

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

本基金本报告期及上年度可比期间均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1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,589,224.58	1,177,427.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	284,710.37	130,088.65
应支付基金管理人的净管理费	2,304,514.21	1,047,339.28

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，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 X 1.20% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	431,537.51	196,238.04

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，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 $\times$ 0.20% / 当年天数。

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1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰量化策略收益混合 A	国泰量化策略收益混合 C	合计
国泰基金管理有限公司	-	387,212.16	387,212.16
建设银行	-	460.66	460.66
合计	-	387,672.82	387,672.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰量化策略收益混合 A	国泰量化策略收益混合 C	合计
国泰基金管理有限公司	-	27,427.21	27,427.21
建设银行	-	213.42	213.42
合计	-	27,640.63	27,640.63

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，逐日累计至每月月底，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 0.60%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 $\times$ 0.60% / 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过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1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	国泰量化策略收益 混合A	国泰量化策略收益 混合C	国泰量化策略收益 混合A	国泰量化策略收益 混合C
期初持有的基金份额	-	64,106.67	-	64,106.67
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	-	64,106.67	-	64,106.67
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.02%	-	0.04%

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

本基金本报告期末及上年度末均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1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	68,779,500.74	48,271.07	33,004,957.02	30,336.98

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

本基金在本报告期及上年度可比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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688795	摩尔线程	2025-11-26	6 个月以上	新股锁定流通受限	114.28	676.94	1,477.00	168,791.56	999,840.38	-
688783	西安奕材	2025-10-20	6 个月以上	新股锁定流通受限	8.62	57.42	16,352.00	140,954.24	938,931.84	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	104.66	768.89	999.00	104,555.34	768,121.11	-
688765	禾元生物	2025-10-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	29.06	48.56	6,417.00	186,478.02	311,609.52	-
301666	大普微	2026-04-08	6 个月以上	新股锁定流通受限	46.08	463.33	540.00	24,883.20	250,198.20	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6 个月以上	新股锁定流通受限	22.68	42.16	3,575.00	81,081.00	150,722.00	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	81.88	1,584.33	93.00	7,614.84	147,342.69	-

001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月以上	新股锁定流通受限	10.11	10.11	14,483.00	146,423.13	146,423.13	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	44.56	468.67	176.00	7,842.56	82,485.92	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月以上	新股锁定流通受限	19.68	141.49	519.00	10,213.92	73,433.31	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	10.12	27.73	2,336.00	23,640.32	64,777.28	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月内(含)	网下中签流通受限	10.11	10.11	6,206.00	62,742.66	62,742.66	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月以上	新股锁定流通受限	69.66	160.06	367.00	25,565.22	58,742.02	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月以上	新股锁定流通受限	17.52	35.92	1,441.00	25,246.32	51,760.72	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月以上	新股锁定流通受限	26.28	172.09	234.00	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月以上	新股锁定流通受限	40.98	308.19	128.00	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月以上	新股锁定流通受限	7.82	20.74	1,544.00	12,074.08	32,022.56	-
688811	有研复材	2026-04-01	6 个月以上	新股锁定流通受限	6.41	24.13	834.00	5,345.94	20,124.42	-
60345	红板	2026-0	6 个月	新股	17.70	84.32	229.00	4,053.	19,309	-

9	科技	3-31	以上	锁定 流通 受限				30	.28	
30169 6	三瑞 智能	2026-0 3-31	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	24.68	86.80	216.00	5,330. 88	18,748 .80	-
30166 9	高特 电子	2026-0 6-02	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	7.08	28.40	546.00	3,865. 68	15,506 .40	-
30168 7	新广 益	2025-1 2-24	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	21.93	77.78	195.00	4,276. 35	15,167 .10	-
30159 9	理奇 智能	2026-0 4-22	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	13.91	32.47	433.00	6,023. 03	14,059 .51	-
00136 5	天海 电子	2026-0 5-11	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	27.19	31.31	438.00	11,909 .22	13,713 .78	-
30168 0	固德 电材	2026-0 2-27	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	58.00	112.16	117.00	6,786. 00	13,122 .72	-
00139 3	维通 利	2026-0 5-08	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	30.38	38.99	320.00	9,721. 60	12,476 .80	-
00123 7	惠康 科技	2026-0 5-15	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	53.26	58.74	176.00	9,373. 76	10,338 .24	-
60340 7	长裕 集团	2026-0 4-29	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	13.86	73.46	137.00	1,898. 82	10,064 .02	-
30168 3	慧谷 新材	2026-0 3-24	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	78.38	121.77	80.00	6,270. 40	9,741. 60	-
68881 6	易思 维	2026-0 2-04	6 个月 以上	新股 锁定	55.95	57.10	157.00	8,784. 15	8,964. 70	-

				流通 受限						
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	26.66	50.96	138.00	3,679.08	7,032.48	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	11.18	17.59	352.00	3,935.36	6,191.68	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	15.76	46.71	104.00	1,639.04	4,857.84	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	33.49	33.93	70.00	2,344.30	2,375.10	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	37.88	34.87	46.00	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	28.00	27.78	57.00	1,596.00	1,583.46	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

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，其预期风险与预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中等预期风险和预期收益的产品。本基金投资的金融工具主要包括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。本基金将投资港股通标的股票，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。本基金通过量化多因子选股策略和基本面研究精选个股，在严格控制风险的前提下，力争实现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约责任，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中国建设银行，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，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%(2025 年 12 月 31 日：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可随时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每日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，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即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》及《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、流通受限制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发行的证券不得超过该证券的 10%。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。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%。

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	68,779,500.74	-	-	-	68,779,500.74
结算备付金	7,334,352.13	-	-	-	7,334,352.13
存出保证金	105,531.93	-	-	-	105,531.93
交易性金融资产	14,161,824.66	-	-	492,269,776.42	506,431,601.08
应收清算款	-	-	-	81,710.34	81,710.34
应收申购款	-	-	-	867,474.50	867,474.50

资产总计	90,381,209.46	-	-	493,218,961.26	583,600,170.72
负债					
应付赎回款	-	-	-	96,491.87	96,491.87
应付管理人报酬	-	-	-	499,266.06	499,266.06
应付托管费	-	-	-	83,211.04	83,211.04
应付销售服务费	-	-	-	101,467.17	101,467.17
应交税费	-	-	-	259.06	259.06
其他负债	-	-	-	300,712.44	300,712.44
负债总计	-	-	-	1,081,407.64	1,081,407.64
利率敏感度缺口	90,381,209.46	-	-	492,137,553.62	582,518,763.08
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	16,712,938.74	-	-	-	16,712,938.74
结算备付金	6,593,879.74	-	-	-	6,593,879.74
存出保证金	265,906.77	-	-	-	265,906.77
交易性金融资产	15,131,451.51	-	-	354,348,597.68	369,480,049.19
应收申购款	-	-	-	9,257.98	9,257.98
资产总计	38,704,176.76	-	-	354,357,855.66	393,062,032.42
负债					
应付清算款	-	-	-	3,604.09	3,604.09
应付赎回款	-	-	-	4,857,405.74	4,857,405.74
应付管理人报酬	-	-	-	410,236.22	410,236.22
应付托管费	-	-	-	68,372.72	68,372.72
应付销售服务费	-	-	-	70,409.22	70,409.22
应交税费	-	-	-	2,931.03	2,931.03
其他负债	-	-	-	359,932.03	359,932.03
负债总计	-	-	-	5,772,891.05	5,772,891.05
利率敏感度缺口	38,704,176.76	-	-	348,584,964.61	387,289,141.3

					7
--	--	--	--	--	---

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 2.43%（2025 年 12 月 31 日：3.91%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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。本基金主要投资于上市交易的证券，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		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	492,269,776.42	84.51	354,348,597.68	91.49

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	492,269,776.	84.51	354,348,597.6	91.49
	42		8	

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量不变		
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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 34,351,255.94	增加约 22,537,845.11
	业绩比较基准下降 5%	减少约 34,351,255.94	减少约 22,537,845.11

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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	487,845,923.75	351,134,846.69
第二层次	14,370,990.45	16,275,796.51
第三层次	4,214,686.88	2,069,405.99
合计	506,431,601.08	369,480,049.19

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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不

活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

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(2025 年 12 月 31 日:同)。

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	492,269,776.42	84.35
	其中:股票	492,269,776.42	84.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,161,824.66	2.43
	其中:债券	14,161,824.66	2.43
	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	76,113,852.87	13.04
8	其他各项资产	1,054,716.77	0.18

9	合计	583,600,170.72	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	2,409,397.70	0.41
B	采矿业	13,702,691.56	2.35
C	制造业	360,776,298.69	61.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,898,264.79	0.84
E	建筑业	3,451,764.00	0.59
F	批发和零售业	13,653,537.00	2.34
G	交通运输、仓储和邮政业	8,128,401.46	1.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,434,666.00	5.40
J	金融业	23,734,262.22	4.07
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,100,592.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	4,857,385.00	0.83
N	水利、环境和公共设施管理业	19,333,916.00	3.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,561,356.00	0.27
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	227,244.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	492,269,776.42	84.51

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	603986	兆易创新	18,800	15,322,000.00	2.63
2	002463	沪电股份	69,100	10,558,480.00	1.81
3	301536	星宸科技	76,500	9,846,315.00	1.69

4	002384	东山精密	35,600	9,339,660.00	1.60
5	001309	德明利	9,000	8,486,100.00	1.46
6	300475	香农芯创	27,900	8,370,000.00	1.44
7	600150	中国船舶	237,436	8,022,962.44	1.38
8	002266	浙富控股	1,580,800	7,998,848.00	1.37
9	300857	协创数据	19,620	6,668,838.00	1.14
10	000807	云铝股份	285,100	6,312,114.00	1.08
11	603588	高能环境	324,300	6,226,560.00	1.07
12	000975	山金国际	349,600	5,943,200.00	1.02
13	601869	长飞光纤	10,800	5,895,720.00	1.01
14	688110	东芯股份	28,700	5,846,190.00	1.00
15	300613	富瀚微	71,100	5,693,688.00	0.98
16	688456	有研粉材	39,600	5,528,160.00	0.95
17	603283	赛腾股份	65,200	5,279,896.00	0.91
18	600230	沧州大化	383,700	4,995,774.00	0.86
19	300308	中际旭创	3,900	4,953,000.00	0.85
20	301548	崇德科技	53,400	4,740,318.00	0.81
21	688536	思瑞浦	12,700	4,623,943.00	0.79
22	600961	株冶集团	142,600	4,618,814.00	0.79
23	600999	招商证券	185,700	3,918,270.00	0.67
24	002810	山东赫达	158,400	3,912,480.00	0.67
25	688678	福立旺	161,200	3,896,204.00	0.67
26	300042	朗科科技	48,600	3,701,862.00	0.64
27	600030	中信证券	126,724	3,640,780.52	0.63
28	688059	华锐精密	17,800	3,554,838.00	0.61
29	688416	恒烁股份	25,067	3,509,380.00	0.60
30	000589	贵州轮胎	853,800	3,466,428.00	0.60
31	688503	聚和材料	26,000	3,450,200.00	0.59
32	002154	报喜鸟	965,700	3,437,892.00	0.59
33	688090	瑞松科技	31,980	3,404,271.00	0.58
34	300750	宁德时代	8,560	3,364,165.60	0.58
35	688045	必易微	41,100	3,320,058.00	0.57
36	300769	德方纳米	48,900	3,251,850.00	0.56
37	601233	桐昆股份	149,700	3,241,005.00	0.56
38	301219	腾远钴业	57,820	3,168,536.00	0.54
39	000933	神火股份	148,600	3,150,320.00	0.54
40	301580	爱迪特	45,500	2,927,015.00	0.50
41	300661	圣邦股份	20,300	2,912,644.00	0.50
42	688717	艾罗能源	34,900	2,881,693.00	0.49
43	000951	中国重汽	138,600	2,704,086.00	0.46
44	688689	银河微电	41,600	2,692,352.00	0.46
45	002557	洽洽食品	144,400	2,593,424.00	0.45
46	300681	英搏尔	89,200	2,552,904.00	0.44
47	002132	恒星科技	469,600	2,540,536.00	0.44

48	688628	优利德	25,200	2,493,288.00	0.43
49	603162	海通发展	277,700	2,490,969.00	0.43
50	002558	巨人网络	88,300	2,433,548.00	0.42
51	000651	格力电器	64,700	2,426,250.00	0.42
52	002111	威海广泰	264,300	2,378,700.00	0.41
53	002283	天润工业	240,700	2,322,755.00	0.40
54	002998	优彩资源	353,400	2,300,634.00	0.39
55	000703	恒逸石化	168,800	2,290,616.00	0.39
56	688209	英集芯	77,800	2,262,424.00	0.39
57	300786	国林科技	90,200	2,261,314.00	0.39
58	688279	峰昭科技	10,000	2,244,400.00	0.39
59	603929	亚翔集成	8,000	2,176,160.00	0.37
60	601009	南京银行	218,200	2,157,998.00	0.37
61	301500	飞南资源	81,000	2,110,050.00	0.36
62	600356	恒丰纸业	283,700	2,102,217.00	0.36
63	300953	震裕科技	15,600	2,085,720.00	0.36
64	688275	万润新能	16,200	2,066,310.00	0.35
65	300658	延江股份	180,600	2,064,258.00	0.35
66	688115	思林杰	24,900	2,048,025.00	0.35
67	688680	海优新材	48,100	2,020,200.00	0.35
68	300980	祥源新材	67,500	1,985,175.00	0.34
69	001314	亿道信息	32,000	1,977,600.00	0.34
70	600489	中金黄金	107,600	1,942,180.00	0.33
71	688400	凌云光	29,300	1,939,660.00	0.33
72	688627	精智达	2,700	1,930,500.00	0.33
73	603507	振江股份	58,540	1,925,380.60	0.33
74	600887	伊利股份	77,900	1,866,484.00	0.32
75	300745	欣锐科技	43,700	1,845,014.00	0.32
76	688699	明微电子	22,300	1,827,485.00	0.31
77	002136	安纳达	135,200	1,768,416.00	0.30
78	688173	希荻微	92,100	1,762,794.00	0.30
79	601168	西部矿业	64,900	1,761,386.00	0.30
80	002134	天津普林	57,300	1,743,066.00	0.30
81	601677	明泰铝业	102,700	1,704,820.00	0.29
82	300843	胜蓝股份	10,900	1,703,125.00	0.29
83	300223	北京君正	6,700	1,667,630.00	0.29
84	688337	普源精电	21,700	1,625,981.00	0.28
85	300502	新易盛	2,660	1,614,620.00	0.28
86	603195	公牛集团	40,900	1,601,235.00	0.27
87	603711	香飘飘	143,500	1,594,285.00	0.27
88	002415	海康威视	46,500	1,590,300.00	0.27
89	688372	伟测科技	8,500	1,581,000.00	0.27
90	300274	阳光电源	9,900	1,574,298.00	0.27
91	600455	博通股份	71,100	1,561,356.00	0.27

92	301210	金杨精密	51,820	1,554,600.00	0.27
93	688156	路德科技	51,100	1,545,775.00	0.27
94	601899	紫金矿业	60,800	1,528,512.00	0.26
95	600519	贵州茅台	1,289	1,528,096.61	0.26
96	688369	致远互联	71,000	1,491,710.00	0.26
97	002591	恒大高新	242,300	1,482,876.00	0.25
98	688257	新锐股份	14,480	1,475,512.00	0.25
99	601328	交通银行	227,200	1,460,896.00	0.25
100	688653	康希通信	83,600	1,452,968.00	0.25
101	301099	雅创电子	15,100	1,442,050.00	0.25
102	300709	精研科技	25,300	1,423,125.00	0.24
103	603329	上海雅仕	155,600	1,397,288.00	0.24
104	000543	皖能电力	179,000	1,355,030.00	0.23
105	300323	华灿光电	64,400	1,313,760.00	0.23
106	002494	华斯股份	290,400	1,289,376.00	0.22
107	603271	永杰新材	28,900	1,284,605.00	0.22
108	301371	敷尔佳	49,400	1,284,400.00	0.22
109	000338	潍柴动力	46,700	1,272,575.00	0.22
110	688710	益诺思	18,800	1,263,360.00	0.22
111	300201	海伦哲	59,300	1,249,451.00	0.21
112	603269	海鸥股份	74,060	1,219,768.20	0.21
113	000810	创维数字	92,000	1,219,000.00	0.21
114	688035	德邦科技	13,200	1,211,760.00	0.21
115	603259	药明康德	9,700	1,207,747.00	0.21
116	300970	华绿生物	65,670	1,200,447.60	0.21
117	002458	益生股份	154,130	1,197,590.10	0.21
118	002921	联诚精密	43,800	1,197,492.00	0.21
119	300861	美畅股份	47,100	1,186,449.00	0.20
120	601995	中金公司	32,200	1,164,030.00	0.20
121	000333	美的集团	15,300	1,155,609.00	0.20
122	300277	汽轮科技	76,300	1,147,552.00	0.20
123	002338	奥普光电	20,000	1,144,000.00	0.20
124	301002	崧盛股份	29,600	1,142,560.00	0.20
125	002645	华宏科技	41,280	1,135,612.80	0.19
126	688671	碧兴物联	31,500	1,120,455.00	0.19
127	603638	艾迪精密	47,700	1,118,565.00	0.19
128	300823	建科智能	76,400	1,113,912.00	0.19
129	001368	通达创智	53,600	1,102,552.00	0.19
130	301603	乔锋智能	7,600	1,092,880.00	0.19
131	600790	轻纺城	329,900	1,078,773.00	0.19
132	300398	飞凯材料	17,200	1,062,100.00	0.18
133	600037	歌华有线	169,200	1,060,884.00	0.18
134	300842	帝科股份	11,800	1,052,206.00	0.18
135	603327	福蓉科技	123,900	1,050,672.00	0.18

136	603980	吉华集团	158,000	1,049,120.00	0.18
137	688216	气派科技	24,700	1,037,647.00	0.18
138	601128	常熟银行	178,200	1,037,124.00	0.18
139	300358	楚天科技	129,300	1,034,400.00	0.18
140	300590	移为通信	71,700	1,028,895.00	0.18
141	002963	豪尔赛	48,500	1,021,410.00	0.18
142	300016	北陆药业	132,200	1,013,974.00	0.17
143	688291	金橙子	17,300	1,011,704.00	0.17
144	301372	科净源	31,900	1,005,169.00	0.17
145	688795	摩尔线程	1,477	999,840.38	0.17
146	002966	苏州银行	140,900	980,664.00	0.17
147	300206	理邦仪器	79,500	972,285.00	0.17
148	688633	星球石墨	32,600	969,198.00	0.17
149	601033	永兴股份	72,000	964,800.00	0.17
150	605151	西上海	54,500	959,745.00	0.16
151	001218	丽臣实业	43,100	950,786.00	0.16
152	688783	西安奕材	16,352	938,931.84	0.16
153	300768	迪普科技	67,600	930,852.00	0.16
154	301246	宏源药业	34,600	930,740.00	0.16
155	002947	恒铭达	12,200	927,810.00	0.16
156	002142	宁波银行	31,200	926,328.00	0.16
157	300405	科隆股份	177,300	918,414.00	0.16
158	601166	兴业银行	55,000	910,800.00	0.16
159	001373	翔腾新材	30,100	907,515.00	0.16
160	600984	建设机械	242,400	906,576.00	0.16
161	600027	华电国际	202,500	901,125.00	0.15
162	002460	赣锋锂业	13,700	895,980.00	0.15
163	002652	扬子新材	209,300	891,618.00	0.15
164	688409	富创精密	2,900	888,125.00	0.15
165	300867	圣元环保	48,800	884,256.00	0.15
166	001311	多利科技	54,500	879,085.00	0.15
167	300490	华自科技	65,700	869,211.00	0.15
168	301418	协昌科技	15,500	866,140.00	0.15
169	300975	商络电子	16,700	864,225.00	0.15
170	601318	中国平安	18,000	859,320.00	0.15
171	000949	新乡化纤	135,500	859,070.00	0.15
172	600346	恒力石化	48,500	858,935.00	0.15
173	688435	英方软件	26,800	857,600.00	0.15
174	688309	恒誉环保	14,000	852,320.00	0.15
175	688378	奥来德	13,700	849,400.00	0.15
176	301314	科瑞思	17,400	846,684.00	0.15
177	600353	旭光电子	18,500	843,600.00	0.14
178	603124	江南新材	4,500	841,410.00	0.14
179	603990	麦迪科技	38,200	813,278.00	0.14

180	301119	正强股份	32,760	803,930.40	0.14
181	603285	键邦股份	17,900	802,099.00	0.14
182	688256	寒武纪	500	797,775.00	0.14
183	002064	华峰化学	83,700	794,313.00	0.14
184	600036	招商银行	22,200	788,100.00	0.14
185	002563	森马服饰	155,700	784,728.00	0.13
186	688802	沐曦股份	999	768,121.11	0.13
187	002120	韵达股份	120,600	767,016.00	0.13
188	001337	四川黄金	20,800	762,528.00	0.13
189	688359	三孚新科	3,800	754,072.00	0.13
190	300054	鼎龙股份	7,000	741,790.00	0.13
191	688758	赛分科技	33,400	735,134.00	0.13
192	300969	恒帅股份	7,800	731,328.00	0.13
193	000603	盛达资源	31,600	729,960.00	0.13
194	688600	皖仪科技	21,700	722,176.00	0.12
195	301295	美硕科技	17,100	721,278.00	0.12
196	601872	招商轮船	41,000	720,370.00	0.12
197	601061	中信金属	66,700	718,359.00	0.12
198	001228	永泰运	28,100	717,955.00	0.12
199	301502	华阳智能	10,300	716,056.00	0.12
200	003030	祖名股份	34,800	715,140.00	0.12
201	300629	新劲刚	33,100	710,326.00	0.12
202	688063	派能科技	13,200	703,164.00	0.12
203	688638	誉辰智能	22,500	701,325.00	0.12
204	001339	智微智能	6,760	691,412.80	0.12
205	601688	华泰证券	33,000	680,460.00	0.12
206	001298	好上好	32,600	676,450.00	0.12
207	001287	中电港	21,300	663,495.00	0.11
208	300073	当升科技	13,700	658,148.00	0.11
209	688517	金冠电气	37,500	655,500.00	0.11
210	688388	嘉元科技	14,790	650,760.00	0.11
211	688667	菱电电控	4,800	641,520.00	0.11
212	688155	先惠技术	7,900	639,031.00	0.11
213	301308	江波龙	900	633,420.00	0.11
214	300153	科泰电源	27,300	617,526.00	0.11
215	600919	江苏银行	56,000	603,680.00	0.10
216	600352	浙江龙盛	49,700	601,867.00	0.10
217	000987	越秀资本	76,700	599,794.00	0.10
218	301198	喜悦智行	44,300	593,620.00	0.10
219	601000	唐山港	141,500	587,225.00	0.10
220	002049	紫光国微	6,600	585,750.00	0.10
221	002653	海思科	8,800	583,792.00	0.10
222	301087	可孚医疗	11,900	567,035.00	0.10
223	301118	恒光股份	20,400	555,492.00	0.10

224	000408	藏格矿业	8,000	554,560.00	0.10
225	301608	博实结	11,000	552,860.00	0.09
226	600969	郴电国际	72,200	550,886.00	0.09
227	601577	长沙银行	63,100	549,601.00	0.09
228	600177	雅戈尔	72,900	548,937.00	0.09
229	601518	吉林高速	195,200	546,560.00	0.09
230	601111	中国国航	90,100	545,105.00	0.09
231	600115	中国东航	142,800	544,068.00	0.09
232	002475	立讯精密	7,600	535,040.00	0.09
233	600323	瀚蓝环境	19,400	532,724.00	0.09
234	600511	国药股份	20,400	531,216.00	0.09
235	002250	联化科技	38,700	529,029.00	0.09
236	688385	复旦微电	7,300	520,417.00	0.09
237	688269	凯立新材	16,400	520,044.00	0.09
238	601665	齐鲁银行	89,700	517,569.00	0.09
239	301662	宏工科技	5,075	514,199.00	0.09
240	600886	国投电力	38,500	512,435.00	0.09
241	601700	风范股份	117,100	510,556.00	0.09
242	603689	皖天然气	73,400	508,662.00	0.09
243	603933	睿能科技	22,500	507,375.00	0.09
244	002507	涪陵榨菜	46,900	506,520.00	0.09
245	000895	双汇发展	22,300	499,520.00	0.09
246	600398	海澜之家	95,200	497,896.00	0.09
247	300458	全志科技	12,600	497,196.00	0.09
248	600872	中炬高新	28,500	494,760.00	0.08
249	600926	杭州银行	34,100	492,745.00	0.08
250	002025	航天电器	6,400	487,808.00	0.08
251	002032	苏泊尔	12,100	479,160.00	0.08
252	601108	财通证券	55,300	478,345.00	0.08
253	601997	贵阳银行	93,000	477,090.00	0.08
254	603187	海容冷链	41,492	476,743.08	0.08
255	601333	广深铁路	171,500	471,625.00	0.08
256	002805	丰元股份	16,400	468,876.00	0.08
257	688008	澜起科技	1,500	464,850.00	0.08
258	600801	华新建材	29,600	461,760.00	0.08
259	300236	上海新阳	3,500	460,250.00	0.08
260	600320	振华重工	110,600	456,778.00	0.08
261	001286	陕西能源	44,400	450,216.00	0.08
262	600426	华鲁恒升	18,700	447,304.00	0.08
263	300890	翔丰华	13,300	441,161.00	0.08
264	600546	山煤国际	40,000	437,200.00	0.08
265	600938	中国海油	16,000	434,400.00	0.07
266	601107	四川成渝	89,000	434,320.00	0.07
267	600941	中国移动	4,900	422,037.00	0.07

268	600026	中远海能	23,300	418,002.00	0.07
269	002466	天齐锂业	6,800	416,976.00	0.07
270	600316	洪都航空	14,900	416,306.00	0.07
271	002961	瑞达期货	21,000	411,180.00	0.07
272	600098	广州发展	69,500	410,745.00	0.07
273	688041	海光信息	1,100	407,330.00	0.07
274	301631	壹连科技	5,600	402,416.00	0.07
275	688981	中芯国际	2,500	397,050.00	0.07
276	002371	北方华创	435	384,783.60	0.07
277	688766	普冉股份	500	383,300.00	0.07
278	002803	吉宏股份	14,800	382,432.00	0.07
279	301489	思泉新材	2,300	378,534.00	0.06
280	600927	永安期货	30,300	377,235.00	0.06
281	603978	深圳新星	12,000	377,160.00	0.06
282	002497	雅化集团	18,500	376,845.00	0.06
283	603966	法兰泰克	44,290	360,963.50	0.06
284	600843	上工申贝	40,600	349,160.00	0.06
285	603799	华友钴业	7,200	347,472.00	0.06
286	601816	京沪高铁	76,600	346,998.00	0.06
287	601138	工业富联	4,800	346,320.00	0.06
288	301382	蜂助手	7,400	340,400.00	0.06
289	002432	九安医疗	4,700	332,196.00	0.06
290	688293	奥浦迈	7,800	325,182.00	0.06
291	002838	道恩股份	10,500	321,510.00	0.06
292	301216	万凯新材	13,900	319,561.00	0.05
293	002174	游族网络	25,300	319,033.00	0.05
294	301392	汇成真空	1,100	317,504.00	0.05
295	002532	天山铝业	29,200	313,316.00	0.05
296	688765	禾元生物	6,417	311,609.52	0.05
297	301095	广立微	2,500	295,125.00	0.05
298	002843	泰嘉股份	13,700	294,139.00	0.05
299	001336	楚环科技	13,300	292,866.00	0.05
300	301479	弘景光电	4,700	282,940.00	0.05
301	603116	红蜻蜓	48,500	275,480.00	0.05
302	688609	九联科技	24,700	271,947.00	0.05
303	300059	东方财富	13,075	266,468.50	0.05
304	688073	毕得医药	4,800	258,336.00	0.04
305	603085	天成自控	23,500	255,445.00	0.04
306	603909	建发合诚	29,800	254,194.00	0.04
307	301666	大普微	540	250,198.20	0.04
308	002594	比亚迪	3,100	247,070.00	0.04
309	002493	荣盛石化	22,900	246,175.00	0.04
310	688012	中微公司	500	234,250.00	0.04
311	603066	音飞储存	23,500	229,360.00	0.04

312	000802	北京文化	65,300	227,244.00	0.04
313	603126	中材节能	35,200	221,760.00	0.04
314	600276	恒瑞医药	4,260	221,690.40	0.04
315	601398	工商银行	31,200	220,584.00	0.04
316	301487	盟固利	11,100	212,565.00	0.04
317	001248	华润新能源	20,689	209,165.79	0.04
318	300476	胜宏科技	600	207,858.00	0.04
319	000725	京东方 A	23,600	204,848.00	0.04
320	301510	固高科技	6,200	197,966.00	0.03
321	603217	元利科技	8,800	197,384.00	0.03
322	605138	盛泰集团	35,700	197,064.00	0.03
323	002956	西麦食品	8,800	182,688.00	0.03
324	301326	捷邦科技	1,300	181,181.00	0.03
325	001332	锡装股份	4,600	180,642.00	0.03
326	600292	电投水电	14,600	175,784.00	0.03
327	688107	安路科技	3,800	173,280.00	0.03
328	300394	天孚通信	560	169,500.80	0.03
329	002541	鸿路钢构	9,700	168,004.00	0.03
330	301026	浩通科技	8,100	163,782.00	0.03
331	688781	视涯科技	3,575	150,722.00	0.03
332	688808	联讯仪器	93	147,342.69	0.03
333	002850	科达利	700	132,510.00	0.02
334	600183	生益科技	700	121,380.00	0.02
335	300408	三环集团	700	116,830.00	0.02
336	601211	国泰海通	6,021	109,582.20	0.02
337	601288	农业银行	17,400	105,618.00	0.02
338	688797	臻宝科技	176	82,485.92	0.01
339	688820	盛合晶微	519	73,433.31	0.01
340	000858	五 粮 液	900	66,600.00	0.01
341	601088	中国神华	1,700	66,368.00	0.01
342	603993	洛阳钼业	3,700	64,935.00	0.01
343	001399	惠科股份	2,336	64,777.28	0.01
344	688002	睿创微纳	400	61,876.00	0.01
345	301682	宏明电子	367	58,742.02	0.01
346	300438	鹏辉能源	700	57,995.00	0.01
347	002648	卫星化学	2,400	56,376.00	0.01
348	688712	北芯生命	1,441	51,760.72	0.01
349	601058	赛轮轮胎	4,400	50,732.00	0.01
350	688220	翱捷科技	400	49,728.00	0.01
351	000893	亚钾国际	1,200	49,068.00	0.01
352	002444	巨星科技	1,300	40,430.00	0.01
353	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
354	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
355	001257	盛龙股份	1,544	32,022.56	0.01

356	600233	圆通速递	1,600	25,200.00	0.00
357	688099	晶晨股份	200	20,580.00	0.00
358	300738	奥飞数据	1,000	20,220.00	0.00
359	688811	有研新材	834	20,124.42	0.00
360	603459	红板科技	229	19,309.28	0.00
361	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
362	002488	金固股份	2,100	18,711.00	0.00
363	603063	禾望电气	300	15,867.00	0.00
364	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
365	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
366	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
367	001365	天海电子	438	13,713.78	0.00
368	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
369	001393	维通利	320	12,476.80	0.00
370	002772	众兴菌业	1,000	11,360.00	0.00
371	001237	惠康科技	176	10,338.24	0.00
372	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
373	301683	慧谷新材	80	9,741.60	0.00
374	688816	易思维	157	8,964.70	0.00
375	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
376	688472	阿特斯	600	6,492.00	0.00
377	601112	振石股份	352	6,191.68	0.00
378	300592	华凯易佰	300	5,310.00	0.00
379	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
380	603293	埃泰克	70	2,375.10	0.00
381	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
382	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600150	中国船舶	11,300,068.41	2.92
2	603986	兆易创新	10,505,283.00	2.71
3	000975	山金国际	9,530,523.00	2.46
4	300857	协创数据	9,264,475.00	2.39
5	000807	云铝股份	9,236,553.00	2.38
6	300750	宁德时代	8,540,382.00	2.21
7	688525	佰维存储	8,521,797.68	2.20
8	300308	中际旭创	8,482,162.00	2.19

9	002436	兴森科技	8,053,130.00	2.08
10	002266	浙富控股	7,914,816.00	2.04
11	002028	思源电气	7,621,035.00	1.97
12	002463	沪电股份	7,486,813.00	1.93
13	301536	星宸科技	6,584,014.00	1.70
14	603588	高能环境	6,570,309.00	1.70
15	688536	思瑞浦	6,504,174.50	1.68
16	002384	东山精密	6,368,929.00	1.64
17	601009	南京银行	6,340,323.00	1.64
18	688772	珠海冠宇	6,325,134.74	1.63
19	301308	江波龙	6,232,089.00	1.61
20	000951	中国重汽	6,184,166.00	1.60

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	14,687,182.00	3.79
2	600183	生益科技	10,895,900.00	2.81
3	688525	佰维存储	10,880,495.51	2.81
4	300750	宁德时代	9,212,570.00	2.38
5	600011	华能国际	8,694,292.00	2.24
6	002028	思源电气	7,779,667.00	2.01
7	300857	协创数据	7,751,692.41	2.00
8	603259	药明康德	7,536,769.00	1.95
9	002436	兴森科技	7,525,741.00	1.94
10	300373	扬杰科技	6,940,824.00	1.79
11	603186	华正新材	6,827,453.00	1.76
12	301308	江波龙	6,143,950.00	1.59
13	002293	罗莱生活	6,046,632.00	1.56
14	000333	美的集团	6,033,854.00	1.56
15	300207	欣旺达	5,969,100.00	1.54
16	688600	皖仪科技	5,896,489.01	1.52
17	603986	兆易创新	5,847,370.00	1.51
18	600019	宝钢股份	5,793,630.00	1.50
19	002008	大族激光	5,766,959.00	1.49
20	603558	健盛集团	5,679,161.00	1.47

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	1,633,762,951.26
卖出股票的收入（成交）总额	1,591,454,881.64

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	14,161,824.66	2.43
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	14,161,824.66	2.43

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	019785	25 国债 13	70,000	7,088,378.36	1.22
2	019792	25 国债 19	70,000	7,073,446.30	1.21

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 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	105,531.93
2	应收清算款	81,710.34
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	867,474.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,054,716.77

7.11.4 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。

7.11.5 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
国泰量化策略收益混合 A	14,186	10,699.15	128,014,510.59	84.34%	23,763,581.26	15.66%
国泰量化策略收益混合 C	348	356,483.22	122,005,660.70	98.35%	2,050,498.48	1.65%
合计	14,534	18,978.55	250,020,171.29	90.64%	25,814,079.74	9.36%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	97.82%

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	国泰量化策略收益混合 A	95,316.65	0.06%
	国泰量化策略收益混合 C	65.72	0.00%
	合计	95,382.37	0.03%

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	国泰量化策略收益混合 A	0
	国泰量化策略收益混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰量化策略收益混合 A	0~10

	国泰量化策略收益混合 C	0
	合计	0~10

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰量化策略收益混合 A	国泰量化策略收益混合 C
基金合同生效日（2018 年 12 月 27 日）基金份额总额	48,640,832.64	-
本报告期期初基金份额总额	145,739,719.58	79,450,277.77
本报告期基金总申购份额	19,269,931.66	85,909,934.45
减：本报告期基金总赎回份额	13,231,559.39	41,304,053.04
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	151,778,091.85	124,056,159.18

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

报告期内，基金托管人未受调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金托管人相关从业人员未受调查或处罚。

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	
方正证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国泰海通	4	2,753,493,740.19	85.42%	374,205.94	84.51%	-
国盛证券	2	469,858,669.20	14.58%	68,555.11	15.48%	-
广发证券	1	78,838.20	0.00%	30.35	0.01%	-

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、本基金本报告期内渤海证券减少 1 个席位。

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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	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
方正证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	7,035,875.75	100.00%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

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	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》	2026-03-24
2	国泰基金管理有限公司关于深圳市分公司办公地址变更的公告	《中国证券报》	2026-04-02
3	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
4	国泰基金管理有限公司关于旗下部分基金调	《证券日报》、《上海证券	2026-06-27

	整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	报》、《中国证券报》、《证券时报》	
--	------------------------	-------------------	--

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

本基金本报告期内无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、国泰目标收益保本混合型证券投资基金基金合同
- 2、国泰目标收益保本混合型证券投资基金托管协议
- 3、中国证监会批准国泰目标收益保本混合型证券投资基金募集的文件
- 4、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 5、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 6、关于准予国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复
- 7、国泰量化策略收益混合型证券投资基金基金合同
- 8、国泰量化策略收益混合型证券投资基金托管协议
- 8、报告期内披露的各项公告
- 9、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