国泰盈享配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国泰盈享配置 6 个月持有混合发起（FOF）
基金主代码	026338
基金运作方式	契约型开放式。 本基金对每份基金份额设置 6 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。
基金合同生效日	2026 年 5 月 7 日
报告期末基金份额总额	108,134,847.98 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过在多类资产中进行资产配置，优选多种具有不同风险收益特征的基金，力争实现基金资产的长期稳健增值。
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	中债-新综合全价（总值）指数收益率*70%+中证 800 指数收益率*20%+标普 500 指数（S&P 500 Index）*5%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约价格收益率*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。
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称	国泰盈享配置 6 个月持有混合发起（FOF）A	国泰盈享配置 6 个月持有混合发起（FOF）C
下属两级基金的交易代码	026338	026339
报告期末下属两级基金的份额总额	57,657,586.14 份	50,477,261.84 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日)	
	国泰盈享配置 6 个月持有混合发起（FOF）A	国泰盈享配置 6 个月持有混合发起（FOF）C
1.本期已实现收益	-1,272,929.23	-1,150,051.91
2.本期利润	-2,927,382.31	-2,617,818.48
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0509	-0.0519
4.期末基金资产净值	55,893,143.44	48,873,828.46
5.期末基金份额净值	0.9694	0.9682

注：(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益） 扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、国泰盈享配置 6 个月持有混合发起（FOF）A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-5.02%	0.58%	-2.28%	0.32%	-2.74%	0.26%
自基金合同生效起至今	-3.06%	0.52%	-2.10%	0.33%	-0.96%	0.19%

2、国泰盈享配置 6 个月持有混合发起（FOF）C：

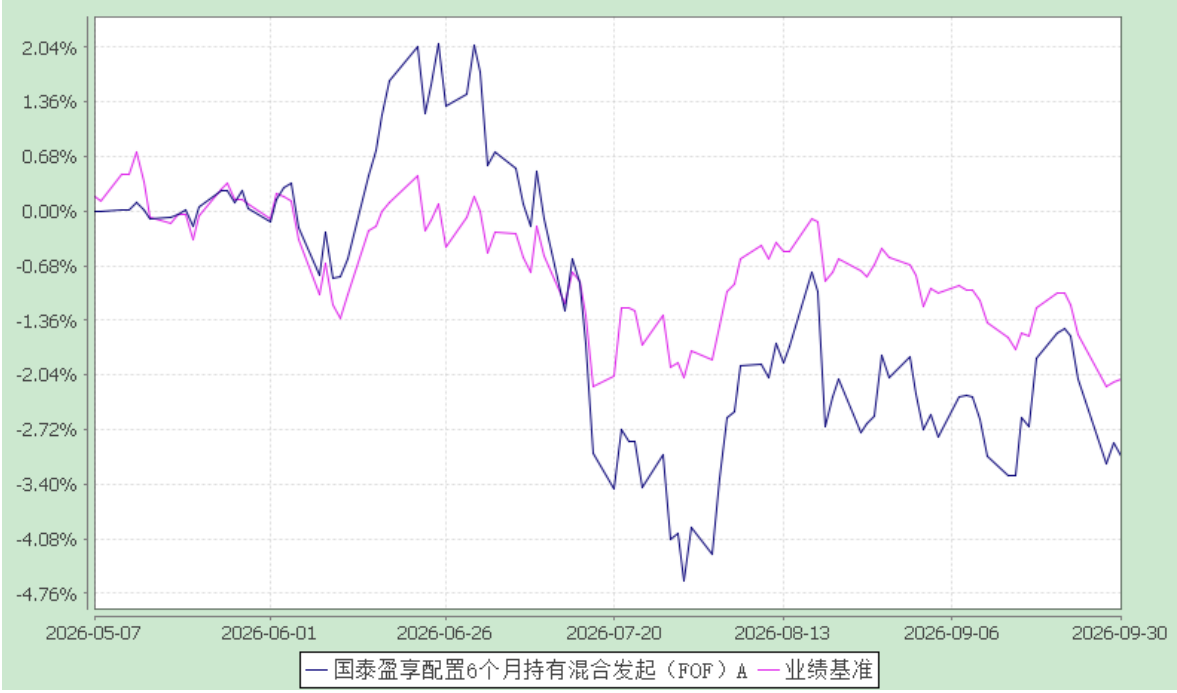
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-5.10%	0.58%	-2.28%	0.32%	-2.82%	0.26%
自基金合同生效起至今	-3.18%	0.52%	-2.10%	0.33%	-1.08%	0.19%

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

较

国泰盈享配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2026 年 5 月 7 日至 2026 年 9 月 30 日)

1．国泰盈享配置 6 个月持有混合发起（FOF）A：



注：（1）本基金的合同生效日为2026年5月7日，截止至2026年9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。

2．国泰盈享配置 6 个月持有混合发起（FOF）C：



注：（1）本基金的合同生效日为2026年5月7日，截止至2026年9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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐皓	国泰民泽平衡养老目标三年持有期混合 FOF、国泰丰华三个月持有期混合发起式（FOF）、国泰全景多资产配置 3 个月持有混合（FOF）、国泰盈享配置 6 个月持有混合发起（FOF）的基金经理	2026-05-07	-	19 年	博士研究生，FRM，高级经济师，注册黄金投资分析师（国家一级）。曾任职于中国工商银行总行资产托管部。2010 年 5 月加入国泰基金，任高级风控经理。2011 年 6 月至 2014 年 1 月任上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金及国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理助理，2012

					年 3 月至 2014 年 1 月任中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金、国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理。2014 年 1 月至 2015 年 7 月任国泰中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2014 年 1 月至 2015 年 8 月任中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2014 年 6 月至 2018 年 9 月任国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金的基金经理，2014 年 11 月至 2018 年 9 月任国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金和纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2015 年 3 月至 2018 年 9 月任国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金的基金经理，2015 年 8 月至 2016 年 6 月任国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金（由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）的基金经理，2016 年 7 月至 2018 年 9 月任国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）（由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来）的基金经理，

					2016 年 11 月至 2018 年 7 月任国泰创业板指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 4 月任国泰中证国有企业改革指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2020 年 7 月起任国泰民泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理，2025 年 9 月起兼任国泰丰华三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理，2025 年 11 月起兼任国泰全景多资产配置 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理，2026 年 5 月起兼任国泰盈享配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理。历任高级风控经理、基金经理、投资总监（量化），2018 年 9 月起加入 FOF 投资部，从事大类资产配置及 FOF 工作。

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所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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 9 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报告期内基金投资策略和运作分析

A 股 3 季度，市场结构出现较大转变。成长板块尤其是科技板块大幅回调，红利板块则在 7 月有较大修复，而随后的 8、9 月份也缺乏较明确的主线，给全年投资运作增加了较大难度。美伊冲突短时间内结束的预期降低，而美债收益率持续上涨也压制全球整体风险偏好。大类资产方面，美股科技板块，原油商品以及国内长久期利率债较强势，黄金以震荡为主。

组合在上半年各类资产配置比较稳定，力求通过多资产框架控制回撤和组合波动率，提升投资者持有体验。

4.5 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-5.02%，同期业绩比较基准收益率为-2.28%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-5.10%，同期业绩比较基准收益率为-2.28%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

结合宏微观展望，围绕风险释放、风险收益比进行均衡配置，整体上以防守反击为主，降低反转预期。

组合将继续围绕基准以及收益回撤纪律约束暂无需大幅操作，依靠策略框架进行运行。A 股方面仍以回撤控制较好的量化基金以及指数增强基金为主，通过大类资产配置实现绝对收益目标

和回撤控制，淡化相对收益排名目标。

4.7报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

不适用。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	96,041,184.25	91.58
3	固定收益投资	5,522,646.44	5.27
	其中：债券	5,522,646.44	5.27
	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	1,841,626.39	1.76
8	其他各项资产	1,465,511.89	1.40
9	合计	104,870,968.97	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,522,646.44	5.27
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	5,522,646.44	5.27

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019835	26 国债 09	55,000	5,522,646.44	5.27

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，天弘基金管理有限公司、南方基金管理股份有限公司、易方达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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,724.20
2	应收证券清算款	1,444,563.99
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	11,223.70
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,465,511.89

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

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	009593	国泰中债 1-3 年国开债 A	开放式	19,000,000.00	19,682,100.00	18.79%	是
2	003517	国泰润利纯债债券 A	开放式	16,000,000.00	16,454,400.00	15.71%	是
3	011880	国泰中债 1-5 年政金债 A	开放式	10,962,112.22	11,813,868.34	11.28%	是
4	006961	南方中债 7-10 年国开行债券指数 A	开放式	6,504,822.19	8,797,121.53	8.40%	否
5	010390	易方达科益混合 C	开放式	3,385,662.01	6,317,983.88	6.03%	否
6	017155	民生加银专精特新智	开放式	3,555,725.24	5,638,313.51	5.38%	否

		选混合发起式 C					
7	588220	科创 100ETF 鹏华	开放式	2,507,300.00	4,174,654.50	3.98%	否
8	518800	国泰黄金 ETF	开放式	453,883.00	4,110,364.45	3.92%	是
9	017548	天弘国证 2000 指数增强 C	开放式	2,344,256.83	3,628,675.15	3.46%	否
10	019319	汇添富国证 2000 指数增强 C	开放式	1,727,832.09	3,267,503.27	3.12%	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用	其中：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
当期交易基金产生的申购费	1,476.38	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	3,763.15	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	32,340.63	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	106,663.73	32,898.30
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	21,894.76	9,461.08
当期交易基金产生的交易费（元）	1,875.13	449.15
当期交易基金产生的转换费（元）	1,092.24	-

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况，根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出。上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的

费用项目。根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰盈享配置6个月持有混合发起（FOF）A	国泰盈享配置6个月持有混合发起（FOF）C
本报告期期初基金份额总额	56,479,128.33	50,412,554.20
本报告期基金总申购份额	1,178,457.81	64,707.64
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	57,657,586.14	50,477,261.84

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,004,333.33
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,004,333.33
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	9.25

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	认购	2026-05-07	10,004,333.33	10,000,000.00	-
合计			10,004,333.33	10,000,000.00	

注：本基金管理人于本报告期内认购本基金的适用费用为0.00元。

§9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金	10,004,333.33	9.25%	10,004,333.33	9.25%	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	10,004,333.33	9.25%	10,004,333.33	9.25%	-

§10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 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。

§11 备查文件目录

11.1备查文件目录

1、关于准予国泰盈享配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）注册的批复

2、国泰盈享配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同

3、国泰盈享配置 6 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

11.2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。

基金托管人住所或办公场所。

11.3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

二〇二六年十月二十七日