# 国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金

# 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：中国银行股份有限公司**

**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。

基金托管人中国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 | 国泰鑫策略价值灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 002197 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 1 月 3 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 50,071,486.60 份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，追求稳健的投资回报。 |
| 投资策略 | 1、资产配置策略； 2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略； 4、固定收益类投资工具投资策略；5、中小企业私募债投资策略；6、资产支持证券投资策略； 7、权证投资策略； 8、股指期货投资策略；9、股票期权投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中债-综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+活期存款基准利率*5% |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 | | |
| 基金管理人 | 国泰基金管理有限公司 | | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 国泰鑫策略价值灵活配置混合 A | 国泰鑫策略价值灵活配置混合 C | 国泰鑫策略价值灵活配置混合 E |
| 下属分级基金的交易代码 | 002197 | 022784 | 022785 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 15,520,282.32 份 | 27,004,207.12 份 | 7,546,997.16 份 |

注：自2026年7月27日起本基金的业绩比较基准由“50%*沪深300指数收益率+50%*中证综合债指数收益率”变更为“中债-综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深300指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%”。

# §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) | | |
|---|---|---|---|
| | 国泰鑫策略价值灵活配置混合 A | 国泰鑫策略价值灵活配置混合 C | 国泰鑫策略价值灵活配置混合 E |
| 1.本期已实现收益 | 350,157.90 | 918,559.42 | 338,281.55 |
| 2.本期利润 | 210,406.33 | 762,746.69 | 247,454.20 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0138 | 0.0234 | 0.0189 |
| 4.期末基金资产净值 | 23,139,620.86 | 40,183,982.31 | 11,252,251.47 |
| 5.期末基金份额 | 1.4909 | 1.4881 | 1.4910 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 净值 | | | |

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、国泰鑫策略价值灵活配置混合 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 | 0.83% | 0.12% | -3.14% | 0.49% | 3.97% | -0.37% |
| 过去六个月 | 2.68% | 0.12% | 3.19% | 0.57% | -0.51% | -0.45% |
| 过去一年 | 3.84% | 0.09% | 1.88% | 0.52% | 1.96% | -0.43% |
| 过去三年 | 5.52% | 0.13% | 20.58% | 0.55% | -15.06% | -0.42% |
| 过去五年 | -3.80% | 0.18% | 10.02% | 0.55% | -13.82% | -0.37% |
| 过去七年 | 40.48% | 0.41% | 30.72% | 0.58% | 9.76% | -0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | 43.49% | 0.41% | 51.16% | 0.59% | -7.67% | -0.18% |

**2、国泰鑫策略价值灵活配置混合 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 | 0.81% | 0.12% | -3.14% | 0.49% | 3.95% | -0.37% |
| 过去六个月 | 2.63% | 0.12% | 3.19% | 0.57% | -0.56% | -0.45% |
| 过去一年 | 3.74% | 0.09% | 1.88% | 0.52% | 1.86% | -0.43% |
| 自新增 C 类份额起至今 | 6.30% | 0.08% | 11.11% | 0.50% | -4.81% | -0.42% |

**3、国泰鑫策略价值灵活配置混合 E：**

| 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 | 0.83% | 0.12% | -3.14% | 0.49% | 3.97% | -0.37% |
| 过去六个月 | 2.66% | 0.11% | 3.19% | 0.57% | -0.53% | -0.46% |
| 过去一年 | 3.80% | 0.09% | 1.88% | 0.52% | 1.92% | -0.43% |
| 自新增 E 类份额起至今 | 6.51% | 0.08% | 11.11% | 0.50% | -4.60% | -0.42% |

注：自2026年7月27日起本基金的业绩比较基准由“50%*沪深300指数收益率+50%*中证综合债指数收益率”变更为“中债-综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深300指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

### 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

国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019 年 1 月 3 日至 2026 年 9 月 30 日)

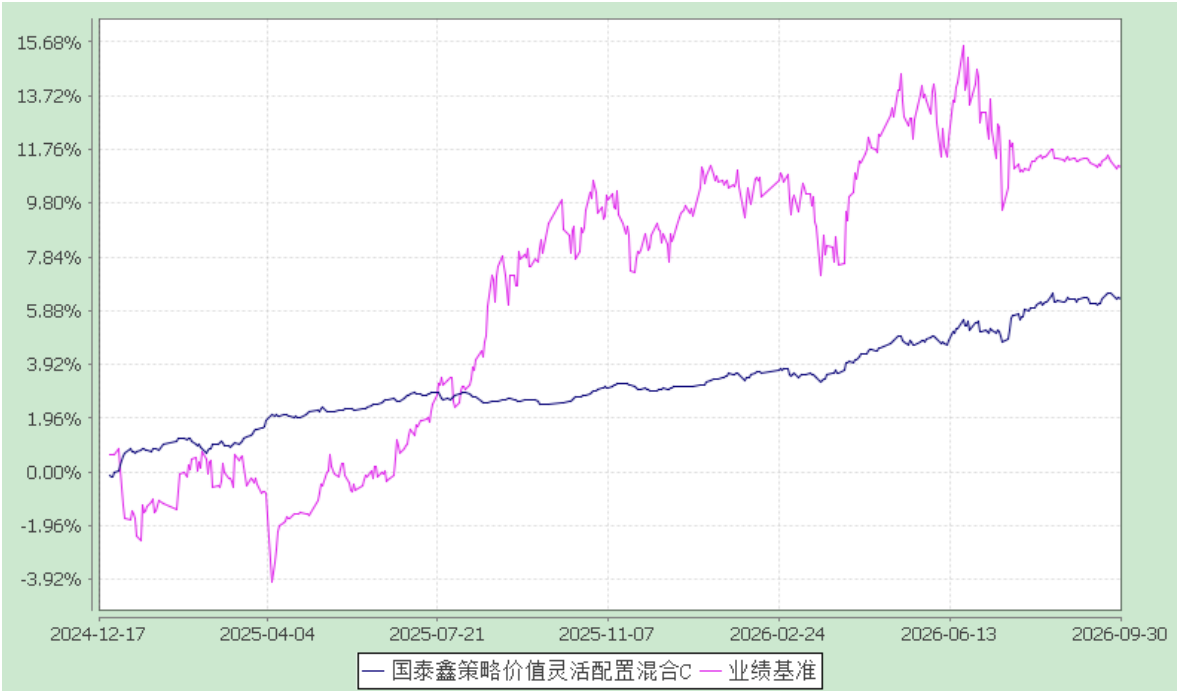
1．国泰鑫策略价值灵活配置混合 A：




注：（1）本基金合同生效日为 2019 年 1 月 3 日；

（2）自 2026 年 7 月 27 日起本基金的业绩比较基准由“50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率”变更为“中债-综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

2．国泰鑫策略价值灵活配置混合 C：




注：（1）本基金合同生效日为 2019 年 1 月 3 日；

（2）自 2024 年 12 月 17 日起，本基金增加 C 类份额并于 2024 年 12 月 24 日开始计算 C 类基金份额净值和基金份额累计净值；

（3）自 2026 年 7 月 27 日起本基金的业绩比较基准由“50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率”变更为“中债-综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

3．国泰鑫策略价值灵活配置混合 E：



注：（1）本基金合同生效日为 2019 年 1 月 3 日；

（2）自 2024 年 12 月 17 日起，本基金增加 E 类份额并于 2024 年 12 月 24 日开始计算 E 类基金份额净值和基金份额累计净值；

（3）自 2026 年 7 月 27 日起本基金的业绩比较基准由“50%*沪深 300 指数收益率+50%*中证综合债指数收益率”变更为“中债-综合财富（总值）指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

# §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 | | |
| 魏伟 | 国泰聚享纯债债券 、国泰瑞安三个月定期开放债券、国泰润鑫纯债债券、国泰聚瑞纯债债券、国泰聚禾纯债债券、国泰添瑞一年定期开放债券、国泰合融纯债 | 2024-09-03 | - | 11 年 | 硕士研究生。曾任职于上海光大证券资产管理有限公司，2020 年 3 月加入国泰基金，历任债券交易员。2023 年 3 月至 2026 年 2 月任国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2023 年 3 月起任国泰聚享纯债债券型证券投资基金、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰润鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰聚瑞纯债债券型证券投资基金和国泰聚禾纯债债券型证券投资基金的基金经理，2023 年 3 月至 2024 年 12 月任国泰润利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2023 年 5 月起兼任国泰添瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2023 年 6 月起兼任国泰合融纯债债券型证券投资基金的基金经理，2024 年 9 月起兼任国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2025 年 3 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 债券、国泰鑫策略价值灵活配置混合、国泰中债优选投资级信用债指数发起、国泰兴富三个月定期开放债券的基金经理 | | | | 月至 2026 年 4 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 5 月起兼任国泰中债优选投资级信用债指数发起式证券投资基金的基金经理，2026 年 7 月起兼任国泰兴富三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。 |
| 刘嵩扬 | 国泰农惠定期开放债券、国泰丰鑫纯债债券、国泰惠信三年定期开放债券、国泰聚盈三年定期开放债券、国泰合融纯债债券、国泰信利三个月定期开放债券、国泰瑞泰纯债债 | 2026-03-04 | - | 14 年 | 硕士研究生。曾任职于北京鹏扬投资管理有限公司、鹏扬基金管理有限公司、长江养老保险股份有限公司，2020 年 4 月加入国泰基金。2020 年 7 月起任国泰农惠定期开放债券型证券投资基金、国泰丰鑫纯债债券型证券投资基金、国泰惠信三年定期开放债券型证券投资基金、国泰聚盈三年定期开放债券型证券投资基金、国泰合融纯债债券型证券投资基金和国泰信利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2020 年 7 月至 2023 年 5 月任国泰添瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2021 年 8 月起兼任国泰瑞泰纯债债券型证券投资基金的基金经理，2021 年 12 月至 2023 年 6 月任国泰睿元一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2022 年 9 月至 2024 年 1 月任国泰睿鸿一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2023 年 5 月至 2026 年 8 月任国泰信瑞纯债债券型证券投资基金的基金经理，2023 年 7 月 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 券、国泰兴富三个月定期开放债券、国泰同益 18 个月持有期混合、国泰睿元一年定期开放债券发起式、国泰金龙债券、国泰丰盈纯债债券、国泰中债优选投资级信用债指数发起、国泰鑫策略价值灵活配置混合、国泰瑞丰纯债债券的基金经理、绝对收益投资部副总监 | | | | 起兼任国泰兴富三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2023 年 11 月起兼任国泰同益 18 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理，2024 年 5 月起兼任国泰睿元一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2024 年 8 月起兼任国泰金龙债券证券投资基金的基金经理，2025 年 3 月起兼任国泰丰盈纯债债券型证券投资基金的基金经理，2025 年 5 月起兼任国泰中债优选投资级信用债指数发起式证券投资基金的基金经理，2026 年 3 月起兼任国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2026 年 10 月起兼任国泰瑞丰纯债债券型证券投资基金的基金经理。2026 年 10 月起任绝对收益投资部副总监。 |

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报告期内基金的投资策略和业绩表现说明**

**4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

三季度债券市场资金利率维持稳定，收益率稳步下行，但权益市场冲高回落波动放大；组合在三季度内维持中性偏高配置，久期保持在 3 附近波动，杠杆保持在偏低水平；纯债部分配置资产主要以短久期信用债和长久期利率债为主；权益部分仓位维持在 2-5%之间，个股以红利、科技等均衡配置为主。全季度来看收益主要来源于债券的票息收入和资本利得，权益部分对组合造成了一定的负收益但由于仓位较低整体可控。

**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 0.83%，同期业绩比较基准收益率为-3.14%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为 0.81%，同期业绩比较基准收益率为-3.14%。

本基金 E 类本报告期内的净值增长率为 0.83%，同期业绩比较基准收益率为-3.14%。

**4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明**

本基金自本报告期初至 2026 年 07 月 13 日期间存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

# §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 | 2,086,385.00 | 2.13 |
| | 其中：股票 | 2,086,385.00 | 2.13 |
| 2 | 固定收益投资 | 70,935,073.56 | 72.54 |
| | 其中：债券 | 70,935,073.56 | 72.54 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 21,262,964.61 | 21.74 |
| 7 | 其他各项资产 | 3,508,687.52 | 3.59 |
| 8 | 合计 | 97,793,110.69 | 100.00 |

**5.2报告期末按行业分类的股票投资组合**

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值 |
|---|---|---|---|

| | | | 比例（%） |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,099,803.00 | 1.47 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 201,940.00 | 0.27 |
| 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 | 138,000.00 | 0.19 |
| J | 金融业 | 646,642.00 | 0.87 |
| 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 | 2,086,385.00 | 2.80 |

**5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601601 | 中国太保 | 8,200 | 254,692.00 | 0.34 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 4,500 | 239,805.00 | 0.32 |
| 3 | 600642 | 申能股份 | 23,000 | 201,940.00 | 0.27 |
| 4 | 300308 | 中际旭创 | 200 | 161,688.00 | 0.22 |
| 5 | 601336 | 新华保险 | 2,700 | 152,145.00 | 0.20 |
| 6 | 600276 | 恒瑞医药 | 3,100 | 146,320.00 | 0.20 |
| 7 | 601058 | 赛轮轮胎 | 11,000 | 145,640.00 | 0.20 |
| 8 | 002602 | 世纪华通 | 10,000 | 138,000.00 | 0.19 |
| 9 | 600426 | 华鲁恒升 | 7,000 | 136,010.00 | 0.18 |
| 10 | 002126 | 银轮股份 | 4,000 | 135,800.00 | 0.18 |

**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 | 20,595,950.82 | 27.62 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 17,759,538.79 | 23.81 |
| | 其中：政策性金融债 | 4,832,386.19 | 6.48 |
| 4 | 企业债券 | 27,464,394.91 | 36.83 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 5,115,189.04 | 6.86 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 70,935,073.56 | 95.12 |

**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 | 2600004 | 26超长特别国债 04 | 200,000 | 20,595,950.82 | 27.62 |
| 2 | 185147 | 21 平证 Y1 | 55,000 | 5,661,510.74 | 7.59 |
| 3 | 152413 | 20 陕煤一 | 50,000 | 5,140,992.60 | 6.89 |
| 4 | 102481289 | 24 新津交通 MTN001A | 50,000 | 5,115,189.04 | 6.86 |
| 5 | 240416 | 23 中金 G7 | 50,000 | 5,104,201.37 | 6.84 |

**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**

**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

| 代码 | 名称 | 持仓量 | 合约市值(元) | 公允价值变动(元) | 风险说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| IF2612 | IF2612 | 2.00 | 2,579,640.00 | -63,360.00 | 套保 |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | -63,360.00 |
| 股指期货投资本期收益(元) | | | | | -129,179.92 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | -77,460.00 |

**5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、合约选择，谨慎地进行投资，旨在通过股指期货实现组合风险敞口管理的目标。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

**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，国家开发银行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 基金投资的前十名证券中，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 | 315,928.28 |

| | | |
|---|---|---|
| 2 | 应收证券清算款 | 2,500,000.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 674,159.24 |
| 6 | 其他应收款 | 18,600.00 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 3,508,687.52 |

**5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有可转换债券。

**5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

# §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 国泰鑫策略价值灵活配置混合A | 国泰鑫策略价值灵活配置混合C | 国泰鑫策略价值灵活配置混合E |
|---|---|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 11,609,425.29 | 3,458,406.63 | 5,718,173.13 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 4,746,208.07 | 56,436,838.86 | 13,075,968.33 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 835,351.04 | 32,891,038.37 | 11,247,144.30 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - | - | - |
| 本报告期期末基金份 | 15,520,282.32 | 27,004,207.12 | 7,546,997.16 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 额总额 | | | |

# §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

## 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

# §8 影响投资者决策的其他重要信息

## 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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。

# §9 备查文件目录

## 9.1备查文件目录

1、国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同

2、国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议

3、关于准予国泰鑫保本混合型证券投资基金注册的批复

4、报告期内披露的各项公告

5、法律法规要求备查的其他文件

## 9.2存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦15-20层。

基金托管人住所或办公场所。

## 9.3查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：http://www.gtfund.com

国泰基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日