国泰量化收益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：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。

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 9 月 21 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。修订后的基金合同等法律文件自 2026 年 9 月 21 日起生效。具体可查阅本基金管理人于 2026 年 8 月 22 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 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国泰量化收益灵活配置混合
基金主代码	001789
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 5 月 19 日
报告期末基金份额总额	33,370,228.90 份
投资目标	本基金主要以数量化投资技术为基础，并辅以基本面研究，严格控制下行风险，以期实现基金资产的持续稳健增长。

投资策略	本基金采用自主开发的量化风险模型对中短期市场的系统性风险进行判断，从而决定本基金在股票、债券和现金等金融工具上的投资比例，并充分利用股指期货作为对冲工具；在股票选择方面，本基金采用量化多因子选股系统和基本面研究相结合的方式进行股票选择和投资，多维度地分析股票的投资价值，精选具有较高投资价值的上市公司构建本基金的多头组合。 本基金主要投资策略包括：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。	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%	
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	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国泰量化收益灵活配置混合 A	国泰量化收益灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	001789	011907
报告期末下属分级基金的份额总额	21,013,551.52 份	12,356,677.38 份

注：自2026年9月21日起本基金的业绩比较基准由“沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%”变更为“中证800指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%”。

§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)

	国泰量化收益灵活配置混合 A	国泰量化收益灵活配置混合 C
1.本期已实现收益	-1,160,958.21	-606,718.94
2.本期利润	436,158.64	289,416.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0205	0.0237
4.期末基金资产净值	31,818,993.26	18,414,310.91
5.期末基金份额净值	1.5142	1.4902

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、国泰量化收益灵活配置混合 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	1.49%	1.40%	-8.27%	0.81%	9.76%	0.59%
过去六个月	3.15%	1.30%	-1.37%	0.79%	4.52%	0.51%
过去一年	10.68%	1.23%	-3.39%	0.69%	14.07%	0.54%
过去三年	53.45%	1.32%	15.98%	0.69%	37.47%	0.63%
过去五年	12.61%	1.20%	1.94%	0.67%	10.67%	0.53%
过去七年	40.20%	1.06%	22.91%	0.71%	17.29%	0.35%
自基金合同生效起至今	61.10%	1.01%	38.08%	0.71%	23.02%	0.30%

2、国泰量化收益灵活配置混合 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	1.42%	1.40%	-8.27%	0.81%	9.69%	0.59%
过去六个月	3.03%	1.30%	-1.37%	0.79%	4.40%	0.51%
过去一年	10.40%	1.23%	-3.39%	0.69%	13.79%	0.54%
过去三年	51.88%	1.32%	15.98%	0.69%	35.90%	0.63%

过去五年	10.93%	1.20%	1.94%	0.67%	8.99%	0.53%
自新增 C 类份额起至今	11.68%	1.16%	0.95%	0.67%	10.73%	0.49%

注：自2026年9月21日起本基金的业绩比较基准由“沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%”变更为“中证800指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%”。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

国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017 年 5 月 19 日至 2026 年 9 月 30 日)

1．国泰量化收益灵活配置混合 A：



注：（1）本基金合同生效日为 2017 年 5 月 19 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。

（2）自 2026 年 9 月 21 日起本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%”变更为“中证 800 指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%”。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．国泰量化收益灵活配置混合 C：



注：（1）本基金合同生效日为 2017 年 5 月 19 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。

（2）自 2021 年 4 月 9 日起，本基金增加 C 类基金份额并分别设置对应的基金代码。

（3）自 2026 年 9 月 21 日起本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%”变更为“中证 800 指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%”。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		
梁杏	国泰中证生物医药 ETF 联接、国泰国证医药卫生行业	2018-07-31	-	19 年	学士。2007 年 7 月至 2011 年 6 月在华安基金管理有限公司担任高级区域经理。2011 年 7 月加入国泰基金，历任产品品牌经理、研究员、基金经理助理。2016 年 6 月至 2020 年 12 月任国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金和国泰国证食品饮料行业指数分级

	指数、国泰国证食品饮料行业指数、国泰量化收益灵活配置混合、国泰中证生物医药 ETF、国泰 CES 半导体芯片行业 ETF 联接、国泰上证综合 ETF、国泰中证医疗 ETF、国泰中证畜牧养殖 ETF、国泰中证医疗 ETF 联接、国泰中证畜牧养殖 ETF 联接、国泰中证沪港深创新药产业 ETF、国泰中证沪港深				证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月至 2019 年 4 月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 7 月起兼任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 4 月起兼任国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金和国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 11 月起兼任国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更名而来）的基金经理，2020 年 1 月至 2021 年 1 月任国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 8 月起兼任国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 12 月起兼任国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 1 月起兼任国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（由国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰国证食品饮料行业指数证券投资基金（由国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）的基金经理，2021 年 1 月至 2022 年 2 月任国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021 年 2 月至 2022 年 2 月任国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 3 月起兼任

	创新药产业 ETF 发起联接、国泰沪深 300 增强策略 ETF、国泰富时中国国企开放共赢 ETF 的基金经理、国泰中证港股通科技 ETF、国泰中证港股通互联网 ETF 的基金经理，量化投资部总监				国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 6 月起兼任国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021 年 6 月至 2026 年 3 月任国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021 年 7 月起兼任国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021 年 9 月起兼任国泰中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 11 月起兼任国泰中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2021 年 12 月起兼任国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金和国泰富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2022 年 1 月起兼任国泰中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 6 月至 2025 年 7 月任国泰中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 6 月至 2025 年 3 月任国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 5 月至 2026 年 5 月任国泰中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 12 月起兼任国泰中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月至 2018 年 7 月任量化投资部副总监，2018 年 7 月起任量化投资部总监。
吴可凡	国泰量化收益灵活配置混合、国	2023-06-07	-	7 年	硕士研究生。2019 年 6 月加入国泰基金，历任助理量化研究员、量化研究员、基金经理助理。2023 年 6 月起任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经

	泰国证信息技术创新主题 ETF 发起联接、国泰中证油气产业 ETF 发起联接、国泰中证智能汽车主题 ETF、国泰中证香港内地国有企业 ETF 发起联接（QDII）、国泰上证国有企业红利 ETF 发起联接、国泰中证沪深港黄金产业股票 ETF 发起联接、国泰中证港股通高股息投资 ETF 发起联接、国				理，2023 年 8 月至 2024 年 11 月任国泰中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2023 年 9 月至 2024 年 9 月任国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2023 年 9 月至 2024 年 11 月任国泰中证半导体材料设备主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2023 年 12 月至 2026 年 9 月任国泰中证全指集成电路交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰中证机器人交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2023 年 12 月起兼任国泰国证信息技术创新主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金和国泰中证油气产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2024 年 4 月起兼任国泰中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理，2024 年 4 月至 2025 年 1 月任国泰中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2024 年 6 月起兼任国泰上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2024 年 7 月起兼任国泰中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2024 年 10 月起兼任国泰中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2024 年 11 月起兼任国泰中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2025 年 9 月起兼任国泰聚鑫量化

	泰中证A500ETF 发起联接、国泰聚鑫量化选股混合发起、国泰聚智量化选股混合发起、国泰农盈债券的基金经理				选股混合型发起式证券投资基金和国泰聚智量化选股混合型发起式证券投资基金的基金经理，2026 年 7 月起兼任国泰农盈债券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

2026 年三季度，A 股在上半年极致分化后，进入风格再平衡阶段，科技与非科技行情明显收敛，行业层面呈现明显的高低切换、结构趋于均衡。具体而言，三季度 A 股调整是海外宏观扰动、AI 远期预期反复与科技板块筹码出清共同作用的结果。

宏观层面，7 月中东局势反复推升油价，市场重新担忧美国通胀及全球流动性收紧，长端美债利率持续上行；8 月美国就业和通胀数据一度缓解紧缩预期，为风险资产提供短暂的修复窗口；但 9 月油价再度走高，美联储加息 25bp 后，市场进一步担心高利率维持更久，10 年期美债收益率于月末升至较高位置，持续压制全球风偏。

中观层面，AI 产业的即期景气并未明显转弱，但市场关注点已从需求高增长，转向云厂商资本开支能否持续、投入何时转化为收入与自由现金流；9 月头部 AI 公司负责人呼吁放缓前沿模型研发，进一步扰动远期算力需求预期，使产业景气的验证难以完全抵消估值压力。

微观层面，上半年科技板块持续领涨，积累了较高的拥挤度和融资杠杆；7 月海外科技股去杠杆、国内融资盘降仓及大型 IPO 带来的仓位腾挪，推动科技板块快速下跌。8 月随着杠杆去化、拥挤度缓和，市场在 3800 点附近出现超跌修复；但 9 月科技主线再度走弱，其他板块未能形成持续接力，轮动加快，临近长假成交进一步萎缩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类本报告期内的净值增长率为 1.49%，同期业绩比较基准收益率为-8.27%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为 1.42%，同期业绩比较基准收益率为-8.27%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，三季度经历较大调整后，部分资产的估值压力有所缓解，但若要市场再次形成上行动力，仍需盈利预期、需求状况和资金环境进一步配合。四季度的观察重点，一是美联储加息如何演绎，二是 A 股盈利能否延续上行。如果上述因素出现正向演绎，四季度 A 股将存在阶段性机会。具体板块层面，三季度科技回调后不再具备资金虹吸能力，市场由上半年科技的“一枝独秀”转向多板块的“百花齐放”，无论是 AI 产业中具备性价比的方向、非 AI 产业链的高景气方向，还是基本面弹性较弱的消费与稳定红利方向，都可以保持关注。

4.6 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 2026 年 07 月 07 日至 2026 年 08 月 04 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	43,868,917.62	86.99
	其中：股票	43,868,917.62	86.99
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	6,497,382.99	12.88

7	其他各项资产	61,836.69	0.12
8	合计	50,428,137.30	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	1,448,336.00	2.88
C	制造业	35,018,978.62	69.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	469,276.00	0.93
E	建筑业	355,343.00	0.71
F	批发和零售业	1,231,421.00	2.45
G	交通运输、仓储和邮政业	836,950.00	1.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,144,606.00	2.28
J	金融业	712,548.00	1.42
K	房地产业	294,685.00	0.59
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	684,500.00	1.36
N	水利、环境和公共设施管理业	633,800.00	1.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	207,642.00	0.41
Q	卫生和社会工作	523,498.00	1.04
R	文化、体育和娱乐业	307,334.00	0.61
S	综合	-	-
	合计	43,868,917.62	87.33

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	002648	卫星化学	27,600	731,676.00	1.46
2	688313	仕佳光子	4,200	648,816.00	1.29
3	603638	艾迪精密	32,600	646,132.00	1.29

4	688301	奕瑞科技	7,300	607,360.00	1.21
5	688257	新锐股份	11,200	600,096.00	1.19
6	300298	三诺生物	34,800	567,240.00	1.13
7	688052	纳芯微	2,400	567,168.00	1.13
8	603883	老百姓	37,700	491,608.00	0.98
9	603416	信捷电气	10,500	483,105.00	0.96
10	688309	恒誉科技	6,500	481,000.00	0.96

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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，苏州新锐合金工具股份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 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	10,732.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	32,504.68
6	其他应收款	18,600.00
7	其他	-
8	合计	61,836.69

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	国泰量化收益灵活配置混合A	国泰量化收益灵活配置混合C
本报告期期初基金份额总额	21,722,761.82	11,805,859.27
报告期期间基金总申购份额	204,114.45	3,146,359.57
减：报告期期间基金总赎回份额	913,324.75	2,595,541.46
报告期期间基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	21,013,551.52	12,356,677.38

§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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	9,180,632.55
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	9,180,632.55
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	27.51

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026 年 07 月 01 日至 2026 年 09 月 30 日	9,180,632.55	-	-	9,180,632.55	27.51%
	2	2026 年 07 月 01 日至 2026 年 09 月 30 日	8,937,068.16	-	1,600,000.00	7,337,068.16	21.99%
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、关于准予国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金注册的批复

2、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同

3、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金托管协议

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

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