

# 国泰量化策略收益混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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：二〇二四年八月三十日

## 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，并由董事长签发。

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 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>2 基金简介</b>	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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	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	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
<b>5 托管人报告</b>	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
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	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
<b>7 投资组合报告</b>	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50
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	50
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	50
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.11 投资组合报告附注	50
<b>8 基金份额持有人信息</b>	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52

8.3 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
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
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 .....	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	55
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>55</b>
<b>12 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
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	195,983,984.08 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	160,955,286.21 份	35,028,697.87 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	刘国华	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gtfund.com">http://www.gtfund.com</a>
基金中期报告备置地点	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（2024年1月1日至2024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	1,657,219.33	-442,807.55
本期利润	-2,117,226.06	-1,362,063.99
加权平均基金份额本期利润	-0.0204	-0.2180
本期加权平均净值利润率	-1.44%	-16.10%
本期基金份额净值增长率	2.55%	2.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024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	41,992,243.79	3,054,586.48
期末可供分配基金份额利润	0.2609	0.0872
期末基金资产净值	191,880,221.69	41,112,099.70

期末基金份额净值	1.1921	1.1737
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 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	35.39%	-9.06%

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
过去一个月	-4.53%	0.62%	-2.27%	0.36%	-2.26%	0.26%
过去三个月	-3.13%	0.69%	-1.15%	0.56%	-1.98%	0.13%
过去六个月	2.55%	0.82%	1.72%	0.67%	0.83%	0.15%
过去一年	-6.29%	0.78%	-6.01%	0.65%	-0.28%	0.13%
过去三年	-31.89%	1.01%	-23.22%	0.78%	-8.67%	0.23%
自基金合同生效起至今	35.39%	1.12%	20.48%	0.89%	14.91%	0.23%

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
过去一个月	-4.56%	0.62%	-2.27%	0.36%	-2.29%	0.26%
过去三个月	-3.36%	0.69%	-1.15%	0.56%	-2.21%	0.13%
过去六个月	2.10%	0.82%	1.72%	0.67%	0.38%	0.15%
过去一年	-7.12%	0.78%	-6.01%	0.65%	-1.11%	0.13%
自新增 C 类份额起至今	-9.06%	0.88%	-7.41%	0.71%	-1.65%	0.17%

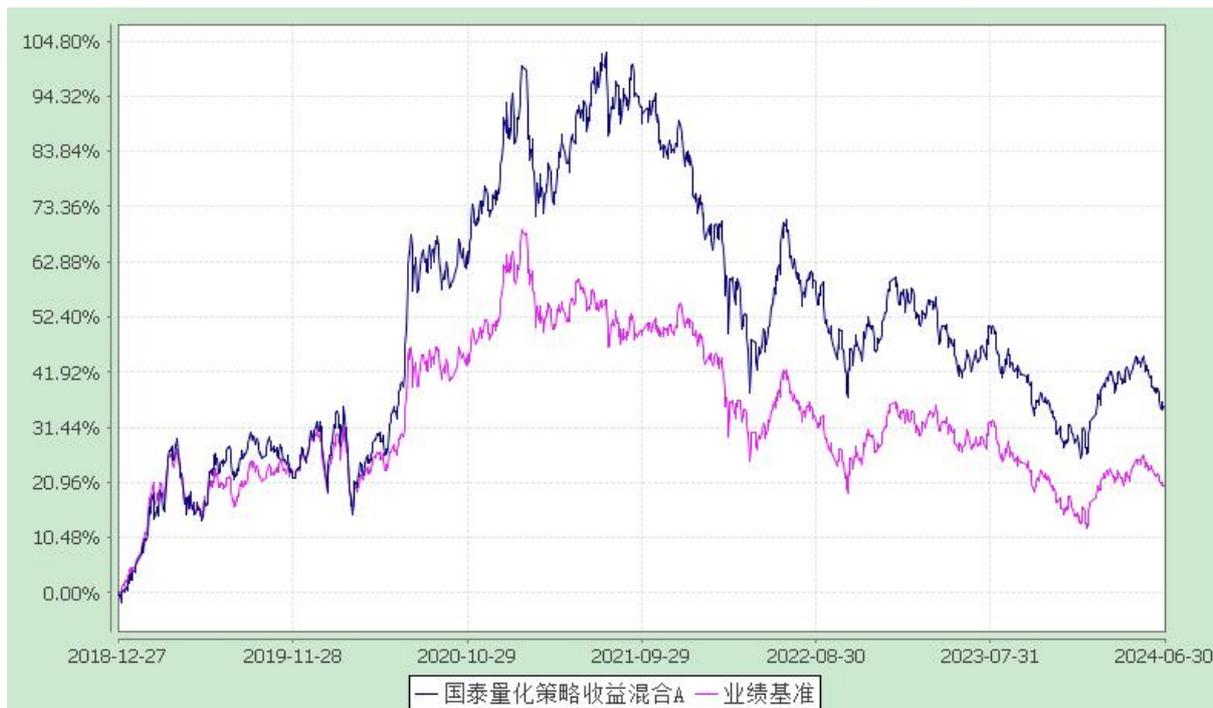
#### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 2024 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 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 266 只开放式证券投资基金。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、国泰民裕进取灵活配置混合、国泰诚益混合、国泰国策驱动灵活配置混合的基金经理	2018-12-27	-	14 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,拟任基金经理。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 月起兼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 月起兼任国泰诚

					益混合型证券投资基金的基金经理，2024 年 6 月起兼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。
贺天元	国泰量化策略收益混合的基金经理	2022-05-06	-	8 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。

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，本基金组合与其他投资组合之间，由于组合流动性管理或投资策略调整需要，参

与的交易所公开竞价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% 的交易次数为 1 次。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

2024 年上半年上证综指涨-0.25%，沪深 300 涨 0.89%，创业板指涨-10.99%。上半年深度价值的行业持续有表现，体现出经济弱预期下的避险心理，上涨行业上主要是银行、煤炭、公用事业、资源品等，汽车和通信行业中，一些出口占比高的公司订单增速高，也有不错的收益表现。

二季度国内 GDP 实际同比为 4.7%，较一季度回落 0.6 个百分点；季调后环比为 0.7%，较一季度回落 0.9 个百分点，经济出现明显走弱。二季度第二产业增速同比为 5.6%，较一季度回落 0.4 个百分点；第三产业增速为 4.2%，较一季度回落 0.8 个百分点。经济的减速比较普遍，服务业下行的压力更大。

价格层面，6 月 PPI 环比为-0.2%，较上月回落 0.4 个百分点。汽车、计算机、医药和纺织等下游行业 PPI 环比负增长。从工业增速和 PPI 环比表现来看，量价齐跌的组合表明工业领域需求趋于收缩。6 月服务业生产指数当月同比 4.7%，较上月小幅回落 0.1 个百分点，仍然处于偏低区间。观察与服务业联系密切的 CPI 数据。除了食品分项外，CPI 的多数分项表现弱于季节性，这表明服务业领域的需求也在收缩。合并工业、服务业的量价数据来看，当前总需求收缩的趋势清晰，财政收支压力、房地产下行问题对总需求形成较大冲击，经济的企稳依赖于政策应对。

出口是上半年经济亮点。6 月我国美元计价出口同比增速 8.6%，较 5 月大幅回升 5.9 个百分点，对美国、日本、欧盟等经济体的出口出现广泛上升。全球制造业 PMI 上行，显示中国出口的回升更多受益于全球制造业活动的复苏，这一复苏进程有望在下半年对我国出口活动形成支撑。

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 2.55%，同期业绩比较基准收益率为 1.72%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为 2.10%，同期业绩比较基准收益率为 1.72%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

最新公布的数据表明经济基本面仍在下行趋势中，企业盈利的企稳尚需时间。而当前财政政策在收支压力的背景下对经济的支撑有限，货币政策受制于汇率难以转向宽松，同时央行有引导利率上行的倾向。在这样的环境下，市场对经济加速下行的担忧升温，风险偏好持续回落。

在内需被创造、激发之前，市场仍会延续避险交易，同时试探结构性机会，例如地产拐点、出海、消费降级、科技股的机会，在高股息资产和估值低位机会之间平衡。在这样的背景下，继续关注周期上游的油、铜、煤炭、有色的投资机会，以及传统制造业龙头公司，包括船舶制造、重卡、钢铁、化工、家电。策略角度看，如下一些线索能够应对可能的机会：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，市场目前仍然是价值策略更有效的状态，在足够大量的成长股走出之前，防御性策略的优势仍然存在，当然需要谨慎资金把高股息股票推的太高带来的回调风险。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。3) 出海优选：内需疲软但外需较好，美国居民超额储蓄已经被耗尽，但是财政支持下的制造业景气还能维持，美国无论民主党还是共和党上台，持续的基建、制造业投入是两党共识，同时全球南方国家明确进入工业化，对中间品、资本品和消费品的需求旺盛。4) 央国企优选，今年是央国企提升经营效率，提振资本市场回报的关键一年，较多央国企本身就是资源股、高股息股，估值合理，具有提高分红或者回购的预期，其整体表现值得期待。

#### 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银行进行复核。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

本基金管理人根据本基金基金合同和相关法律法规的规定已于 2024 年 6 月 21 日进行利润分配，A 类份额每 10 份基金份额派发红利为 2.154 元，C 类份额每 10 份基金份额派发红利为 2.121 元。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的真实、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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	17,511,037.70	4,017,993.96
结算备付金		1,517,930.44	637,686.81
存出保证金		40,205.59	31,738.23
交易性金融资产	6.4.7.2	214,445,217.69	125,322,638.70
其中：股票投资		214,445,217.69	119,136,035.41
基金投资		-	-
债券投资		-	6,186,603.29
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,989.50	609.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		233,520,380.92	130,010,666.95
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付赎回款		47,517.07	7,075.23
应付管理人报酬		241,137.60	130,539.28
应付托管费		40,189.63	21,756.56
应付销售服务费		18,510.59	1,304.88
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	180,704.64	204,376.05
负债合计		528,059.53	365,052.00
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	171,021,934.18	80,247,813.35
未分配利润	6.4.7.8	61,970,387.21	49,397,801.60
净资产合计		232,992,321.39	129,645,614.95
负债和净资产总计		233,520,380.92	130,010,666.95

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 195,983,984.08 份，其中 A 类基金份额净值 1.1921 元，份额总额 160,955,286.21 份；C 类基金份额净值 1.1737 元，份额总额 35,028,697.87 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至
----	-----	-----------------------	----------------------------

		2024 年 6 月 30 日	2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-2,307,552.44	-5,427,031.78
1.利息收入		27,958.69	28,303.52
其中：存款利息收入	6.4.7.9	27,958.69	28,303.52
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）		2,317,575.55	-8,417,956.77
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-731,482.28	-10,873,999.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	35,277.10	31,717.45
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	-	-
股利收益	6.4.7.13	3,013,780.73	2,424,325.04
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	-4,693,701.83	2,960,623.10
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	40,615.15	1,998.37
<b>减：二、营业总支出</b>		1,171,737.61	1,755,893.64
1. 管理人报酬		916,824.62	1,379,148.25
2. 托管费		152,804.11	229,858.04
3. 销售服务费		24,856.88	57,452.20
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.16	77,252.00	89,435.15
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-3,479,290.05</b>	<b>-7,182,925.42</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-3,479,290.05</b>	<b>-7,182,925.42</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-3,479,290.05</b>	<b>-7,182,925.42</b>

### 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	80,247,813.35	49,397,801.60	129,645,614.95
二、本期期初净资产	80,247,813.35	49,397,801.60	129,645,614.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	90,774,120.83	12,572,585.61	103,346,706.44
（一）、综合收益总额	-	-3,479,290.05	-3,479,290.05
（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）	90,774,120.83	54,846,173.32	145,620,294.15
其中：1.基金申购款	121,055,784.69	73,061,590.21	194,117,374.90
2.基金赎回款	-30,281,663.86	-18,215,416.89	-48,497,080.75
（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）	-	-38,794,297.66	-38,794,297.66
四、本期期末净资产	171,021,934.18	61,970,387.21	232,992,321.39
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	84,937,278.38	69,396,864.29	154,334,142.67
二、本期期初净资产	84,937,278.38	69,396,864.29	154,334,142.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	21,213,821.15	7,293,701.80	28,507,522.95
（一）、综合收益总额	-	-7,182,925.42	-7,182,925.42
（二）、本期基金	21,213,821.15	14,476,627.22	35,690,448.37

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	35,825,723.42	26,121,028.72	61,946,752.14
2.基金赎回款	-14,611,902.27	-11,644,401.50	-26,256,303.77
（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	106,151,099.53	76,690,566.09	182,841,665.62

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：倪莹，会计机构负责人：吴洪涛

## 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期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》自同一日起失效。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规定，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 2024 年 8 月 28 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰量化策略收益混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 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]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[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[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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。

(2)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。

(3)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。

(4)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。

(5)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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	17,511,037.70
等于：本金	17,508,778.40
加：应计利息	2,259.30
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	17,511,037.70

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		225,162,292.38	-	214,445,217.69	-10,717,074.69
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		225,162,292.38	-	214,445,217.69	-10,717,074.69

#### 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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	36.16
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	103,591.48

其中：交易所市场	103,591.48
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	77,077.00
合计	180,704.64

#### 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	92,711,298.02	78,332,724.66
本期申购	92,406,495.93	78,075,821.39
本期赎回（以“-”号填列）	-24,162,507.74	-20,415,309.74
本期末	160,955,286.21	135,993,236.31

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

国泰量化策略收益混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,915,088.69	1,915,088.69
本期申购	42,979,963.30	42,979,963.30
本期赎回（以“-”号填列）	-9,866,354.12	-9,866,354.12
本期末	35,028,697.87	35,028,697.87

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	41,487,278.73	7,230,275.06	48,717,553.79

本期期初	41,487,278.73	7,230,275.06	48,717,553.79
本期利润	1,657,219.33	-3,774,445.39	-2,117,226.06
本期基金份额交易产生的变动数	30,212,604.34	10,438,911.92	40,651,516.26
其中：基金申购款	41,598,296.42	12,975,742.92	54,574,039.34
基金赎回款	-11,385,692.08	-2,536,831.00	-13,922,523.08
本期已分配利润	-31,364,858.61	-	-31,364,858.61
本期末	41,992,243.79	13,894,741.59	55,886,985.38

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	530,971.36	149,276.45	680,247.81
本期期初	530,971.36	149,276.45	680,247.81
本期利润	-442,807.55	-919,256.44	-1,362,063.99
本期基金份额交易产生的变动数	10,395,861.72	3,798,795.34	14,194,657.06
其中：基金申购款	13,176,836.33	5,310,714.54	18,487,550.87
基金赎回款	-2,780,974.61	-1,511,919.20	-4,292,893.81
本期已分配利润	-7,429,439.05	-	-7,429,439.05
本期末	3,054,586.48	3,028,815.35	6,083,401.83

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	20,013.65
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	7,706.43
其他	238.61
合计	27,958.69

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	495,022,120.82
减：卖出股票成本总额	495,277,168.62
减：交易费用	476,434.48
买卖股票差价收入	-731,482.28

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	38,882.60
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,605.50
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	35,277.10

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,224,472.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,103,202.50
减：应计利息总额	124,875.89
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-3,605.50

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,013,780.73
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	3,013,780.73

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期

	2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-4,693,701.83
——股票投资	-4,696,294.33
——债券投资	2,592.50
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	-
合计	-4,693,701.83

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	37,304.34
转换费收入	3,310.81
合计	40,615.15

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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	17,404.66
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	175.00
合计	77,252.00

### 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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	916,824.62	1,379,148.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	122,825.47	193,528.95
应支付基金管理人的净管理费	793,999.15	1,185,619.30

注：自 2023 年 07 月 24 日起，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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日
----	--------------------------------	-------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	152,804.11	229,858.04
----------------	------------	------------

注：自 2023 年 07 月 24 日起，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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

### 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 2024年1月1日至2024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	-	24,189.08	24,189.08
合计	-	24,189.08	24,189.08
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	-	2,382.05	2,382.05
合计	-	2,382.05	2,382.05

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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

### 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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间
----	----------------------------	---------

	2023年1月1日至2023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	-	0.03%	-	0.05%

#### 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		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023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
中国建设银行	17,511,037.70	20,013.65	3,488,458.83	20,408.86

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

国泰量化策略收益混合 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
1	2024-06-21	2024-06-21	2.154	11,811,177.70	19,553,680.91	31,364,858.61	-
合计			2.154	11,811,177.70	19,553,680.91	31,364,858.61	-

国泰量化策略收益混合 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
1	2024-06-21	2024-06-21	2.121	7,428,623.89	815.16	7,429,439.05	-
合计			2.121	7,428,623.89	815.16	7,429,439.05	-

#### 6.4.12 期末（2024 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
603350	安乃达	2024-06-26	1 个月内(含)	网下中签流通受限	20.56	20.56	1,051.00	21,608.56	21,608.56	-
60328	键邦	2024-0	1 个月	网下	18.65	18.65	1,105.	20,608	20,608	-

5	股份	6-28	内 (含)	中签 流通 受限			00	.25	.25	
30158 0	爱迪 特	2024-0 6-19	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	44.95	65.93	138.00	6,203. 10	9,098. 34	-
68869 2	达梦 数据	2024-0 6-04	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	86.96	174.93	42.00	3,652. 32	7,347. 06	-
68869 1	灿芯 股份	2024-0 4-02	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	19.86	42.51	121.00	2,403. 06	5,143. 71	-
68869 5	中创 股份	2024-0 3-06	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	22.43	31.55	127.00	2,848. 61	4,006. 85	-
68870 9	成都 华微	2024-0 1-31	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	15.69	18.79	213.00	3,341. 97	4,002. 27	-
60338 1	永臻 股份	2024-0 6-19	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	23.35	25.13	97.00	2,264. 95	2,437. 61	-
60103 3	永兴 股份	2024-0 1-11	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	16.20	15.96	148.00	2,397. 60	2,362. 08	-
60334 1	龙旗 科技	2024-0 2-23	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	26.00	37.49	60.00	1,560. 00	2,249. 40	-
60308 2	北自 科技	2024-0 1-23	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	21.28	29.49	48.00	1,021. 44	1,415. 52	-
60332 5	博隆 技术	2024-0 1-03	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	72.46	68.06	20.00	1,449. 20	1,361. 20	-
60334 4	星德 胜	2024-0 3-13	6 个月 以上	新股 锁定	19.18	22.66	59.00	1,131. 62	1,336. 94	-

				流通受限						
603375	盛景微	2024-01-17	6 个月以上	新股锁定流通受限	38.18	38.90	31.00	1,183.58	1,205.90	-
603312	西典新能	2024-01-04	6 个月以上	新股锁定流通受限	29.02	25.36	44.00	1,276.88	1,115.84	-

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因暂时停牌等流通受限的股票。

#### 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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 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 2024 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2023 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 2024 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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 2024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	17,511,037.70	-	-	-	17,511,037.70
结算备付金	1,517,930.44	-	-	-	1,517,930.44
存出保证金	40,205.59	-	-	-	40,205.59
交易性金融资产	-	-	-	214,445,217.69	214,445,217.69
应收申购款	-	-	-	5,989.50	5,989.50
资产总计	19,069,173.73	-	-	214,451,207.19	233,520,380.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	47,517.07	47,517.07
应付管理人报酬	-	-	-	241,137.60	241,137.60
应付托管费	-	-	-	40,189.63	40,189.63
应付销售服务费	-	-	-	18,510.59	18,510.59
其他负债	-	-	-	180,704.64	180,704.64
负债总计	-	-	-	528,059.53	528,059.53
利率敏感度缺口	19,069,173.73	-	-	213,923,147.66	232,992,321.39

上年度末 2023 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	4,017,993.96	-	-	-	4,017,993.96
结算备付金	637,686.81	-	-	-	637,686.81
存出保证金	31,738.23	-	-	-	31,738.23
交易性金融资产	6,186,603.29	-	-	119,136,035.41	125,322,638.70
应收申购款	-	-	-	609.25	609.25
资产总计	10,874,022.29	-	-	119,136,644.66	130,010,666.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,075.23	7,075.23
应付管理人报酬	-	-	-	130,539.28	130,539.28
应付托管费	-	-	-	21,756.56	21,756.56
应付销售服务费	-	-	-	1,304.88	1,304.88
其他负债	-	-	-	204,376.05	204,376.05
负债总计	-	-	-	365,052.00	365,052.00
利率敏感度缺口	10,874,022.29	-	-	118,771,592.66	129,645,614.95

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 2024 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 0.00%（2023 年 12 月 31 日：4.77%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2023 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，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	214,445,217. 69	92.04	119,136,035.4 1	91.89
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	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>214,445,217. 69</b>	<b>92.04</b>	<b>119,136,035.4 1</b>	<b>91.89</b>

#### 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：人民币万元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,328	增加约 759

	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,328	减少约 759
--	-------------	-----------	---------

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	214,359,918.16	118,799,307.51
第二层次	42,216.81	6,186,603.29
第三层次	43,082.72	336,727.90
合计	214,445,217.69	125,322,638.70

###### 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 2024 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(2023 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	214,445,217.69	91.83
	其中：股票	214,445,217.69	91.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	19,028,968.14	8.15
8	其他各项资产	46,195.09	0.02
9	合计	233,520,380.92	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	1,066,211.00	0.46
B	采矿业	12,290,568.00	5.28
C	制造业	137,758,308.11	59.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,339,792.00	2.29
E	建筑业	6,233,101.00	2.68
F	批发和零售业	5,059,656.00	2.17
G	交通运输、仓储和邮政业	1,886,376.92	0.81

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,240,387.54	2.25
J	金融业	32,984,673.62	14.16
K	房地产业	793,956.00	0.34
L	租赁和商务服务业	1,653,314.42	0.71
M	科学研究和技术服务业	515,045.00	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	459,124.08	0.20
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	3,164,704.00	1.36
S	综合	-	-
	合计	214,445,217.69	92.04

### 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	000333	美的集团	75,700	4,882,650.00	2.10
2	600519	贵州茅台	2,989	4,386,028.71	1.88
3	300750	宁德时代	21,960	3,953,458.80	1.70
4	601668	中国建筑	719,400	3,820,014.00	1.64
5	600183	生益科技	174,700	3,679,182.00	1.58
6	000830	鲁西化工	314,800	3,648,532.00	1.57
7	601166	兴业银行	198,500	3,497,570.00	1.50
8	600887	伊利股份	133,100	3,439,304.00	1.48
9	601211	国泰君安	246,300	3,337,365.00	1.43
10	300760	迈瑞医疗	11,000	3,200,010.00	1.37
11	601601	中国太保	106,700	2,972,662.00	1.28
12	600926	杭州银行	215,100	2,807,055.00	1.20
13	600000	浦发银行	330,300	2,718,369.00	1.17
14	688036	传音控股	35,200	2,694,208.00	1.16
15	601225	陕西煤业	102,600	2,644,002.00	1.13
16	601318	中国平安	63,500	2,626,360.00	1.13
17	000725	京东方 A	631,600	2,583,244.00	1.11
18	000596	古井贡酒	11,900	2,511,733.00	1.08
19	600219	南山铝业	607,700	2,315,337.00	0.99
20	601615	明阳智能	241,400	2,278,816.00	0.98

21	300428	立中集团	121,100	2,251,249.00	0.97
22	600489	中金黄金	141,800	2,098,640.00	0.90
23	600886	国投电力	114,900	2,095,776.00	0.90
24	002422	科伦药业	68,100	2,065,473.00	0.89
25	000858	五粮液	16,000	2,048,640.00	0.88
26	600820	隧道股份	311,300	2,032,789.00	0.87
27	600019	宝钢股份	304,600	2,025,590.00	0.87
28	300408	三环集团	68,200	1,990,758.00	0.85
29	603096	新经典	116,700	1,972,230.00	0.85
30	600346	恒力石化	137,600	1,919,520.00	0.82
31	601916	浙商银行	687,500	1,897,500.00	0.81
32	600845	宝信软件	58,560	1,869,820.80	0.80
33	002311	海大集团	39,700	1,867,885.00	0.80
34	601633	长城汽车	72,100	1,824,130.00	0.78
35	601665	齐鲁银行	363,600	1,785,276.00	0.77
36	601877	正泰电器	91,500	1,743,990.00	0.75
37	600036	招商银行	49,800	1,702,662.00	0.73
38	600057	厦门象屿	242,900	1,651,720.00	0.71
39	002025	航天电器	33,600	1,558,368.00	0.67
40	000651	格力电器	39,300	1,541,346.00	0.66
41	603699	纽威股份	85,800	1,468,896.00	0.63
42	300783	三只松鼠	66,700	1,458,729.00	0.63
43	601717	郑煤机	97,600	1,444,480.00	0.62
44	002001	新和成	75,200	1,443,840.00	0.62
45	600028	中国石化	225,200	1,423,264.00	0.61
46	002228	合兴包装	570,600	1,335,204.00	0.57
47	600916	中国黄金	137,300	1,320,826.00	0.57
48	605007	五洲特纸	103,300	1,304,679.00	0.56
49	002833	弘亚数控	71,100	1,296,864.00	0.56
50	600066	宇通客车	48,900	1,261,620.00	0.54
51	601128	常熟银行	165,600	1,253,592.00	0.54
52	601658	邮储银行	242,400	1,228,968.00	0.53
53	002008	大族激光	58,200	1,210,560.00	0.52
54	002839	张家港行	291,300	1,171,026.00	0.50
55	000690	宝新能源	228,800	1,166,880.00	0.50
56	600332	白云山	39,400	1,155,602.00	0.50
57	300308	中际旭创	8,140	1,122,343.20	0.48
58	002601	龙佰集团	57,400	1,065,918.00	0.46
59	000999	华润三九	24,300	1,034,694.00	0.44
60	601899	紫金矿业	57,900	1,017,303.00	0.44
61	603738	泰晶科技	73,800	1,006,632.00	0.43
62	300394	天孚通信	11,220	992,072.40	0.43
63	002879	长缆科技	75,000	984,750.00	0.42
64	600030	中信证券	51,394	936,912.62	0.40

65	600809	山西汾酒	4,104	865,451.52	0.37
66	000568	泸州老窖	6,000	860,940.00	0.37
67	688159	有方科技	22,700	859,422.00	0.37
68	601088	中国神华	18,900	838,593.00	0.36
69	000786	北新建材	27,900	827,514.00	0.36
70	601928	凤凰传媒	75,500	827,480.00	0.36
71	600237	铜峰电子	152,900	798,138.00	0.34
72	600064	南京高科	130,800	793,956.00	0.34
73	600282	南钢股份	158,100	787,338.00	0.34
74	603676	卫信康	97,100	777,771.00	0.33
75	000915	华特达因	25,600	772,096.00	0.33
76	600598	北大荒	61,500	768,135.00	0.33
77	003006	百亚股份	32,200	763,140.00	0.33
78	300115	长盈精密	62,100	744,579.00	0.32
79	000513	丽珠集团	19,500	725,595.00	0.31
80	300643	万通智控	50,400	710,640.00	0.31
81	300049	福瑞股份	13,900	699,726.00	0.30
82	002004	华邦健康	179,300	681,340.00	0.29
83	603733	仙鹤股份	38,200	671,556.00	0.29
84	688766	普冉股份	6,900	670,473.00	0.29
85	601216	君正集团	180,800	667,152.00	0.29
86	002032	苏泊尔	13,300	666,330.00	0.29
87	300566	激智科技	47,600	665,924.00	0.29
88	300724	捷佳伟创	11,700	631,917.00	0.27
89	002961	瑞达期货	57,600	630,720.00	0.27
90	002402	和而泰	58,700	628,677.00	0.27
91	300529	健帆生物	23,000	625,830.00	0.27
92	002594	比亚迪	2,500	625,625.00	0.27
93	002106	莱宝高科	56,600	616,940.00	0.26
94	601058	赛轮轮胎	43,728	612,192.00	0.26
95	688253	英诺特	15,800	602,138.00	0.26
96	688408	中信博	6,300	580,104.00	0.25
97	300627	华测导航	19,300	576,105.00	0.25
98	002415	海康威视	18,599	574,895.09	0.25
99	600299	安迪苏	58,400	566,480.00	0.24
100	601328	交通银行	74,900	559,503.00	0.24
101	000975	银泰黄金	33,400	544,086.00	0.23
102	601398	工商银行	94,600	539,220.00	0.23
103	300396	迪瑞医疗	25,800	523,998.00	0.22
104	688767	博拓生物	20,900	523,963.00	0.22
105	600938	中国海油	15,800	521,400.00	0.22
106	688117	圣诺生物	20,600	505,524.00	0.22
107	603558	健盛集团	49,800	495,510.00	0.21
108	688157	松井股份	14,300	491,920.00	0.21

109	601138	工业富联	17,800	487,720.00	0.21
110	600050	中国联通	102,800	483,160.00	0.21
111	300415	伊之密	23,200	482,096.00	0.21
112	601000	唐山港	101,700	477,990.00	0.21
113	603025	大豪科技	34,500	476,790.00	0.20
114	603198	迎驾贡酒	8,200	471,500.00	0.20
115	300679	电连技术	11,700	470,691.00	0.20
116	600276	恒瑞医药	11,960	459,981.60	0.20
117	601827	三峰环境	53,800	456,762.00	0.20
118	600690	海尔智家	16,000	454,080.00	0.19
119	300969	恒帅股份	6,500	449,345.00	0.19
120	603277	银都股份	14,800	444,592.00	0.19
121	002273	水晶光电	26,100	443,178.00	0.19
122	688525	佰维存储	6,900	442,635.00	0.19
123	600874	创业环保	77,800	434,902.00	0.19
124	603806	福斯特	29,400	432,180.00	0.19
125	002745	木林森	53,400	430,404.00	0.18
126	002475	立讯精密	10,900	428,479.00	0.18
127	300181	佐力药业	28,100	424,872.00	0.18
128	600863	内蒙华电	91,100	422,704.00	0.18
129	600461	洪城环境	36,500	422,670.00	0.18
130	601628	中国人寿	13,500	419,175.00	0.18
131	688663	新风光	18,000	418,860.00	0.18
132	600901	江苏金租	82,300	415,615.00	0.18
133	600582	天地科技	60,300	415,467.00	0.18
134	600794	保税科技	130,800	414,636.00	0.18
135	603239	浙江仙通	30,100	412,671.00	0.18
136	601838	成都银行	27,000	410,130.00	0.18
137	600125	铁龙物流	68,500	408,945.00	0.18
138	002463	沪电股份	11,200	408,800.00	0.18
139	601038	一拖股份	25,800	407,898.00	0.18
140	002128	电投能源	19,200	405,120.00	0.17
141	002978	安宁股份	14,500	403,970.00	0.17
142	601607	上海医药	21,000	401,310.00	0.17
143	600409	三友化工	79,900	401,098.00	0.17
144	300502	新易盛	3,800	401,090.00	0.17
145	600398	海澜之家	43,400	401,016.00	0.17
146	688075	安旭生物	11,900	400,911.00	0.17
147	600803	新奥股份	19,200	399,360.00	0.17
148	601101	昊华能源	43,400	398,846.00	0.17
149	600674	川投能源	21,200	397,500.00	0.17
150	688608	恒玄科技	2,700	395,226.00	0.17
151	601126	四方股份	20,400	392,088.00	0.17
152	000429	粤高速 A	37,600	391,416.00	0.17

153	002441	众业达	51,600	391,128.00	0.17
154	000550	江铃汽车	18,000	390,780.00	0.17
155	000403	派林生物	14,600	389,236.00	0.17
156	000423	东阿阿胶	6,200	388,120.00	0.17
157	603730	岱美股份	38,970	387,361.80	0.17
158	603345	安井食品	5,200	386,412.00	0.17
159	000776	广发证券	31,700	385,789.00	0.17
160	603919	金徽酒	21,100	383,387.00	0.16
161	600089	特变电工	27,600	382,812.00	0.16
162	600037	歌华有线	63,800	381,524.00	0.16
163	600039	四川路桥	48,200	380,298.00	0.16
164	603348	文灿股份	13,700	379,353.00	0.16
165	688267	中触媒	19,100	379,326.00	0.16
166	600660	福耀玻璃	7,900	378,410.00	0.16
167	600188	兖矿能源	16,600	377,318.00	0.16
168	600015	华夏银行	58,900	376,960.00	0.16
169	002185	华天科技	45,600	371,640.00	0.16
170	688123	聚辰股份	6,100	371,063.00	0.16
171	605060	联德股份	25,800	370,746.00	0.16
172	002142	宁波银行	16,800	370,608.00	0.16
173	603501	韦尔股份	3,700	367,669.00	0.16
174	688486	龙迅股份	6,400	366,720.00	0.16
175	600985	淮北矿业	21,900	366,606.00	0.16
176	603039	泛微网络	11,500	365,240.00	0.16
177	002154	报喜鸟	67,100	365,024.00	0.16
178	300251	光线传媒	43,400	364,994.00	0.16
179	688358	祥生医疗	14,000	363,580.00	0.16
180	688099	晶晨股份	6,100	361,852.00	0.16
181	002345	潮宏基	76,600	361,552.00	0.16
182	600348	华阳股份	36,200	360,552.00	0.15
183	002318	久立特材	15,400	359,282.00	0.15
184	300121	阳谷华泰	46,000	358,800.00	0.15
185	600132	重庆啤酒	5,900	358,130.00	0.15
186	000921	海信家电	11,100	357,864.00	0.15
187	600309	万华化学	4,400	355,784.00	0.15
188	300100	双林股份	32,600	351,102.00	0.15
189	603611	诺力股份	20,600	351,024.00	0.15
190	003000	劲仔食品	29,100	350,655.00	0.15
191	603368	柳药集团	19,800	346,500.00	0.15
192	603816	顾家家居	10,700	345,503.00	0.15
193	600861	北京人力	20,900	341,088.00	0.15
194	603908	牧高笛	16,960	340,217.60	0.15
195	300492	华图山鼎	3,600	339,120.00	0.15
196	600256	广汇能源	50,600	339,020.00	0.15

197	600585	海螺水泥	14,300	337,337.00	0.14
198	002741	光华科技	37,500	336,750.00	0.14
199	603297	永新光学	5,508	333,178.92	0.14
200	600729	重庆百货	14,700	328,692.00	0.14
201	688556	高测股份	27,300	324,597.00	0.14
202	001309	德明利	3,600	311,040.00	0.13
203	002555	三七互娱	23,500	306,675.00	0.13
204	002158	汉钟精机	18,200	304,304.00	0.13
205	603040	新坐标	15,000	298,950.00	0.13
206	300059	东方财富	28,275	298,584.00	0.13
207	600919	江苏银行	40,100	297,943.00	0.13
208	000708	中信特钢	21,600	293,112.00	0.13
209	603859	能科科技	13,912	292,430.24	0.13
210	688093	世华科技	16,000	290,720.00	0.12
211	688516	奥特维	6,900	288,489.00	0.12
212	600737	中粮糖业	30,000	287,700.00	0.12
213	301285	鸿日达	10,700	279,163.00	0.12
214	002139	拓邦股份	25,700	272,934.00	0.12
215	688210	统联精密	11,800	261,370.00	0.11
216	601288	农业银行	58,900	256,804.00	0.11
217	603507	振江股份	7,800	255,996.00	0.11
218	300547	川环科技	15,200	248,520.00	0.11
219	300687	赛意信息	17,800	247,776.00	0.11
220	603351	威尔药业	12,200	247,172.00	0.11
221	603214	爱婴室	21,800	246,122.00	0.11
222	688155	先惠技术	6,200	245,148.00	0.11
223	605333	沪光股份	8,800	245,080.00	0.11
224	688662	富信科技	9,900	241,560.00	0.10
225	000703	恒逸石化	33,900	240,351.00	0.10
226	300673	佩蒂股份	18,100	237,472.00	0.10
227	688076	诺泰生物	3,000	234,840.00	0.10
227	603379	三美股份	6,000	234,840.00	0.10
229	605077	华康股份	15,300	233,325.00	0.10
230	003019	宸展光电	9,200	233,036.00	0.10
231	300841	康华生物	4,600	232,944.00	0.10
232	000530	冰山冷热	64,200	232,404.00	0.10
233	688513	苑东生物	4,600	231,334.00	0.10
234	603181	皇马科技	25,633	230,440.67	0.10
235	603059	倍加洁	11,600	228,984.00	0.10
236	600362	江西铜业	9,600	227,328.00	0.10
237	002824	和胜股份	17,800	227,128.00	0.10
238	002237	恒邦股份	19,700	226,747.00	0.10
239	603758	秦安股份	29,700	225,720.00	0.10
239	301373	凌玮科技	9,900	225,720.00	0.10

241	002557	洽洽食品	8,000	225,520.00	0.10
242	000963	华东医药	8,100	225,261.00	0.10
243	600547	山东黄金	8,200	224,516.00	0.10
244	603235	天新药业	9,300	223,479.00	0.10
245	603258	电魂网络	13,600	219,640.00	0.09
246	688685	迈信林	8,800	215,160.00	0.09
247	002078	太阳纸业	14,600	203,670.00	0.09
248	601816	京沪高铁	35,600	191,172.00	0.08
249	002153	石基信息	32,600	186,798.00	0.08
250	600031	三一重工	11,200	184,800.00	0.08
251	002714	牧原股份	4,200	183,120.00	0.08
252	688222	成都先导	15,500	175,925.00	0.08
253	605128	上海沿浦	6,228	173,698.92	0.07
254	300458	全志科技	7,300	171,623.00	0.07
255	300124	汇川技术	3,100	159,030.00	0.07
256	002782	可立克	14,000	155,120.00	0.07
257	300207	欣旺达	10,200	154,734.00	0.07
258	301133	金钟股份	7,100	154,709.00	0.07
259	002876	三利谱	6,400	154,368.00	0.07
260	688678	福立旺	14,200	153,786.00	0.07
261	301062	上海艾录	15,000	153,150.00	0.07
262	300790	宇瞳光学	11,300	152,550.00	0.07
263	002849	威星智能	13,400	149,544.00	0.06
264	300515	三德科技	15,100	149,037.00	0.06
265	002245	蔚蓝锂芯	19,100	148,025.00	0.06
266	002340	格林美	22,900	145,873.00	0.06
267	603132	金徽股份	10,500	144,480.00	0.06
268	603681	永冠新材	11,300	144,075.00	0.06
269	688533	上声电子	5,500	142,285.00	0.06
270	603026	石大胜华	4,200	141,960.00	0.06
271	301219	腾远钴业	3,700	141,562.00	0.06
272	300953	震裕科技	2,600	140,920.00	0.06
273	002864	盘龙药业	5,400	139,752.00	0.06
274	002534	西子洁能	13,900	139,139.00	0.06
275	002852	道道全	19,200	138,240.00	0.06
276	601857	中国石油	13,000	134,160.00	0.06
277	605369	拱东医疗	3,300	131,670.00	0.06
278	300973	立高食品	4,600	129,214.00	0.06
279	300498	温氏股份	5,800	114,956.00	0.05
280	301580	爱迪特	1,377	104,749.14	0.04
281	688692	达梦数据	418	91,713.94	0.04
282	601012	隆基绿能	6,460	90,569.20	0.04
283	000001	平安银行	8,700	88,305.00	0.04
284	688691	灿芯股份	1,203	63,030.71	0.03

285	000049	德赛电池	2,300	53,935.00	0.02
286	300879	大叶股份	3,900	52,182.00	0.02
287	300866	安克创新	700	49,847.00	0.02
288	603727	博迈科	3,700	48,692.00	0.02
289	603456	九洲药业	3,500	48,020.00	0.02
290	300628	亿联网络	1,300	47,801.00	0.02
291	300856	科思股份	1,400	44,814.00	0.02
292	603381	永臻股份	966	26,769.61	0.01
293	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
294	603285	键邦股份	1,105	20,608.25	0.01
295	688648	中邮科技	224	4,892.16	0.00
296	688653	康希通信	339	4,366.32	0.00
297	688652	京仪装备	111	4,338.99	0.00
298	688720	艾森股份	99	4,013.46	0.00
299	688695	中创股份	127	4,006.85	0.00
300	688709	成都华微	213	4,002.27	0.00
301	601096	宏盛华源	950	3,885.50	0.00
302	601033	永兴股份	148	2,362.08	0.00
303	603341	龙旗科技	60	2,249.40	0.00
304	601083	锦江航运	232	2,217.92	0.00
305	688719	爱科赛博	77	2,007.39	0.00
306	603373	安邦护卫	58	1,594.42	0.00
307	603193	润本股份	85	1,563.15	0.00
308	603082	北自科技	48	1,415.52	0.00
309	603107	上海汽配	86	1,366.54	0.00
310	603325	博隆技术	20	1,361.20	0.00
311	603344	星德胜	59	1,336.94	0.00
312	603375	盛景微	31	1,205.90	0.00
313	603312	西典新能	44	1,115.84	0.00
314	603231	索宝蛋白	60	1,022.40	0.00
315	603004	鼎龙科技	58	983.10	0.00
316	603062	麦加芯彩	24	797.04	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	600887	伊利股份	5,689,549.00	4.39
2	600926	杭州银行	5,688,616.00	4.39
3	601166	兴业银行	5,408,995.00	4.17

4	601318	中国平安	5,132,421.00	3.96
5	000333	美的集团	5,032,836.00	3.88
6	002601	龙佰集团	4,602,494.00	3.55
7	688036	传音控股	4,601,331.76	3.55
8	002001	新 和 成	4,536,378.00	3.50
9	601211	国泰君安	4,532,567.00	3.50
10	000725	京东方 A	4,397,889.00	3.39
11	600183	生益科技	4,252,494.00	3.28
12	000830	鲁西化工	4,225,270.00	3.26
13	601668	中国建筑	4,104,476.00	3.17
14	600820	隧道股份	4,018,411.00	3.10
15	000858	五 粮 液	4,011,016.00	3.09
16	601877	正泰电器	3,741,652.00	2.89
17	600919	江苏银行	3,675,691.00	2.84
18	600346	恒力石化	3,665,376.00	2.83
19	600028	中国石化	3,502,788.00	2.70
20	601088	中国神华	3,498,714.00	2.70
21	601601	中国太保	3,425,900.00	2.64
22	002422	科伦药业	3,383,045.00	2.61
23	000596	古井贡酒	3,314,084.00	2.56
24	300750	宁德时代	3,282,763.00	2.53
25	000999	华润三九	3,267,034.00	2.52
26	601225	陕西煤业	3,252,361.00	2.51
27	300760	迈瑞医疗	3,157,010.00	2.44
28	601916	浙商银行	3,109,365.00	2.40
29	600000	浦发银行	3,093,121.00	2.39
30	600519	贵州茅台	3,036,641.00	2.34
31	600019	宝钢股份	2,952,017.00	2.28
32	000963	华东医药	2,921,251.00	2.25
33	600332	白云山	2,899,367.00	2.24
34	600886	国投电力	2,891,975.00	2.23
35	600741	华域汽车	2,886,464.00	2.23
36	000933	神火股份	2,879,274.00	2.22
37	601717	郑煤机	2,820,348.00	2.18
38	300428	立中集团	2,806,997.00	2.17
39	600489	中金黄金	2,779,671.00	2.14
40	002402	和而泰	2,769,066.00	2.14
41	601615	明阳智能	2,766,507.00	2.13
42	600016	民生银行	2,760,136.00	2.13
43	603096	新经典	2,757,290.00	2.13
44	601288	农业银行	2,749,399.00	2.12
45	601985	中国核电	2,731,420.00	2.11
46	600219	南山铝业	2,626,181.00	2.03
47	300566	激智科技	2,621,762.00	2.02

48	601919	中远海控	2,613,212.00	2.02
49	000651	格力电器	2,606,574.00	2.01

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	600919	江苏银行	5,176,828.00	3.99
2	601318	中国平安	5,038,197.00	3.89
3	002601	龙佰集团	4,790,702.00	3.70
4	600519	贵州茅台	4,655,270.00	3.59
5	600887	伊利股份	4,094,076.00	3.16
6	601169	北京银行	4,063,454.00	3.13
7	600028	中国石化	4,011,621.00	3.09
8	600741	华域汽车	3,956,683.00	3.05
9	002415	海康威视	3,641,424.00	2.81
10	600795	国电电力	3,586,936.00	2.77
11	002027	分众传媒	3,392,611.00	2.62
12	002001	新 和 成	3,347,615.00	2.58
13	000933	神火股份	3,325,985.00	2.57
14	601166	兴业银行	3,258,572.00	2.51
15	601088	中国神华	3,238,267.00	2.50
16	600018	上港集团	3,196,053.00	2.47
17	002402	和而泰	3,187,509.00	2.46
18	600926	杭州银行	3,144,567.00	2.43
19	000651	格力电器	3,134,166.00	2.42
20	600016	民生银行	3,102,484.00	2.39
21	601919	中远海控	3,078,626.00	2.37
22	601288	农业银行	3,041,146.00	2.35
23	601985	中国核电	2,995,704.00	2.31
24	000858	五 粮 液	2,985,979.00	2.30
25	600332	白云山	2,718,975.00	2.10
26	600438	通威股份	2,713,055.00	2.09
27	000963	华东医药	2,664,758.00	2.06
28	600019	宝钢股份	2,622,533.00	2.02

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	595,282,645.23
卖出股票的收入（成交）总额	495,022,120.82

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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（除“兴业银行、国泰君安证券”违规外）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。

兴业银行下属分支机构因贷后管理不到位、贷款资金回流至借款人账户，对外包催收机构管理不严，信贷业务管理不尽职，严重违反审慎经营规则，未取得基金从业资格的员工从事基金销售业务相关工作，违反规定办理结汇业务等情况受到地方金管局、证监局及外管局罚款、警告、没收违法所得、整改通知等处罚。

国泰君安证券及下属分支机构因作为债券受托管理人，在受托管理期间未严格遵守执业行为准则、履职尽责不到位，在保荐公司 IPO 过程中未勤勉尽责，营业部个别员工为客户提供测评答案，违反

外汇账户管理规定等，受到中国证监会、各地证监局、深交所警示，地方外管局警告、罚款等处罚。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。

7.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规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	40,205.59
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,989.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,195.09

### 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	15,148	10,625.51	127,114,944.70	78.98%	33,840,341.51	21.02%
国泰量化策略收 益混合 C	20	1,751,434.8 9	35,009,591.71	99.95%	19,106.16	0.05%
合计	15,168	12,920.89	162,124,536.41	82.72%	33,859,447.67	17.28%

### 8.2 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	30,266.65	0.02%
	国泰量化策略收益混合 C	65.72	0.00%
	合计	30,332.37	0.02%

### 8.3 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	92,711,298.02	1,915,088.69
本报告期基金总申购份额	92,406,495.93	42,979,963.30
减：本报告期基金总赎回份额	24,162,507.74	9,866,354.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	160,955,286.21	35,028,697.87
-------------	----------------	---------------

## 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：

2024 年 3 月 27 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二十六次会议审议通过，周向勇先生离任公司总经理、转任董事长并代为履行总经理职务。

2024 年 7 月 25 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二十九次会议审议通过，聘任李昇先生担任本基金管理人总经理。

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普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人及高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	数量		票成交总 额的比例		金总量的 比例	
国投证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	1,089,956,467.55	100.00%	159,022.80	100.00%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资质雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

### 10.7.2 基金租用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
国投证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	3,162,972.89	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

### 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高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2024-03-27
2	关于国泰量化策略收益混合型证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	《中国证券报》	2024-06-19
3	国泰量化策略收益混合型证券投资基金分红公告	《中国证券报》	2024-06-20

## 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	2024年01月01日至2024年05月20日	23,852,623.65	4,271,223.82	-	28,123,847.47	14.35%
	2	2024年06月13日至2024年06月16日	-	34,945,485.04	-	34,945,485.04	17.83%
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、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。

基金托管人住所或办公场所。

### 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

二〇二四年八月三十日