

国泰海通红利量化选股混合型证券投资基金

2026 年第 2 季度报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:上海国泰海通证券资产管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 07 月 21 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年07月16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04月01日起至2026年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰海通红利量化选股混合
基金主代码	021919
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 10 月 30 日
报告期末基金份额总额	135,893,439.80 份
投资目标	本基金主要投资于红利主题相关优质上市企业，以数量化投资方法为基础，在严格控制风险的前提下，力求实现长期超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、资产配置策略 本基金将综合考虑宏观与微观经济、市场与政策等因素，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。在资产配置中，本基金主要考虑：（1）宏观经济因素，包括GDP 增长率及其构成、CPI、市场利率水平变化、货币政策等；（2）微观经济因素，包括各行业主要企业的盈利变化情况及其盈利预期；（3）市场因素，包括股票及债券市场的涨跌、市场整体估值水平、大类资产的预期收益率水平及其历史比较、市场资金供求关系及其变化；（4）政策因素，与证券市场密切相关的各种政策出台对市场的影响等。 2、股票投资策略 （1）主题界定 本基金所界定的红利主题包括满足以下所有条件的上市公司： 1）稳定的分红政策：过去 2 年内至少有 1 次分红（包括现金股

	利和股票股利)； 2) 较高的分红回报：最近一年的股息率处于市场前 50%； 3) 具有持续分红能力：公司财务质量健康、盈利能力稳定、分红能力强、分红意愿高、具有良好的行业长期竞争力。 本基金不主动投资于 ST 及*ST 股票。 未来随着政策、法律法规、行业规范或者行业准则等发生变化，红利主题相关上市公司可能会发生变动。基金管理人可在履行适当程序后，对上述主题界定的标准进行动态调整。 (2) 量化选股策略 本基金重点关注红利主题股票，并通过量化选股策略，尽量追求组合的收益最大化并有效控制回撤。量化选股策略主要通过机器学习模型和对股票因子特征的研究，致力于捕捉市场短期失效带来的盈利空间，在充分控制投资风险的前提下，在以下几个层面通过量化选股的投资策略进行投资，力求实现基金资产的长期、稳定增值。 1) 投资逻辑层面：在策略维度上，同时注重基本面量化模型和实时价量模型，并将两者进行结合。一方面，选择基本面优质且被机构看好的公司，争取赚取长期持股的收益。另一方面，通过量价因子尽量刻画股票的技术面特征，以便更准确把握股票的买卖时间点。 2) 模型层面：模型结合股票市场的高噪音和时序性的特征自主研发而成，致力于用多个子模型从不同的角度来刻画市场投资逻辑，并通过因子之间的优胜劣汰和风格轮动来捕捉市场的投资机会，提升模型对不同市场风格的普适性，尽量减少单个子模型的失效概率。 3) Alpha 因子层面：团队维护的 Alpha 因子库覆盖股票的日频交易数据相关因子、股票定期报告衍生因子、分析师报告衍生因子、事件驱动合成因子、股票实时价量数据相关因子以及互联网和舆情数据因子等。 4) 策略配置层面：模型采取将低频因子和价量因子在底层训练和子模型合成两个维度进行融合，而非在策略配置层面。该方式试图保留基本面因子的多头端表现和价量因子的空头端优势，在某些市场阶段可以形成策略互补的效果，使得策略更稳健。 5) 行业配置层面：量化行业配置模型综合考虑行业的景气度、估值、资金流、价量和机构行为等视角，由多个相关性较低、具备显著超额收益能力的子模型，形成综合的行业配置信号，以此对部分行业进行适当的高配和低配。 6) 组合管理层面：团队运作的 Alpha 量化策略通过自主研发的风险模型和组合优化模型得到日内实时的投资组合在多个不同时间段对持仓进行调仓。在投资组合优化的过程中主要严格控制的风险因子为规模因子、Beta 因子、流动性因子、波动率因子、动量因子、反转因子、估值和行业因子等，将主要市场风险因子以及行业因子相对于基准指数的暴露程度控制在一定范
--	---

	围之内，动态调整投资组合。 本基金的投资策略还包括存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券（包括可交换债券、可分离交易债券）投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货交易策略、国债期货交易策略、股票期权投资策略、融资策略。	
业绩比较基准	中证红利指数收益率*80%+中债新综合全价(总值)指数收益率*20%	
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。	
基金管理人	上海国泰海通证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国泰海通红利量化选股混合 A	国泰海通红利量化选股混合 C
下属分级基金的交易代码	021919	021920
报告期末下属分级基金的份额总额	87,960,822.30 份	47,932,617.50 份

注：2025 年 7 月 25 日，上海国泰君安证券资产管理有限公司变更名称为上海国泰海通证券资产管理有限公司。国泰海通红利量化选股混合型证券投资基金由国泰君安红利量化选股混合型证券投资基金变更而来。国泰海通红利量化选股混合型证券投资基金基金合同生效日为 2025 年 9 月 29 日。

§ 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 04 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	国泰海通红利量化选股混合 A	国泰海通红利量化选股混合 C
1. 本期已实现收益	-2,181,863.99	-1,250,319.64
2. 本期利润	-11,410,931.20	-5,937,377.83
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1230	-0.1168
4. 期末基金资产净值	91,766,422.68	49,674,656.62
5. 期末基金份额净值	1.0433	1.0363

注：1. 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。

2. 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。

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

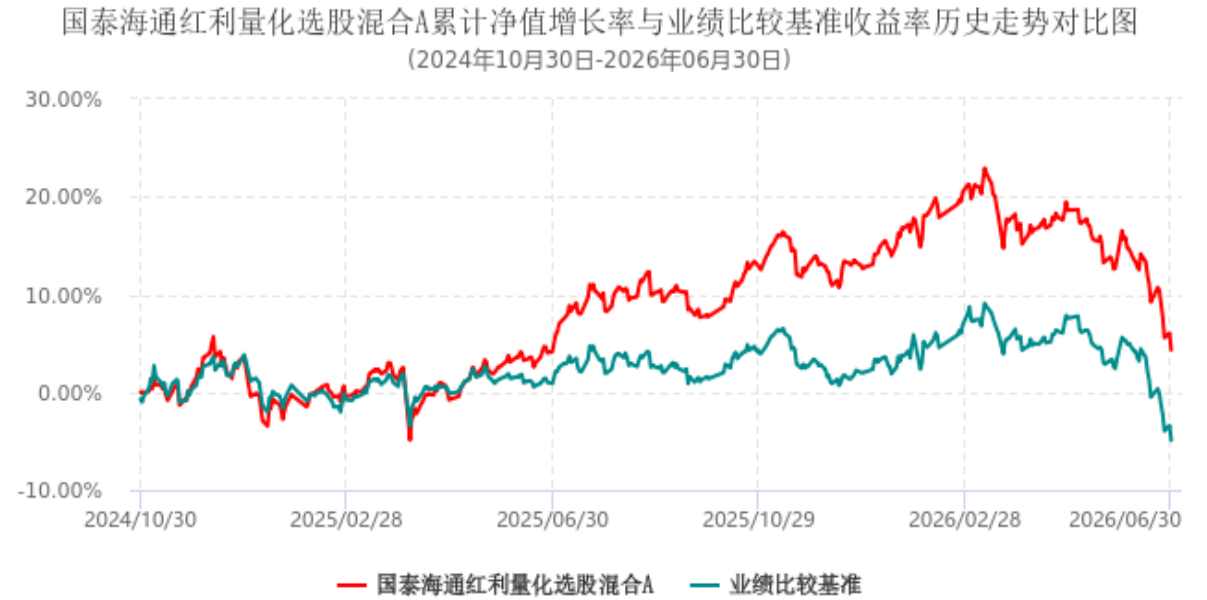
国泰海通红利量化选股混合 A 净值表现

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	-10.52%	0.85%	-9.83%	0.74%	-0.69%	0.11%
过去六个月	-7.49%	0.87%	-6.81%	0.79%	-0.68%	0.08%
过去一年	0.17%	0.75%	-5.76%	0.66%	5.93%	0.09%
自基金合同 生效起至今	4.33%	0.80%	-4.91%	0.68%	9.24%	0.12%

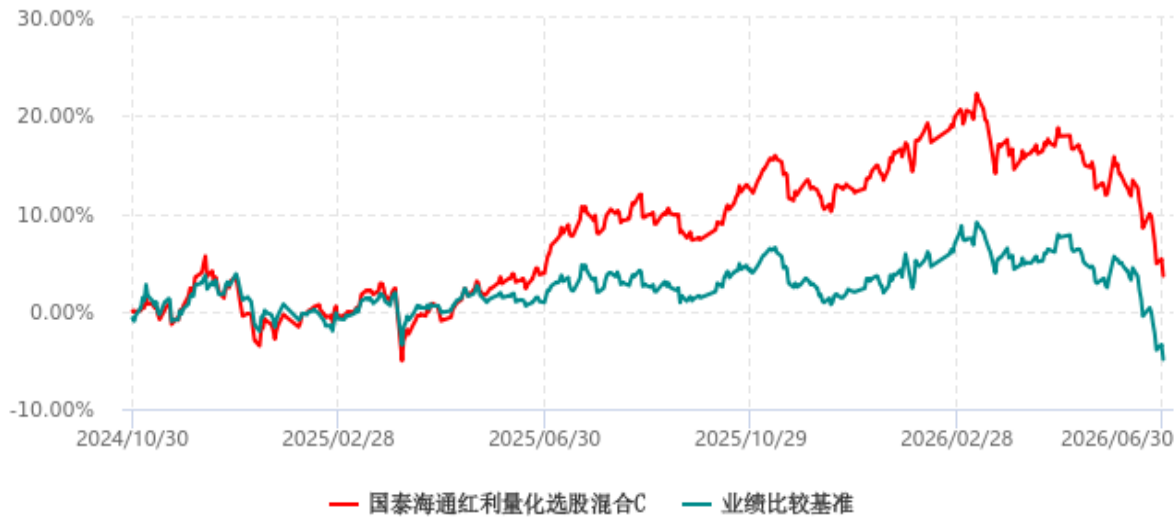
国泰海通红利量化选股混合 C 净值表现

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	-10.63%	0.85%	-9.83%	0.74%	-0.80%	0.11%
过去六个月	-7.68%	0.87%	-6.81%	0.79%	-0.87%	0.08%
过去一年	-0.24%	0.75%	-5.76%	0.66%	5.52%	0.09%
自基金合同 生效起至今	3.63%	0.80%	-4.91%	0.68%	8.54%	0.12%

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



国泰海通红利量化选股混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024年10月30日-2026年06月30日)



§ 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		
胡崇海	国泰海通中证500 指数增强基金经理，国泰海通中证1000 指数增强基金经理，国泰海通量化选股混合发起基金经理，国泰海通沪深300 指数增强发起基金经理，国泰海通中证1000 优选股票发起基金经理，国泰海通科创板量化选股股票发起基金经理，国泰海通红利	2024-10-30	—	15 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士。曾任香港科技大学人工智能实验室访问学者，其后加盟方正证券研究所、国泰君安证券咨询部及研究所从事量化对冲模型的研发工作，2014 年加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，先后在量化投资部、权益与衍

	量化选股混合基金经理，国泰海通中证 A500 指数增强基金经理，国泰海通上证科创板综合价格指数增强基金经理，国泰海通稳健泰裕债券发起基金经理，国泰海通中证全指指数增强基金经理，国泰海通创业板综指增强基金经理。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。				生品部担任高级投资经理，从事量化投资和策略研发工作，在 Alpha 量化策略以及基于机器学习的投资方面有独到且深入的研究。现任本公司量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规、相关规定以及基金合同、招募说明书约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法违规行为及违反基金合同、招募说明书约定的行为，无侵害基金份额持有人利益的行为。

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，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，确保公平对待所有的投资组合，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，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。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的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% 的次数为 0 次。本基金与本公司管理的其他组合在不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

在市场方面，2026 年第二季度 A 股市场整体震荡上行，但月度节奏和结构显著分化。4 月市场在一季度末调整后逐步修复，前期地缘扰动对风险偏好的压制边际缓和，国内政策继续强调稳定资本市场、发展新质生产力和支持科技创新，叠加一季报和年报披露对部分高景气方向形成验证，市场风险偏好有所回升。5 月市场延续结构性修复，AI 算力、半导体、通信、电子、先进制造等方向持续活跃，成长风格占优，主要宽基指数普遍上涨；与此同时，传统防御资产和部分稳定收益资产表现相对偏弱，市场收益机会更多集中在产业趋势明确、业绩预期较强的方向。进入 6 月后，市场转为高位波动，上旬受海外流动性紧缩预期升温影响缩量调整，上证指数一度回落至 3927 点附近；中下旬随着地缘风险阶段性缓和、全球风险偏好改善，市场有所修复，但半年末机构调仓、IPO 和解禁压力、融资资金边际降温等因素使资金面呈现“紧平衡”。从结构上看，二季度 A 股行情更偏结构性，资金集中于 AI 产业链和硬科技景气方向，光模块、存储芯片、PCB、半导体设备和材料、数据中心电力设备等环节受益于算力投资和中报业绩预期；同时，电子布、部分化工品、铜等价格上涨相关方向，以及制造出海、创新药、证券等低位修复方向也逐步受到关注。成长风格显著占优，但 6 月以后科技主线的拥挤度和波动也同步上升，市场波动和结构分化进一步加大。第二季度，中证红利指数表现较弱（跌幅 12.32%），弱于沪深 300 指数（涨幅 11.90%）、中证 500 指数（涨幅 18.56%）、中证 1000 指数（涨幅 15.62%）、中证 A500 指数（涨幅 14.26%）、中证全指（涨幅 12.14%）和科创综指（涨幅 55.71%）等主流指数。

从主要风险因子表现看，动量和残差波动因子在二季度表现出较强走势连续性，其中动量因子持续贡献正向收益，市场动量效应显著。行业层面相对一季度分化加剧，科技成长赛道表现更佳，AI 算力、半导体、光模块、消费电子等高景气科技主线持续，资金向少数主线板块高度集中，传统消费与金融板块持续走弱。二季度 A 股 31 个申万一级行业中仅有六个录得上涨，其余均为下跌，其中电子行业大涨 90.92%，通信上涨 63.84%，双双占据申万一级行业涨幅前二。Alpha 表现方面，价量

类因子整体优于基本面因子。

展望 2026 年三季度，A 股市场预计仍以结构性行情为主，指数层面或延续震荡，板块表现将更依赖中报业绩兑现和政策预期验证。国内政策对于资本市场、科技创新和新质生产力的支持方向较为明确，宏观流动性整体仍偏合理充裕；同时，前期强势的科技成长板块在拥挤度抬升后波动可能加大，后续需要更重视产业趋势、盈利兑现和估值匹配。科技方向仍是重要主线，但内部表现可能从单纯主题扩散转向业绩验证和景气筛选；顺周期、制造出海、创新药、证券及部分红利低波方向也可能在市场宽度回升过程中获得阶段性表现。总体来看，三季度市场仍具备结构性机会，但不同板块之间的分化可能继续存在，需要更加重视基本面确定性、估值合理性和交易拥挤度的平衡。

过去一段时间当中，红利类股票阶段性在市场风险偏好快速提升的阶段遇到一些挑战，在科技浪潮中虽非市场的“宠儿”，但是从中长期绝对收益的角度依然具有较高的配置价值，其长期的投资逻辑并未发生变化，原因有如下几点：1)、当前市场的无风险利率较低，高股息股票的股息率依然有较大的吸引力，特别是对长期配置的保险资金来讲；2)、政策推动上市公司分红提升，政策引导叠加市场环境使得红利资产成为 A 股资产配置中的重要组成部分；3)、A 股的红利资产多为对关税等外部市场环境不敏感的内需型行业，海外营收占比低，受关税等地缘政治的影响较小，在市场波动较大的阶段起到较好的防御作用。本基金采取量化的方式开展红利股票投资，其核心优势在于通过数据驱动的系统化框架，将红利投资的核心逻辑（如高股息、稳定分红、低估值等）转化为可量化的指标和投资约束，从而实现投资决策的标准化、实时化、纪律化和高效化，其底层投资框架采用管理人多年精心打造的量化投资体系，针对于红利投资在子策略合成、多策略配置和投资组合管理等层面进行有针对性地改良。相对于传统的红利投资主要注重于基本面投资来讲，我们充分结合财务数据为基础的基本面信号和实时量价信号，通过机器学习模型有针对性地有效选择因子，改善红利策略在高波动行情下的适应能力，并通过投资组合管理来控制模型在主要市场风险和行业上相对于基准指数的暴露程度，争取以较为稳定的方式增强中证红利指数。鉴于近些年市场环境的复杂性，我们从中吸取经验，更重视提升超额收益率的稳定性，并在市场的演化过程中不断引入新的因子和改良原有的模型，并通过多策略配置的形式来强化模型对不同风格的适应能力，在保持稳中求胜的风格下追求更好的超额收益率。

我们努力追求红利类量化策略从中长期角度形成 Alpha 和 Beta 的共振。需要强调的是，量化投资策略是通过积少成多、以概率取胜的方式增厚投资收益，因此更需要投资者耐心持有。我们认为中证红利指数当前依然处于历史相对合理区间，在复杂的经济环境下体现出了较为稳定的盈利能力，也是最注重股东回报的一类上市公司，从估值与盈利匹配角度看，指数仍具备一定吸引力，我们将努力通过科学的手段增强量化模型的超额收益率水平，以此力争为投资者创造长期稳健的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰海通红利量化选股混合 A 基金份额净值为 1.0433 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.52%，同期业绩比较基准收益率为-9.83%；截至报告期末国泰海通红利量化选股混合 C 基金份额净值为 1.0363 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.63%，同期业绩比较基准收益率为-9.83%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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	131,141,670.01	91.56
	其中：股票	131,141,670.01	91.56
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	11,776,176.34	8.22
8	其他资产	311,638.44	0.22
9	合计	143,229,484.79	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 0.00 元，占期末净值的比例为 0.00%；通过转融通证券出借业务的证券公允价值为 0.00 元，占资产净值的比例为 0.00%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,408,665.00	1.00
B	采矿业	29,837,827.76	21.10
C	制造业	37,430,642.16	26.46

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,181,563.00	1.54
E	建筑业	1,694,999.00	1.20
F	批发和零售业	4,365,342.00	3.09
G	交通运输、仓储和邮政业	15,337,754.88	10.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,936,920.00	1.37
J	金融业	32,098,182.37	22.69
K	房地产业	1,706,043.00	1.21
L	租赁和商务服务业	786,570.00	0.56
M	科学研究和技术服务业	295,681.84	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	599,257.00	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,870.00	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,364,677.00	0.96
S	综合	90,675.00	0.06
	合计	131,141,670.01	92.72

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

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	601225	陕西煤业	185,400	3,772,890.00	2.67
2	601699	潞安环能	234,100	3,342,948.00	2.36
3	600546	山煤国际	295,800	3,233,094.00	2.29
4	601398	工商银行	451,000	3,188,570.00	2.25
5	601857	中国石油	347,300	3,014,564.00	2.13
6	601998	中信银行	406,909	2,819,879.37	1.99
7	601988	中国银行	480,600	2,749,032.00	1.94
8	601997	贵阳银行	531,800	2,728,134.00	1.93
9	000933	神火股份	123,100	2,609,720.00	1.85

10	600919	江苏银行	225,800	2,434,124.00	1.72
----	--------	------	---------	--------------	------

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

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（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IF2607	IF2607	1	1,476,600.00	15,560.00	-
IH2607	IH2607	1	886,380.00	2,520.00	-
公允价值变动总额合计（元）					18,080.00
股指期货投资本期收益（元）					356,869.77
股指期货投资本期公允价值变动（元）					106,025.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可参与股指期货交易。若本基金参与股指期货交易，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，综合考虑流动性、基差水平、与股票组合相关度等因素，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金可参与国债期货交易。若本基金参与国债期货交易，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，综合考虑流动性、基差水平、与债券组合相关度等因素，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

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本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金持有的前十名证券发行主体贵阳银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行罚款。

本基金持有的前十名证券发行主体河南神火煤电股份有限公司，2025 年 9 月未及时披露公司重大事项，被证监会分局责令改正。

本基金持有的前十名证券发行主体江苏银行股份有限公司，其分支行 2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行罚款。

本基金持有的前十名证券发行主体山西潞安环保能源开发股份有限公司，2025 年 8 月因信息披露被证监会分局警示。

本基金持有的前十名证券发行主体中国工商银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行及分支行、国家外汇管理局地方分局、地方财政局罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局地方分局、地方财政局、证监会分局、深圳证券交易所罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体中信银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行及分支行、国家外汇管理局地方分局罚款、警告等。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	283,557.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	28,080.84
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	311,638.44

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处于转股期的可转换债券。

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

	国泰海通红利量化选股混合 A	国泰海通红利量化选股混合 C
报告期期初基金份额总额	89,962,491.41	51,487,770.92
报告期期间基金总申购份额	15,724,573.93	18,023,239.85
减：报告期期间基金总赎回份 额	17,726,243.04	21,578,393.27
报告期期间基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	87,960,822.30	47,932,617.50

注：基金总申购份额含红利再投资及转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 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

本报告期内基金管理人持有本基金份额未发生变化。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§ 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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予国泰君安红利量化选股混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国泰海通红利量化选股混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰海通红利量化选股混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰海通红利量化选股混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、法律意见书；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <https://www.gthtzg.com>。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

上海国泰海通证券资产管理有限公司

二〇二六年七月二十一日