

**国泰海通港股优势精选股票型发起式证券投资基金  
(QDII)**

**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:渣打银行(中国)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。

基金托管人渣打银行（中国）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       | 国泰海通港股优势精选股票发起（QDII）                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 基金主代码      | 026442                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 基金合同生效日    | 2026 年 03 月 27 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 报告期末基金份额总额 | 18,746,089.67 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 投资目标       | 在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上，追求中长期资本增值，力求为投资者获取超越业绩比较基准的回报。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 投资策略       | <p>本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。本基金采用多重投资策略，采取自上而下的资产配置和自下而上的证券选择相结合的方法进行投资管理。衍生品投资不作为本基金的主要投资品种，仅用于适当规避外汇风险及其他相关风险之目的。</p> <p>（一）资产配置策略</p> <p>本基金通过研究经济周期趋势，进行大类资产配置。本基金基于对宏观经济、政策面、市场面等因素的综合分析，结合对股票、债券、现金等大类资产的收益特征的前瞻性研究，形成对各类别资产未来表现的预判，在严格控制投资组合风险的前提下，确定和调整基金资产中股票、债券、货币市场工具以及其他金融工具的配置比例。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金主要结合定量和定性分析，分析其投资价值，结合风险</p> |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                       |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|
|                 | <p>控制模型，对股票组合进行优化，力求获得长期稳定的超额收益。</p> <p>1、个股选择</p> <p>在当前经济转型与产业升级的背景下，香港市场作为创新驱动的核心市场，蕴含着巨大的增长潜力。本选股策略旨在通过科学的选股方法，挖掘有长期回报的优质个股，构建攻守兼备的投资组合，追求长期稳健的资产增值。</p> <p>2、投资组合构建</p> <p>根据上述精选出的个股，结合各项定量和定性指标挑选出最具上涨潜力的标的自下而上构建投资组合。</p> <p>3、香港股票市场投资</p> <p>本基金在投资香港市场时，可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。</p> <p>4、对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选相应的存托凭证投资标的。</p> <p>本基金的投资策略还包括债券投资策略、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、境外市场基金投资策略、金融衍生品投资策略、境内融资及转融通证券出借业务投资策略、境外回购交易及证券借贷交易策略。</p> |                       |
| 业绩比较基准          | $\text{恒生科技指数收益率} \times 65\% + \text{中证港股通央企红利指数收益率} \times 30\% + \text{同期银行活期存款利率（税后）} \times 5\%$                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                       |
| 风险收益特征          | <p>本基金为股票型基金，一般而言，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。</p> <p>本基金投资港股通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险和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。</p> <p>本基金资产投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、股价波动风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p>                                                                                                                                                                                                                                                         |                       |
| 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           | 渣打银行（中国）有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                       |
| 下属分级基金的基金简称     | 国泰海通港股优势精选股票发起（QDII）A                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 国泰海通港股优势精选股票发起（QDII）C |
| 下属分级基金的交易代码     | 026442                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 026443                |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 13,745,885.20 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 5,000,204.47 份        |
| 境外资产托管人         | 英文名称:Standard Chartered Bank（Hong Kong） Limited                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                       |
|                 | 中文名称:渣打银行（香港）有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                       |

§ 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） |                       |
|-----------------|----------------------------------------|-----------------------|
|                 | 国泰海通港股优势精选股票发起（QDII）A                  | 国泰海通港股优势精选股票发起（QDII）C |
| 1. 本期已实现收益      | -43,279.06                             | -19,279.46            |
| 2. 本期利润         | -1,259,663.63                          | -469,048.17           |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0902                                | -0.0938               |
| 4. 期末基金资产净值     | 12,437,880.42                          | 4,519,689.46          |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9048                                 | 0.9039                |

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

国泰海通港股优势精选股票发起（QDII）A 净值表现

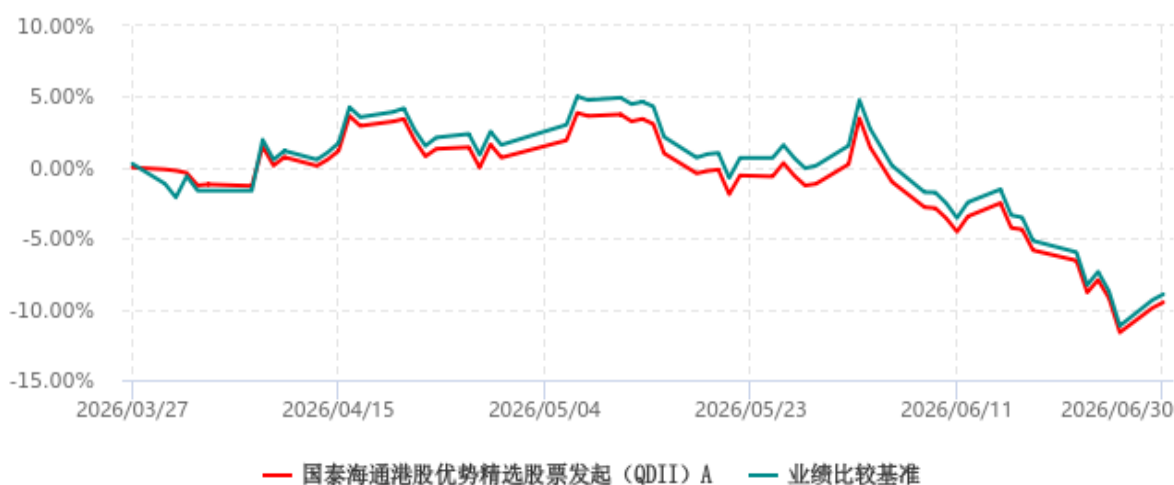
| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -9.32%     | 1.28%         | -6.98%         | 1.36%                 | -2.34% | -0.08% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -9.52%     | 1.25%         | -8.95%         | 1.34%                 | -0.57% | -0.09% |

国泰海通港股优势精选股票发起（QDII）C 净值表现

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -9.40%     | 1.28%         | -6.98%         | 1.36%                 | -2.42% | -0.08% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -9.61%     | 1.25%         | -8.95%         | 1.34%                 | -0.66% | -0.09% |

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

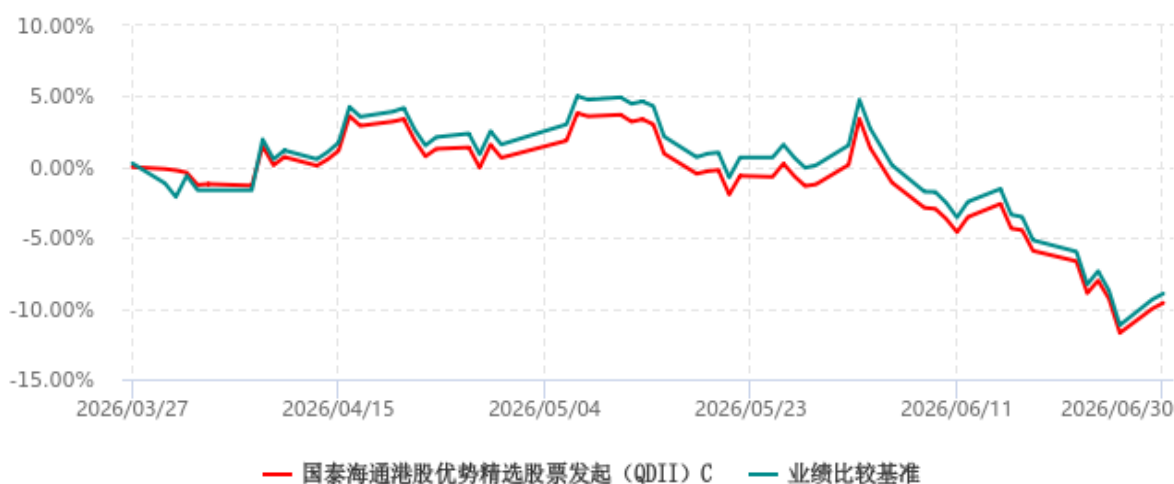
国泰海通港股优势精选股票发起（QDII）A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率  
历史走势对比图  
(2026年03月27日-2026年06月30日)



注：1、本基金于 2026 年 03 月 27 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，截止本报告期末基金成立未满六个月。

国泰海通港股优势精选股票发起（QDII）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  
(2026年03月27日-2026年06月30日)



注：1、本基金于 2026 年 03 月 27 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，截止本报告期末基金成立未满六个月。

## § 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 |        |                                                                                                                                                                                   |
| 范杨  | 国泰海通君得鑫2年持有混合基金经理，国泰海通消费机遇混合发起基金经理，国泰海通君得诚混合基金经理，国泰海通港股优势精选股票发起（QDII）基金经理。现任权益投资部总经理助理，公募权益投资部基金经理。 | 2026-03-27  | -    | 14 年   | 范杨，北京大学西方经济学硕士研究生，曾在上海申银万国证券研究所有限公司、瑞银证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、凯盛融英信息科技有限公司（上海）股份有限公司分别担任助理研究员、研究员、首席研究员、院长职务。2020年11月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任权益研究部副院长、常务副总经理，现任权益投资部总经理助理，公募权益投资部基金经理。 |
| 于志浩 | 国泰海通中证香港科技指数发起（QDII）基金经理，国泰海通中证港股通高股息投资指数发起（QDII）基金经理，国泰海通港股优势精选股票发起（QDII）基金                        | 2026-04-17  | -    | 10 年   | 于志浩，大连理工大学船舶与海洋结构物设计制造专业，硕士研究生。历任上海海通证券资产管理有限公司权益研究部研究员、公募权益部投资经理；2026年                                                                                                           |

|     |                                                                                                                      |            |   |     |                                                                                                           |
|-----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|---|-----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     | 经理。现任综合策略投资部基金经理。                                                                                                    |            |   |     | 1月加入上海国泰海通证券资产管理有限公司，现任综合策略投资部基金经理。                                                                       |
| 钱玲玲 | 国泰海通中证港股通高股息投资指数发起（QDII）基金经理，国泰海通中证香港科技指数发起（QDII）基金经理，国泰海通港股优势精选股票发起（QDII）基金经理，国泰海通中证港股通科技指数发起基金经理。现任综合策略投资部基金经理。    | 2026-04-17 | - | 10年 | 钱玲玲，南京大学产业经济学硕士，历任上海海通证券资产管理有限公司权益投资二部投资经理助理、权益二部投资经理、公募权益部总监助理，2025年11月加入上海国泰海通证券资产管理有限公司，现任综合策略投资部基金经理。 |
| 邓雅琨 | 国泰海通中证500指数增强基金经理，国泰海通中证香港科技指数发起（QDII）基金经理，国泰海通中证港股通高股息投资指数发起（QDII）基金经理，国泰海通新锐量化选股混合基金经理，国泰海通中证全指指数增强基金经理，国泰海通稳债增利债券 | 2026-03-27 | - | 5年  | 邓雅琨，卡耐基梅隆大学计算金融专业，硕士研究生。2021年3月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任权益与衍生品部量化研究员助理，量化投资部研究员助理、投资助理，现任量化投资部（公募）基金经理。       |

|  |                                                                                    |  |  |  |  |
|--|------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|
|  | 发起基金经理，国泰海通君得盛债券基金经理，国泰海通港股优势精选股票发起（QDII）基金经理，国泰海通中证港股通科技指数发起基金经理。现任量化投资部（公募）基金经理。 |  |  |  |  |
|--|------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|

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 报告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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

4.3 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 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。

#### 4.4.2 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。

#### 4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2026 年二季度港股走出“先扬后抑”行情，期间恒生指数累计下跌 7.69%，恒生科技累计下跌 3.82%，科技风格好于大盘。4-5 月市场表现较好，恒指上冲至年内次高点；6 月在美联储紧缩预期与美元走强冲击下急挫，录得全年最差月份。行业分化较大，能源回吐收益，消费表现不佳，科技整体占优，其中工业、金融和信息科技业相对抗跌。

二季度港股资金面经历“南向先撤后补、外资持续流出、6 月末逆向布局”的完整转折。南向资金呈现明显的“V 型”节奏：4 月净流入 495 亿元、5 月首次转为单月净流出 30 亿元（近三年首次），6 月伴随港股回调转为积极抄底、净流入 236 亿元。外资方面，EPFR 口径显示，主动外资在 2 月大幅流入后再度转为净流出，而被动基金保持连续净流入。值得注意的是，6 月末在指数超跌后，南向与外资均出现逆向布局迹象，成为赔率修复的重要信号。

二季度港股经历外部流动性主导的估值杀跌，但基本面未恶化、恒科盈利已企稳、能源/资源/AI 硬件盈利持续上修。一季报显示，港股互联网外卖补贴退坡、明确减亏路径，叠加 AI 商业化加速（云收入、广告提速等），大模型和 AI Agent 取得进展，基本面或已见底。随着 2026 下半年至 2027 年业绩的持续修复，港股优质资产估值有望向中枢回归。

当前港股估值具备较高性价比，赔率呈修复态势，本基金配置维持“高股息防御打底+科技成长掘金”的哑铃结构。科技：仍是港股中长期最有弹性方向，恒科估值触底、静待 AI 与流动性催化。当全球 AI 定价从上游硬件扩散至应用侧，互联网平台的“云+模型+场景”将获得重估。高股息：在 10 年美债 4.44%、内地长端利率企稳环境下，高股息资产对绝对收益型资金和险资仍具吸引力，是当前港股最稳定的收益来源之一，可作为“防御打底”的哑铃组合底仓，等待加息预期落空与资金回流的共振信号。

截至报告期末国泰海通港股优势精选股票型发起（QDII）A 基金份额净值为 0.9048 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.32%，同期业绩比较基准收益率为-6.98%；截至报告期末国泰海通港股优势精选股票型发起（QDII）C 基金份额净值为 0.9039 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.40%，同期业绩比较基准收益率为-6.98%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用。

### § 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(人民币元)      | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|-----------------------|---------------|------------------|
| 1  | 权益投资                  | 15,733,386.88 | 92.53            |
|    | 其中：普通股                | 15,733,386.88 | 92.53            |
|    | 优先股                   | —             | —                |
|    | 存托凭证                  | —             | —                |
|    | 房地产信托                 | —             | —                |
| 2  | 基金投资                  | —             | —                |
| 3  | 固定收益投资                | —             | —                |
|    | 其中：债券                 | —             | —                |
|    | 资产支持证券                | —             | —                |
| 4  | 金融衍生品投资               | —             | —                |
|    | 其中：远期                 | —             | —                |
|    | 期货                    | —             | —                |
|    | 期权                    | —             | —                |
|    | 权证                    | —             | —                |
| 5  | 买入返售金融资产              | —             | —                |
|    | 其中：买断式回购的<br>买入返售金融资产 | —             | —                |
| 6  | 货币市场工具                | —             | —                |
| 7  | 银行存款和结算备付<br>金合计      | 1,176,785.55  | 6.92             |
| 8  | 其他资产                  | 93,986.40     | 0.55             |
| 9  | 合计                    | 17,004,158.83 | 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 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

| 国家（地区） | 公允价值(人民币元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|--------|---------------|--------------|
| 中国香港   | 15,733,386.88 | 92.78        |
| 合计     | 15,733,386.88 | 92.78        |

## 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

| 行业类别     | 公允价值(人民币元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----------|---------------|--------------|
| 原材料      | 92,761.14     | 0.55         |
| 非日常生活消费品 | 4,776,560.86  | 28.17        |
| 日常消费品    | 246,986.10    | 1.46         |
| 医疗保健     | 0.00          | 0.00         |
| 能源       | 874,708.03    | 5.16         |
| 金融       | 1,541,914.23  | 9.09         |
| 工业       | 1,572,744.28  | 9.27         |
| 信息技术     | 2,865,290.87  | 16.90        |
| 通讯业务     | 3,431,382.22  | 20.24        |
| 公用事业     | 239,841.40    | 1.41         |
| 房地产      | 91,197.75     | 0.54         |
| 合计       | 15,733,386.88 | 92.79        |

注：以上分类采用全球行业分类标准。

## 5.4 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及存托凭证投资明细

| 序号 | 公司名称(英文) | 公司名称(中文)       | 证券代码  | 所在证券市场  | 所属国家(地区) | 数量(股)  | 公允价值(人民币元)   | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------|----------------|-------|---------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | SMIC     | 中芯国际集成电路制造有限公司 | 00981 | 香港证券交易所 | 中国香港     | 14,000 | 1,087,077.18 | 6.41         |
| 2  | NTES-S   | 网易             | 09999 | 香港证券交易所 | 中国香港     | 5,800  | 1,019,608.22 | 6.01         |
| 3  | TENCENT  | 腾讯控            | 00700 | 香港证     | 中国香      | 2,400  | 895,926      | 5.28         |

|    |               |              |       |         |      |         |               |       |
|----|---------------|--------------|-------|---------|------|---------|---------------|-------|
|    |               | 股有限公司        |       | 券交易所    | 港    |         | . 70          |       |
| 4  | MEITUAN-W     | 美团           | 03690 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 13, 500 | 803, 191 . 61 | 4. 74 |
| 5  | BYD COMPANY   | 比亚迪股份有限公司    | 01211 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 11, 900 | 748, 824 . 73 | 4. 42 |
| 6  | XIAOMI-W      | 小米集团         | 01810 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 38, 800 | 729, 262 . 37 | 4. 30 |
| 7  | BABA-W        | 阿里巴巴集团控股有限公司 | 09988 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 8, 800  | 709, 674 . 83 | 4. 19 |
| 8  | HUA HONG SEMI | 华虹宏力半导体有限公司  | 01347 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 3, 000  | 560, 735 . 88 | 3. 31 |
| 9  | BIDU-SW       | 百度集团         | 09888 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 5, 600  | 533, 081 . 25 | 3. 14 |
| 10 | LENOVO GROUP  | 联想集团有限公司     | 00992 | 香港证券交易所 | 中国香港 | 26, 000 | 519, 844 . 55 | 3. 07 |

## 5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

## 5.9 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

本基金本报告期末未持有基金。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 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没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(人民币元)  |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | —         |
| 2  | 应收证券清算款 | —         |
| 3  | 应收股利    | 93,976.41 |
| 4  | 应收利息    | —         |
| 5  | 应收申购款   | 9.99      |
| 6  | 其他应收款   | —         |
| 7  | 其他      | —         |
| 8  | 合计      | 93,986.40 |

### 5.10.4 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。

### 5.10.5 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

|                           | 国泰海通港股优势精选股票发起（QDII）A | 国泰海通港股优势精选股票发起（QDII）C |
|---------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 14,299,792.80         | 5,000,344.45          |
| 报告期期间基金总申购份额              | 171,469.51            | 10.03                 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 725,377.11            | 150.01                |
| 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               | 13,745,885.20         | 5,000,204.47          |

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交易明细

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细\_本期

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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细\_上期

上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 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   | 10,050,587.22 | 53.61%       | 10,050,587.22 | 53.61%       | 自基金合同生效日起不少于3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -            | -             | -            | -              |
| 基金经理等人员     | 10,000.39     | 0.05%        | -             | -            | -              |
| 基金管理人股东     | -             | -            | -             | -            | -              |
| 其他          | -             | -            | -             | -            | -              |
| 合计          | 10,060,587.61 | 53.66%       | 10,050,587.22 | 53.61%       | -              |

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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              | 20260401<br>–<br>20260630 | 10,050,587.22 | –    | –    | 10,050,587.22 | 53.61% |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                |                           |               |      |      |               |        |
| <p>本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%, 则面临大额赎回的情况, 可能导致:</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对, 可能会产生基金仓位调整困难, 导致流动性风险; 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回, 基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延赎回, 如果连续 2 个开放日以上(含本数) 发生巨额赎回, 基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请, 对剩余投资者的赎回办理造成影响;</p> <p>(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要, 则可能使基金资产净值受到不利影响, 影响基金的投资运作和收益水平;</p> <p>(3) 因基金净值精度计算问题, 或因赎回费收入归基金资产, 导致基金净值出现较大波动;</p> <p>(4) 基金资产规模过小, 可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;</p> <p>(5) 大额赎回导致基金资产规模过小, 不能满足存续的条件, 基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p> |                |                           |               |      |      |               |        |

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予国泰海通港股优势精选股票型发起式证券投资基金（QDII）募集注册的文件;
- 2、《国泰海通港股优势精选股票型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》;

- 3、《国泰海通港股优势精选股票型发起式证券投资基金（QDII）托管协议》；
- 4、《国泰海通港股优势精选股票型发起式证券投资基金（QDII）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。

## 10.2 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>。

## 10.3 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