

国泰安益灵活配置混合型证券投资基金
2026 年中期报告
2026 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：宁波银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

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。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	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
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
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	51
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	51
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.11 投资组合报告附注	51
8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 盈利投资者数量占比	52

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.4 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	53
9 开放式基金份额变动	53
10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	54
10.8 其他重大事件	55
11 影响投资者决策的其他重要信息	56
12 备查文件目录	56
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	国泰安益灵活配置混合型证券投资基金		
基金简称	国泰安益灵活配置混合		
基金主代码	001850		
交易代码	001850		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016 年 12 月 23 日		
基金管理人	国泰基金管理有限公司		
基金托管人	宁波银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	79,969,278.87 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	国泰安益灵活配置混合 A	国泰安益灵活配置混合 C	国泰安益灵活配置混合 E
下属分级基金的交易代码	001850	004252	022049
报告期末下属分级基金的份额总额	50,148,587.78 份	29,805,786.70 份	14,904.39 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求稳健的投资回报。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、固定收益类投资工具投资策略；5、中小企业私募债投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、权证投资策略；8、股指期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	宁波银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	倪莹	柴飞桦
	联系电话	021-31081600转	0574-81851181
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	custody-audit@nbc.cn
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	0574-83895886
传真		021-31081800	0574-89103213

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	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345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	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345号
邮政编码	200082	315100
法定代表人	周向勇	庄灵君

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金中期报告置备地点	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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）		
	国泰安益灵活配置混合 A	国泰安益灵活配置混合 C	国泰安益灵活配置混合 E
本期已实现收益	8,261,862.02	4,540,137.54	3,966.11
本期利润	6,184,165.72	2,698,220.04	5,614.63
加权平均基金份额本期利润	0.1184	0.0956	0.3228
本期加权平均净值利润率	6.96%	5.65%	18.97%
本期基金份额净值增长率	6.84%	6.80%	6.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
	国泰安益灵活配置混合 A	国泰安益灵活配置混合 C	国泰安益灵活配置混合 E
期末可供分配利润	38,731,939.94	22,794,515.86	11,453.87
期末可供分配基金份额利润	0.7723	0.7648	0.7685
期末基金资产净值	88,880,527.72	52,600,302.56	26,358.26

期末基金份额净值	1.7723	1.7648	1.7685
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
	国泰安益灵活配置混合 A	国泰安益灵活配置混合 C	国泰安益灵活配置混合 E
基金份额累计净值增长率	92.30%	87.31%	31.35%

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

国泰安益灵活配置混合 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
过去三个月	10.75%	1.15%	6.54%	0.63%	4.21%	0.52%
过去六个月	6.84%	1.05%	4.94%	0.57%	1.90%	0.48%
过去一年	27.80%	0.96%	13.76%	0.51%	14.04%	0.45%
过去三年	22.61%	0.65%	22.49%	0.55%	0.12%	0.10%
过去五年	19.51%	0.53%	10.69%	0.55%	8.82%	-0.02%
过去七年	67.50%	0.50%	35.79%	0.58%	31.71%	-0.08%
自基金合同生效起至今	92.30%	0.46%	55.08%	0.58%	37.22%	-0.12%

国泰安益灵活配置混合 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
过去三个月	10.73%	1.15%	6.54%	0.63%	4.19%	0.52%
过去六个月	6.80%	1.05%	4.94%	0.57%	1.86%	0.48%
过去一年	27.67%	0.96%	13.76%	0.51%	13.91%	0.45%
过去三年	22.40%	0.65%	22.49%	0.55%	-0.09%	0.10%
过去五年	19.07%	0.53%	10.69%	0.55%	8.38%	-0.02%
过去七年	66.70%	0.50%	35.79%	0.58%	30.91%	-0.08%
自新增 C 类份额起至今	87.31%	0.47%	51.67%	0.58%	35.64%	-0.11%

国泰安益灵活配置混合 E

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去三个月	10.73%	1.15%	6.54%	0.63%	4.19%	0.52%
过去六个月	6.77%	1.05%	4.94%	0.57%	1.83%	0.48%
过去一年	27.63%	0.96%	13.76%	0.51%	13.87%	0.45%
自新增 E 类份 额起至今	31.35%	0.81%	27.91%	0.61%	3.44%	0.20%

3.2.2 自基金合同生效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

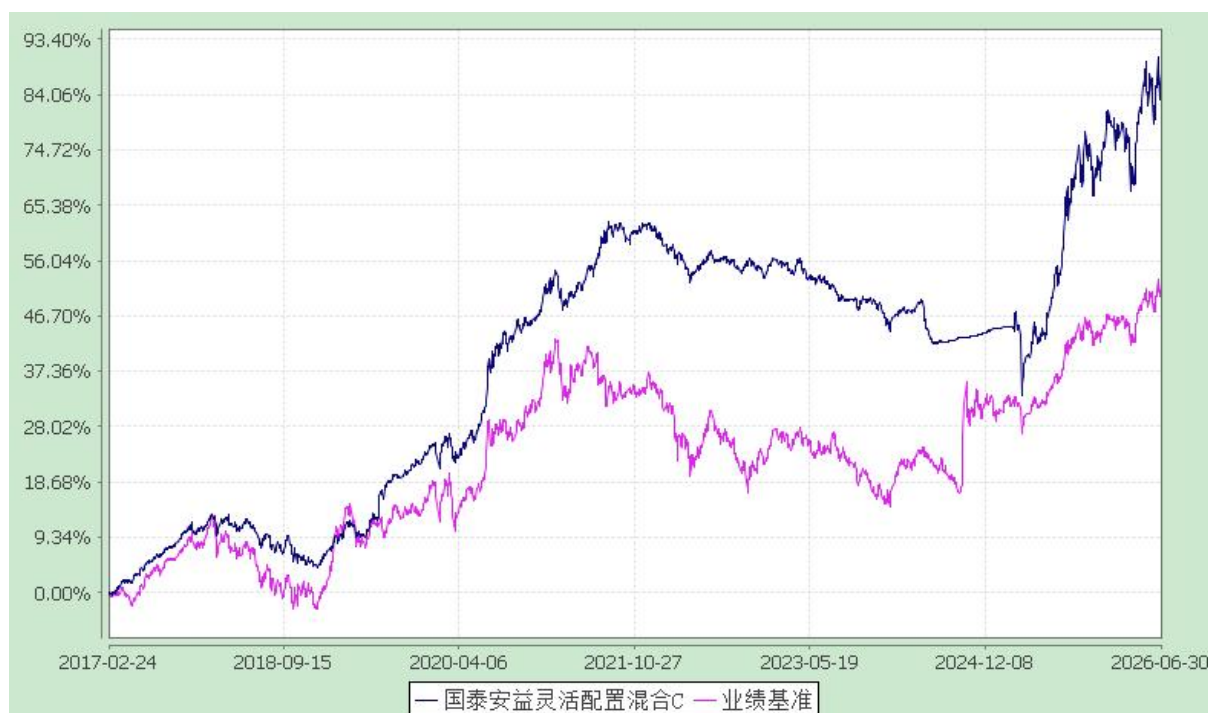
国泰安益灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016 年 12 月 23 日至 2026 年 6 月 30 日)

国泰安益灵活配置混合 A



注：本基金合同生效日为 2016 年 12 月 23 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。

国泰安益灵活配置混合 C



注：（一）本基金的合同生效日为 2016 年 12 月 23 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。

（二）自 2017 年 2 月 24 日起，本基金增加 C 类份额并分别设置对应的基金代码。

国泰安益灵活配置混合 E



注：（一）本基金合同生效日为 2016 年 12 月 23 日，本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

（二）自 2024 年 8 月 27 日起，本基金新增 E 类基金份额并设置对应的基金代码。自 2024 年 8

月 30 日起，E 类基金开始有份额并计算净值。

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 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 319 只公开募集证券投资基金。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		
王琳	国泰兴益灵活配置混合、国泰安益灵活配置混合、国泰佳益混合、国泰悦益六个月持有混合、国泰慧益一年持有混合、国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）、国泰医药健康股票的基金经理	2019-08-16	-	17 年	博士研究生。2009 年 2 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2017 年 1 月起任国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 8 月任国泰添益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 4 月任国泰福益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 6 月至 2018 年 3 月任国泰睿信平衡混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月至 2018 年 3 月任国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月至 2024 年 1 月任国泰安康定期支付混合型证券投资基

					金(原国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金)的基金经理, 2017 年 8 月至 2018 年 5 月任国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2019 年 5 月至 2025 年 9 月任国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金和国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2019 年 8 月起兼任国泰安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2019 年 8 月至 2024 年 8 月任国泰普益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2019 年 8 月至 2021 年 2 月任国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金的基金经理, 2020 年 3 月至 2021 年 3 月任国泰双利债券证券投资基金的基金经理, 2021 年 6 月起兼任国泰佳益混合型证券投资基金的基金经理, 2025 年 1 月起兼任国泰悦益六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理, 2025 年 2 月起兼任国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金(LOF)和国泰慧益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理, 2025 年 4 月至 2026 年 4 月任国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2026 年 1 月起兼任国泰医药健康股票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 and 不当关联交易及其他违规行为。

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，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 10 次，为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 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

回顾 2026 年上半年，国内资本市场各大指数呈现显著的 K 型分化。具体而言，上证指数上涨 3.16%，深证成指上涨 19.82%，创业板指上涨 35.58%，科创 50 指数上涨 64.25%。从行业表现来看，电子、通信、建材等板块涨幅居前；反之，消费者服务、综合金融、农林牧渔等板块跌幅居前。结构上的 K 型分化主要发生在二季度。

国际宏观环境方面，美伊冲突进入到二季度之后一度趋于和缓，最终停战，霍尔木兹海峡重启，石油价格下行，市场风偏上行。与此同时，AI 产业景气度持续高歌猛进，大厂大幅提升资本开支、产业链相关硬件价格持续大比例提价、政策配套明确支持产业发展。而宏观经济数据稳中偏弱，与科技的迅猛发展形成对比。在此背景下，资本市场呈现出显著的结构性差异走势，科技一枝独秀。

回顾本基金在 2026 年上半年的投资操作，本基金重视股票底仓的结构性配置，并积极参与科创板、主板、创业板新股投资。

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 6.84%，同期业绩比较基准收益率为 4.94%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为 6.80%，同期业绩比较基准收益率为 4.94%。

本基金 E 类本报告期内的净值增长率为 6.77%，同期业绩比较基准收益率为 4.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，霍尔木兹海峡已经重启，美伊冲突对能源价格等影响已经阶段性结束。同时人工智能、机器人、创新药等产业周期继续上行。基于对国内外经济形势的综合研判，我们认为市场后续具有较好的结构性投资机会。以下几个关键要素值得持续关注：其一，美国加息预期的波动；其二，国内经济修复进程如何进一步深化，重点关注投资、消费等高频经济数据的动态变化；其三，产业资本在人工智能（AI）、机器人、智能驾驶以及创新药等新兴行业的投资进展，涵盖全球产业技术革新成果、新技术路线产品的研发推出情况，以及国内外项目合作推进程度等；其四，各行业及上市公司的经营状况变化，尤其是业绩增长的可持续性与经营风险管控能力，短期关注中报情况。

综合以上因素，我们对后续市场重点关注以下投资方向：

1) 医药板块。国内创新药的产业趋势仍在上行期。相比于 2025 年投资创新药本身，2026 年创新药产业链的投资机会更为明确。随着创新药企融资环境的持续改善，创新药产业链企业（包括上游、临床 CRO 等）的订单情况已经在 2025 年开始显现拐点迹象，进入上行通道。进入 2026 年后，上行趋势加速，该板块具备较为明确的投资价值。相关上市公司 2026 年一季报的披露使得该趋势进一步明朗，未来中报的披露将进一步验证我们对行业周期的预期。部分创新药股价已经回调明显，后续创新管线数据的读出、BD 的进展也是我们重点关注的方向。此外，AI 医疗、脑机接口等处于产业发展早期阶段，存有主题性投资机会，重点关注技术突破，产业投融资事件等。

2) 科技成长赛道：AI 软硬件、人形机器人、智能驾驶等全球共进的产业领域蕴含短中长期投资机遇。

3) 顺周期板块：对经济周期的变化保持关注，CPI/PPI 保持持续跟进。上海二手房市场持续情况较好，保持关注。相关板块包括化工、有色、建材、轻工以及消费等，2026 年后续或有较好的投资机会，保持跟踪行业数据，做好个股挖掘。

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人进行复核。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、会计核算等证券投资基金行业从业

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

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

本报告期内，本托管人在国泰安益灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：“财务会计报告”中的“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

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：国泰安益灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	483,700.84	48,250,518.02
结算备付金		-	161,968.77
存出保证金		88,091.55	53,436.88
交易性金融资产	6.4.7.2	141,087,264.14	163,180,582.54
其中：股票投资		133,438,001.56	153,776,840.40
基金投资		-	-
债券投资		7,649,262.58	9,403,742.14
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		500.00	110.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		141,659,556.53	211,646,616.21
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
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		7.33	37,450,511.29
应付赎回款		155.58	91,479.16
应付管理人报酬		44,958.46	76,031.38
应付托管费		5,619.82	9,503.90
应付销售服务费		4,046.04	10,539.25
应付投资顾问费		-	-
应交税费		222.74	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	97,358.02	145,985.56
负债合计		152,367.99	37,784,050.54
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	79,969,278.87	104,963,880.94

未分配利润	6.4.7.8	61,537,909.67	68,898,684.73
净资产合计		141,507,188.54	173,862,565.67
负债和净资产总计		141,659,556.53	211,646,616.21

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 79,969,278.87 份，其中 A 类基金份额净值 1.7723 元，份额总额 50,148,587.78 份；C 类基金份额净值 1.7648 元，份额总额 29,805,786.70 份；E 类基金份额净值 1.7685 元，份额总额 14,904.39 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰安益灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		9,304,735.69	4,723,284.90
1.利息收入		28,704.91	102,211.48
其中：存款利息收入	6.4.7.9	28,704.91	95,381.01
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		-	6,830.47
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		13,187,340.60	3,142,698.66
其中：股票投资收益	6.4.7.10	11,952,769.72	31,113.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	54,594.95	74,397.14
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	1,179,975.93	3,037,188.12
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	-3,917,965.28	1,399,355.57
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	6,655.46	79,019.19
减：二、营业总支出		416,735.30	458,063.25
1. 管理人报酬		272,919.13	362,413.50
2. 托管费		34,114.91	45,301.76
3. 销售服务费		24,034.96	49,830.26
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	493.15

其中：卖出回购金融资产支出		-	493.15
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		119.83	24.58
8. 其他费用	6.4.7.16	85,546.47	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,888,000.39	4,265,221.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,888,000.39	4,265,221.65
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		8,888,000.39	4,265,221.65

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰安益灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	104,963,880.94	68,898,684.73	173,862,565.67
二、本期期初净资产	104,963,880.94	68,898,684.73	173,862,565.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-24,994,602.07	-7,360,775.06	-32,355,377.13
（一）、综合收益总额	-	8,888,000.39	8,888,000.39
（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）	-24,994,602.07	-16,248,775.45	-41,243,377.52
其中：1.基金申购款	22,968,158.13	17,217,500.32	40,185,658.45
2.基金赎回款	-47,962,760.20	-33,466,275.77	-81,429,035.97
（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	-	-	-

产减少以“-”号填列)			
四、本期期末净资产（基金净值）	79,969,278.87	61,537,909.67	141,507,188.54
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	12,392,177.87	4,514,411.51	16,906,589.38
二、本期期初净资产	12,392,177.87	4,514,411.51	16,906,589.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	192,010,781.25	74,046,900.87	266,057,682.12
（一）、综合收益总额	-	4,265,221.65	4,265,221.65
（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）	192,010,781.25	69,781,679.22	261,792,460.47
其中：1.基金申购款	232,733,086.88	84,675,326.29	317,408,413.17
2.基金赎回款	-40,722,305.63	-14,893,647.07	-55,615,952.70
（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	204,402,959.12	78,561,312.38	282,964,271.50

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：吴洪涛，会计机构负责人：张洁清

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰安益灵活配置混合型证券投资基金(简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称

“中国证监会”)证监许可[2015]1947 号《关于准予国泰安益灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和中国证监会机构部函[2016]2420 号《关于国泰安益灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》核准,由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰安益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 200,022,346.59 元。业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1730 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰安益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,031,347.54 份基金份额,其中认购资金利息折合 9,000.95 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为宁波银行股份有限公司。

根据 2017 年 2 月 24 日发布的《关于国泰安益灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同的公告》,自 2017 年 2 月 24 日起,本基金增加 C 类基金份额并分别设置对应的基金代码,投资人申购时可以选择 A 类基金份额(现有份额)或 C 类基金份额对应的基金代码进行申购。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。新增 C 类基金份额前已持有本基金基金份额的投资人,其基金账户中保留的本基金基金份额余额为 A 类基金份额。由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,而 C 类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同,在收益分配数额方面可能有所不同。

根据基金管理人国泰基金管理有限公司于 2024 年 8 月 27 日发布的《关于国泰安益灵活配置混合型证券投资基金降低相关费率、增加 E 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》的规定,经与基金托管人协商一致,自 2024 年 8 月 27 日起对本基金增加 E 类基金份额并相应修改法律文件。增加 E 类基金份额后,本基金将形成 A 类、C 类和 E 类三类基金份额。本基金现有的 A 类基金份额及 C 类基金份额保持不变。本基金各类基金份额分别设置对应的基金代码,投资人申购时可以选择 A 类、C 类或 E 类基金份额对应的基金代码进行申购。由于基金费用的不同,各类基金份额分别计算并公告基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰安益灵活配置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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证等)、权证、股指期货等权益类金融工具,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、政府支持债券、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)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金的投资组合

比例为：股票资产占基金资产的 0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券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×50%+中证综合债指数收益率×50%。

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 2026 年 8 月 27 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 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

根据中华人民共和国主席令第 41 号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、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[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[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》、财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(2) 自 2025 年 8 月 8 日起，对基金取得的在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税；对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。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。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 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。

(6) 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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	483,700.84
等于：本金	481,594.30
加：应计利息	2,106.54
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	483,700.84

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		119,816,057.32	-	133,438,001.56	13,621,944.24
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所		42,422.58		
	市场	7,597,020.00		7,649,262.58	9,820.00
	银行间	-	-	-	-

	市场				
	合计	7,597,020.00	42,422.58	7,649,262.58	9,820.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		127,413,077.32	42,422.58	141,087,264.14	13,631,764.24

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

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	30,411.55
其中：交易所市场	30,411.55
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	66,946.47
合计	97,358.02

6.4.7.7 实收基金

国泰安益灵活配置混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	64,674,267.10	64,674,267.10
本期申购	82,288.01	82,288.01
本期赎回（以“-”号填列）	-14,607,967.33	-14,607,967.33
本期末	50,148,587.78	50,148,587.78

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

国泰安益灵活配置混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	40,182,262.27	40,182,262.27
本期申购	22,880,135.91	22,880,135.91
本期赎回（以“-”号填列）	-33,256,611.48	-33,256,611.48
本期末	29,805,786.70	29,805,786.70

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

国泰安益灵活配置混合 E

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	107,351.57	107,351.57
本期申购	5,734.21	5,734.21
本期赎回（以“-”号填列）	-98,181.39	-98,181.39
本期末	14,904.39	14,904.39

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

国泰安益灵活配置混合 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	63,045,795.74	-20,438,483.77	42,607,311.97
本期期初	63,045,795.74	-20,438,483.77	42,607,311.97
本期利润	8,261,862.02	-2,077,696.30	6,184,165.72
本期基金份额交易产生的变动数	-14,425,240.52	4,365,702.77	-10,059,537.75
其中：基金申购款	87,772.93	-27,843.79	59,929.14
基金赎回款	-14,513,013.45	4,393,546.56	-10,119,466.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	56,882,417.24	-18,150,477.30	38,731,939.94

国泰安益灵活配置混合 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	38,878,557.82	-12,657,640.61	26,220,917.21
本期期初	38,878,557.82	-12,657,640.61	26,220,917.21
本期利润	4,540,137.54	-1,841,917.50	2,698,220.04
本期基金份额交易产生的变动数	-9,872,215.87	3,747,594.48	-6,124,621.39
其中：基金申购款	24,809,303.34	-7,656,097.95	17,153,205.39
基金赎回款	-34,681,519.21	11,403,692.43	-23,277,826.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,546,479.49	-10,751,963.63	22,794,515.86

国泰安益灵活配置混合 E

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	104,371.96	-33,916.41	70,455.55
本期期初	104,371.96	-33,916.41	70,455.55
本期利润	3,966.11	1,648.52	5,614.63
本期基金份额交易产生的变动数	-91,493.01	26,876.70	-64,616.31
其中：基金申购款	6,205.20	-1,839.41	4,365.79
基金赎回款	-97,698.21	28,716.11	-68,982.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,845.06	-5,391.19	11,453.87

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

活期存款利息收入	28,272.73
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	120.19
其他	311.99
合计	28,704.91

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	77,860,310.88
减：卖出股票成本总额	65,802,602.53
减：交易费用	104,938.63
买卖股票差价收入	11,952,769.72

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	37,340.73
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	17,254.22
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	54,594.95

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,810,385.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,682,231.78
减：应计利息总额	110,899.50
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	17,254.22

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,179,975.93
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	1,179,975.93

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-3,917,965.28
——股票投资	-3,910,857.06
——债券投资	-7,108.22
——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	-3,917,965.28

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	6,591.73
转换费收入	63.73
合计	6,655.46

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. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不少于转出基金赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	7,439.10
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,000.00
上清所查询服务费	600.00
合计	85,546.47

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、关联关系

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
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	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

本基金本报告期内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 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	272,919.13	362,413.50
其中：应支付销售机构的客户维护费	20,028.08	41,532.08
应支付基金管理人的净管理费	252,891.05	320,881.42

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.40%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	34,114.91	45,301.76

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

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 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	国泰安益灵活配置混 合 A	国泰安益灵活配置 混合 C	国泰安益灵活配置混 合 E	合计
	宁波银行	-	6.25	6.25
国泰基金管 理有限公司	-	13,120.61	-	13,120.61
合计	-	13,120.61	6.25	13,126.86
获得销售服 务费的各关 联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	国泰安益灵活配置混 合 A	国泰安益灵活配置 混合 C	国泰安益灵活配置混 合 E	合计
	宁波银行	-	798.21	1,628.08
国泰基金管 理有限公司	-	19,451.66	-	19,451.66
合计	-	20,281.53	798.21	21,079.74

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 0.10%，E 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.10%。其计算公式为：

日销售服务费=前一日各类基金份额的基金资产净值 X 约定年费率/ 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与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 2026年1月1日至2026年6月30日			上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	国泰安益灵活配置混合A	国泰安益灵活配置混合C	国泰安益灵活配置混合E	国泰安益灵活配置混合A	国泰安益灵活配置混合C	国泰安益灵活配置混合E
期初持有的基金份额	28,916,554.96	431,448.35	-	71,002.08	431,448.35	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	29,196,350.36	-	-
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	28,916,554.96	431,448.35	-	29,267,352.44	431,448.35	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	36.16%	0.54%	-	14.32%	0.21%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025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
宁波银行	483,700.84	28,272.73	28,594,522.00	92,911.12

注：本基金的银行存款由基金托管人宁波银行保管，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

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2026 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
688795	摩尔线程	2025-1-1-26	6 个月以上	新股锁定流通受限	114.28	676.94	985.00	112,565.80	666,785.90	-
688783	西安奕材	2025-1-0-20	6 个月以上	新股锁定流通受限	8.62	57.42	11,298.00	97,388.76	648,731.16	-
688802	沐曦股份	2025-1-2-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	104.66	768.89	732.00	76,611.12	562,827.48	-
688765	禾元生物	2025-1-0-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	29.06	48.56	4,657.00	135,332.42	226,143.92	-

				受限						
688781	视涯科技	2026-03-18	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	22.68	42.16	1,267.00	28,735.56	53,416.72	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	81.88	1,584.33	28.00	2,292.64	44,361.24	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	44.56	468.67	50.00	2,228.00	23,433.50	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	19.68	141.49	164.00	3,227.52	23,204.36	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	17.52	35.92	633.00	11,090.16	22,737.36	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	26.28	172.09	100.00	2,628.00	17,209.00	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	21.93	77.78	195.00	4,276.35	15,167.10	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	40.98	308.19	49.00	2,008.02	15,101.31	-
688811	有研复材	2026-04-01	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	6.41	24.13	413.00	2,647.33	9,965.69	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	17.70	84.32	80.00	1,416.00	6,745.60	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6 个月以上	新股 锁定 流通 受限	13.86	73.46	86.00	1,191.96	6,317.56	-

603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月以上	新股锁定流通受限	15.76	46.71	61.00	961.36	2,849.31	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月以上	新股锁定流通受限	11.18	17.59	160.00	1,788.80	2,814.40	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月以上	新股锁定流通受限	37.88	34.87	34.00	1,287.92	1,185.58	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	33.49	33.93	22.00	736.78	746.46	-

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暂时停牌等流通受限股票。

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、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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。本基金投资目标是在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。

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宁波银行，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 2026 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2025 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 2026 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内，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公司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 2026 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	483,700.84	-	-	-	483,700.84
存出保证金	88,091.55	-	-	-	88,091.55
交易性金融资产	7,649,262.58	-	-	133,438,001.56	141,087,264.14
应收申购款	-	-	-	500.00	500.00
资产总计	8,221,054.97	-	-	133,438,501.56	141,659,556.53
负债					
应付清算款	-	-	-	7.33	7.33
应付赎回款	-	-	-	155.58	155.58
应付管理人报酬	-	-	-	44,958.46	44,958.46
应付托管费	-	-	-	5,619.82	5,619.82
应付销售服务费	-	-	-	4,046.04	4,046.04
应交税费	-	-	-	222.74	222.74
其他负债	-	-	-	97,358.02	97,358.02
负债总计	-	-	-	152,367.99	152,367.99
利率敏感度缺口	8,221,054.97	-	-	133,286,133.57	141,507,188.54
上年度末 2025 年 12 月 31	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

日					
资产					
货币资金	48,250,518.02	-	-	-	48,250,518.02
结算备付金	161,968.77	-	-	-	161,968.77
存出保证金	53,436.88	-	-	-	53,436.88
交易性金融资产	9,403,742.14	-	-	153,776,840.40	163,180,582.54
应收申购款	-	-	-	110.00	110.00
资产总计	57,869,665.81	-	-	153,776,950.40	211,646,616.21
负债					
应付清算款	-	-	-	37,450,511.29	37,450,511.29
应付赎回款	-	-	-	91,479.16	91,479.16
应付管理人报酬	-	-	-	76,031.38	76,031.38
应付托管费	-	-	-	9,503.90	9,503.90
应付销售服务费	-	-	-	10,539.25	10,539.25
其他负债	-	-	-	145,985.56	145,985.56
负债总计	-	-	-	37,784,050.54	37,784,050.54
利率敏感度缺口	57,869,665.81	-	-	115,992,899.86	173,862,565.67

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-	-
	市场利率下降 25 个基点	-	-

注：于 2026 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 5.41%（2025 年 12 月 31 日：5.41%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2025 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，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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	133,438,001.56	94.30	153,776,840.40	88.45
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	-	-	-	-
合计	133,438,001.56	94.30	153,776,840.40	88.45

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
业绩比较基准上升 5%	增加约 1,328	增加约 1,393
业绩比较基准下降 5%	减少约 1,328	减少约 1,393

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	131,088,257.91	150,863,470.63
第二层次	7,649,262.58	10,797,771.89
第三层次	2,349,743.65	1,519,340.02
合计	141,087,264.14	163,180,582.54

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 2026 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(2025 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	133,438,001.56	94.20
	其中：股票	133,438,001.56	94.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,649,262.58	5.40
	其中：债券	7,649,262.58	5.40
	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	483,700.84	0.34
8	其他各项资产	88,591.55	0.06
9	合计	141,659,556.53	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	941,760.00	0.67
B	采矿业	6,219,097.00	4.39
C	制造业	83,388,427.98	58.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,710,865.00	2.62

E	建筑业	1,644,300.00	1.16
F	批发和零售业	210,504.00	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	3,441,919.00	2.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,241,044.50	4.41
J	金融业	24,677,194.00	17.44
K	房地产业	366,841.00	0.26
L	租赁和商务服务业	706,800.00	0.50
M	科学研究和技术服务业	1,602,289.08	1.13
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	198,240.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	88,720.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	133,438,001.56	94.30

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	300308	中际旭创	4,700	5,969,000.00	4.22
2	300750	宁德时代	13,300	5,227,033.00	3.69
3	600519	贵州茅台	3,400	4,030,666.00	2.85
4	300502	新易盛	5,988	3,634,716.00	2.57
5	601318	中国平安	55,500	2,649,570.00	1.87
6	600036	招商银行	65,200	2,314,600.00	1.64
7	688256	寒武纪	1,391	2,219,410.05	1.57
8	603986	兆易创新	2,700	2,200,500.00	1.56
9	002475	立讯精密	31,000	2,182,400.00	1.54
10	601899	紫金矿业	75,700	1,903,098.00	1.34
11	000333	美的集团	24,700	1,865,591.00	1.32
12	002371	北方华创	1,970	1,742,583.20	1.23
13	600900	长江电力	65,100	1,723,197.00	1.22
14	603259	药明康德	12,600	1,568,826.00	1.11
15	688008	澜起科技	5,022	1,556,317.80	1.10
16	601166	兴业银行	92,800	1,536,768.00	1.09

17	688981	中芯国际	9,549	1,516,572.18	1.07
18	688041	海光信息	4,066	1,505,639.80	1.06
19	600276	恒瑞医药	27,800	1,446,712.00	1.02
20	601138	工业富联	19,700	1,421,355.00	1.00
21	600030	中信证券	48,400	1,390,532.00	0.98
22	000725	京东方 A	156,000	1,354,080.00	0.96
23	300059	东方财富	64,600	1,316,548.00	0.93
24	688012	中微公司	2,656	1,244,336.00	0.88
25	601398	工商银行	173,300	1,225,231.00	0.87
26	300274	阳光电源	7,700	1,224,454.00	0.87
27	002594	比亚迪	15,000	1,195,500.00	0.84
28	300476	胜宏科技	3,000	1,039,290.00	0.73
29	002384	东山精密	3,700	970,695.00	0.69
30	601211	国泰海通	53,200	968,240.00	0.68
31	300394	天孚通信	3,104	939,518.72	0.66
32	601288	农业银行	152,800	927,496.00	0.66
33	000651	格力电器	24,400	915,000.00	0.65
34	300408	三环集团	5,400	901,260.00	0.64
35	601088	中国神华	22,000	858,880.00	0.61
36	002463	沪电股份	5,600	855,680.00	0.60
37	600919	江苏银行	75,500	813,890.00	0.58
38	000858	五 粮 液	10,900	806,600.00	0.57
39	603019	中科曙光	7,400	793,502.00	0.56
40	000338	潍柴动力	29,100	792,975.00	0.56
41	600887	伊利股份	32,800	785,888.00	0.56
42	600150	中国船舶	23,185	783,421.15	0.55
43	601816	京沪高铁	166,100	752,433.00	0.53
44	601328	交通银行	116,200	747,166.00	0.53
45	600309	万华化学	10,700	731,987.00	0.52
46	600584	长电科技	6,900	714,495.00	0.50
47	300124	汇川技术	10,300	683,199.00	0.48
48	688795	摩尔线程	985	666,785.90	0.47
49	600089	特变电工	29,300	659,250.00	0.47
50	600176	中国巨石	9,000	655,920.00	0.46
51	688783	西安奕材	11,298	648,731.16	0.46
52	603993	洛阳钼业	35,500	623,025.00	0.44
53	002028	思源电气	3,600	622,800.00	0.44
54	601688	华泰证券	29,100	600,042.00	0.42
55	002415	海康威视	17,400	595,080.00	0.42
56	600000	浦发银行	69,100	594,951.00	0.42
57	600111	北方稀土	12,100	581,405.00	0.41
58	002230	科大讯飞	13,900	567,676.00	0.40
59	601857	中国石油	65,300	566,804.00	0.40
60	688802	沐曦股份	732	562,827.48	0.40

61	002714	牧原股份	16,000	559,840.00	0.40
62	600183	生益科技	3,200	554,880.00	0.39
63	002916	深南电路	1,210	554,059.00	0.39
64	000063	中兴通讯	15,300	553,707.00	0.39
65	000100	TCL 科技	93,100	541,842.00	0.38
66	000001	平安银行	52,100	523,605.00	0.37
67	601601	中国太保	18,300	521,916.00	0.37
68	600031	三一重工	30,100	520,128.00	0.37
69	002050	三花智控	11,100	486,513.00	0.34
70	601225	陕西煤业	23,200	472,120.00	0.33
71	601229	上海银行	53,300	462,644.00	0.33
72	300760	迈瑞医疗	3,400	461,822.00	0.33
73	601668	中国建筑	105,700	458,738.00	0.32
74	600660	福耀玻璃	8,900	448,916.00	0.32
75	601728	中国电信	85,500	443,745.00	0.31
76	601919	中远海控	33,100	438,906.00	0.31
77	600941	中国移动	5,000	430,650.00	0.30
78	603501	豪威集团	4,500	426,825.00	0.30
79	300014	亿纬锂能	6,500	422,695.00	0.30
80	600406	国电南瑞	18,400	420,440.00	0.30
81	601939	建设银行	43,500	418,905.00	0.30
82	000425	徐工机械	51,600	417,444.00	0.29
83	601012	隆基绿能	31,176	409,029.12	0.29
84	300433	蓝思科技	7,600	407,816.00	0.29
85	601988	中国银行	71,000	406,120.00	0.29
86	000792	盐湖股份	13,300	401,527.00	0.28
87	600522	中天科技	6,600	400,488.00	0.28
88	600016	民生银行	124,200	399,924.00	0.28
89	601600	中国铝业	48,400	397,848.00	0.28
90	600690	海尔智家	19,400	395,954.00	0.28
91	603799	华友钴业	8,100	390,906.00	0.28
92	002352	顺丰控股	12,400	387,624.00	0.27
93	600926	杭州银行	26,600	384,370.00	0.27
94	300498	温氏股份	31,000	381,920.00	0.27
95	002460	赣锋锂业	5,800	379,320.00	0.27
96	600999	招商证券	17,800	375,580.00	0.27
97	601985	中国核电	41,500	374,745.00	0.26
98	600938	中国海油	13,700	371,955.00	0.26
99	300033	同花顺	1,540	371,140.00	0.26
100	601169	北京银行	75,700	370,930.00	0.26
101	002709	天赐材料	7,200	370,296.00	0.26
102	000977	浪潮信息	5,200	364,000.00	0.26
103	002938	鹏鼎控股	3,400	358,292.00	0.25
104	600028	中国石化	76,600	341,636.00	0.24

105	300442	润泽科技	4,100	340,587.00	0.24
106	002466	天齐锂业	5,500	337,260.00	0.24
107	601766	中国中车	64,100	333,320.00	0.24
108	688111	金山办公	1,549	330,014.45	0.23
109	601009	南京银行	33,200	328,348.00	0.23
110	000776	广发证券	14,000	327,600.00	0.23
111	000568	泸州老窖	4,200	325,584.00	0.23
112	600050	中国联通	80,100	320,400.00	0.23
113	601127	赛力斯	5,200	318,500.00	0.23
114	600160	巨化股份	5,900	312,759.00	0.22
115	603288	海天味业	9,400	311,704.00	0.22
116	002049	紫光国微	3,400	301,750.00	0.21
117	600809	山西汾酒	2,700	295,299.00	0.21
118	002600	领益智造	17,000	294,780.00	0.21
119	688126	沪硅产业	7,371	294,029.19	0.21
120	000408	藏格矿业	4,200	291,144.00	0.21
121	600489	中金黄金	16,100	290,605.00	0.21
122	601100	恒立液压	2,700	290,412.00	0.21
123	601006	大秦铁路	62,600	288,586.00	0.20
124	002027	分众传媒	59,600	288,464.00	0.20
125	000807	云铝股份	13,000	287,820.00	0.20
126	000938	紫光股份	9,900	285,714.00	0.20
127	688271	联影医疗	2,798	283,241.54	0.20
128	601628	中国人寿	8,000	282,800.00	0.20
129	601658	邮储银行	57,300	282,489.00	0.20
130	002241	歌尔股份	12,500	281,625.00	0.20
131	601336	新华保险	4,700	280,402.00	0.20
132	605117	德业股份	2,612	277,342.16	0.20
133	002625	光启技术	9,100	275,912.00	0.19
134	601872	招商轮船	15,500	272,335.00	0.19
135	600905	三峡能源	72,900	270,459.00	0.19
136	600958	东方证券	27,900	263,376.00	0.19
137	601818	光大银行	90,800	262,412.00	0.19
138	601888	中国中免	4,800	257,808.00	0.18
139	688396	华润微	2,637	257,239.35	0.18
140	600460	士兰微	4,700	256,902.00	0.18
141	600893	航发动力	6,700	256,878.00	0.18
142	300661	圣邦股份	1,770	253,959.60	0.18
143	600019	宝钢股份	46,200	250,866.00	0.18
144	002179	中航光电	5,400	249,480.00	0.18
145	600010	包钢股份	111,000	247,530.00	0.17
146	600585	海螺水泥	14,100	238,995.00	0.17
147	601689	拓普集团	4,200	236,964.00	0.17
148	600104	上汽集团	24,100	235,216.00	0.17

149	000630	铜陵有色	36,200	230,232.00	0.16
150	601995	中金公司	6,300	227,745.00	0.16
151	002422	科伦药业	5,900	227,268.00	0.16
152	688765	禾元生物	4,657	226,143.92	0.16
153	603893	瑞芯微	1,200	226,032.00	0.16
154	600989	宝丰能源	11,000	223,630.00	0.16
155	600066	宇通客车	8,300	222,523.00	0.16
156	002001	新 和 成	7,800	221,676.00	0.16
157	601838	成都银行	12,500	221,250.00	0.16
158	000538	云南白药	4,600	217,902.00	0.15
159	600795	国电电力	46,600	217,622.00	0.15
160	600011	华能国际	28,500	216,315.00	0.15
161	601390	中国中铁	51,300	213,921.00	0.15
162	601825	沪农商行	28,400	212,716.00	0.15
163	000166	申万宏源	47,800	210,320.00	0.15
164	601377	兴业证券	34,800	210,192.00	0.15
165	600547	山东黄金	9,100	210,119.00	0.15
166	603296	华勤技术	2,820	209,441.40	0.15
167	600346	恒力石化	11,800	208,978.00	0.15
168	600362	江西铜业	4,800	207,840.00	0.15
169	002311	海大集团	4,600	205,206.00	0.15
170	601669	中国电建	43,600	204,920.00	0.14
171	600188	兖矿能源	11,500	204,355.00	0.14
172	600015	华夏银行	31,900	203,841.00	0.14
173	002648	卫星化学	8,600	202,014.00	0.14
174	600426	华鲁恒升	8,300	198,536.00	0.14
175	300015	爱尔眼科	24,000	198,240.00	0.14
176	600482	中国动力	6,000	196,800.00	0.14
177	601916	浙商银行	74,500	195,935.00	0.14
178	601868	中国能建	73,100	195,177.00	0.14
179	605499	东鹏饮料	1,560	192,550.80	0.14
180	601998	中信银行	27,500	190,575.00	0.13
181	600760	中航沈飞	4,600	189,060.00	0.13
182	300418	昆仑万维	4,600	185,656.00	0.13
183	600570	恒生电子	8,600	182,234.00	0.13
184	000625	长安汽车	25,300	181,401.00	0.13
185	600875	东方电气	6,300	181,251.00	0.13
186	601066	中信建投	6,200	180,234.00	0.13
187	600048	保利发展	37,900	175,477.00	0.12
188	300316	晶盛机电	2,900	175,160.00	0.12
189	000157	中联重科	25,100	174,947.00	0.12
190	600436	片仔癀	1,600	174,848.00	0.12
191	688036	传音控股	2,963	174,668.85	0.12
192	300803	指南针	1,900	174,173.00	0.12

193	002493	荣盛石化	16,000	172,000.00	0.12
194	002736	国信证券	16,900	168,831.00	0.12
195	002074	国轩高科	6,100	167,811.00	0.12
196	600026	中远海能	9,300	166,842.00	0.12
197	000301	东方盛虹	14,500	166,025.00	0.12
198	600219	南山铝业	41,300	164,787.00	0.12
199	600196	复星医药	7,300	164,031.00	0.12
200	002236	大华股份	9,900	163,251.00	0.12
201	600115	中国东航	42,700	162,687.00	0.11
202	601058	赛轮轮胎	14,100	162,573.00	0.11
203	003816	中国广核	41,100	160,701.00	0.11
204	600415	小商品城	15,800	160,528.00	0.11
205	600886	国投电力	12,000	159,720.00	0.11
206	601901	方正证券	22,100	159,120.00	0.11
207	601360	三六零	18,200	158,158.00	0.11
208	688082	盛美上海	366	158,112.00	0.11
209	601877	正泰电器	6,300	157,941.00	0.11
210	600438	通威股份	13,000	157,430.00	0.11
211	000768	中航西飞	7,600	155,648.00	0.11
212	301269	华大九天	1,300	155,246.00	0.11
213	600009	上海机场	6,700	154,770.00	0.11
214	601788	光大证券	10,500	151,515.00	0.11
215	600233	圆通速递	9,600	151,200.00	0.11
216	600029	南方航空	29,100	150,738.00	0.11
217	688047	龙芯中科	961	148,637.87	0.11
218	601898	中煤能源	12,000	146,160.00	0.10
219	000975	山金国际	8,500	144,500.00	0.10
220	000661	长春高新	2,100	139,860.00	0.10
221	600741	华域汽车	9,000	139,680.00	0.10
222	601878	浙商证券	14,600	138,700.00	0.10
223	002920	德赛西威	1,700	138,550.00	0.10
224	601881	中国银河	11,000	138,270.00	0.10
225	002304	洋河股份	3,600	137,340.00	0.10
226	600674	川投能源	9,600	136,032.00	0.10
227	601117	中国化学	18,400	135,240.00	0.10
228	601186	中国铁建	22,700	135,065.00	0.10
229	600372	中航机载	12,300	133,455.00	0.09
230	601021	春秋航空	2,800	127,624.00	0.09
231	300866	安克创新	1,200	125,400.00	0.09
232	601111	中国国航	20,300	122,815.00	0.09
233	301236	软通动力	2,800	118,860.00	0.08
234	000895	双汇发展	5,300	118,720.00	0.08
235	000963	华东医药	4,200	118,104.00	0.08
236	601698	中国卫通	3,900	117,975.00	0.08

237	001979	招商蛇口	18,000	115,740.00	0.08
238	600023	浙能电力	21,600	113,616.00	0.08
239	600600	青岛啤酒	2,100	109,683.00	0.08
240	601800	中国交建	19,100	109,061.00	0.08
241	688506	百利天恒	361	106,144.83	0.08
242	300628	亿联网络	3,100	104,842.00	0.07
243	600588	用友网络	11,300	103,734.00	0.07
244	603369	今世缘	4,300	101,953.00	0.07
245	001965	招商公路	11,000	100,760.00	0.07
246	603407	长裕集团	959	98,873.02	0.07
247	000617	中油资本	15,000	98,850.00	0.07
248	688223	晶科能源	20,629	97,987.75	0.07
249	600039	四川路桥	12,500	97,750.00	0.07
250	300832	新产业	2,300	96,600.00	0.07
251	600085	同仁堂	4,100	94,751.00	0.07
252	601618	中国中冶	38,700	94,428.00	0.07
253	601319	中国人保	13,800	93,288.00	0.07
254	600027	华电国际	20,900	93,005.00	0.07
255	601607	上海医药	6,000	92,400.00	0.07
256	601633	长城汽车	6,100	92,049.00	0.07
257	600061	国投资本	13,700	89,735.00	0.06
258	300251	光线传媒	8,000	88,720.00	0.06
259	600025	华能水电	9,800	87,122.00	0.06
260	603459	红板科技	792	86,639.12	0.06
261	000983	山西焦煤	14,800	85,840.00	0.06
262	601059	信达证券	5,300	85,807.00	0.06
263	000999	华润三九	3,800	85,462.00	0.06
264	600845	宝信软件	5,100	84,813.00	0.06
265	300999	金龙鱼	3,600	83,736.00	0.06
266	302132	中航成飞	1,400	81,648.00	0.06
267	600803	新奥股份	5,100	80,580.00	0.06
268	600918	中泰证券	15,000	79,800.00	0.06
269	300896	爱美客	900	78,480.00	0.06
270	300122	智飞生物	6,700	78,323.00	0.06
271	600930	华电新能	16,300	77,751.00	0.05
272	603260	合盛硅业	1,600	77,216.00	0.05
273	000708	中信特钢	6,000	75,720.00	0.05
274	600515	海南机场	27,600	75,624.00	0.05
275	688472	阿特斯	6,985	75,577.70	0.05
276	000596	古井贡酒	900	71,820.00	0.05
277	600018	上港集团	15,000	70,800.00	0.05
278	688009	中国通号	13,977	66,530.52	0.05
279	603392	万泰生物	2,400	64,728.00	0.05
280	601018	宁波港	20,100	63,315.00	0.04

281	601238	广汽集团	12,300	62,484.00	0.04
282	300413	芒果超媒	4,200	61,446.00	0.04
283	688781	视涯科技	1,267	53,416.72	0.04
284	688809	强一股份	84	52,332.00	0.04
285	601456	国联民生	5,800	51,272.00	0.04
286	601136	首创证券	3,400	47,430.00	0.03
287	688808	联讯仪器	28	44,361.24	0.03
288	688303	大全能源	2,506	43,679.58	0.03
289	603435	嘉德利	601	39,709.71	0.03
290	688796	百奥赛图	228	24,943.20	0.02
291	688797	臻宝科技	50	23,433.50	0.02
292	688820	盛合晶微	164	23,204.36	0.02
293	688712	北芯生命	633	22,737.36	0.02
294	001391	国货航	5,500	22,385.00	0.02
295	688813	泰金新能	100	17,209.00	0.01
296	002601	龙佰集团	1,000	16,480.00	0.01
297	301687	新广益	195	15,167.10	0.01
298	688635	长进光子	49	15,101.31	0.01
299	688811	有研复材	413	9,965.69	0.01
300	600377	宁沪高速	700	8,099.00	0.01
301	301449	天溯计量	157	6,075.90	0.00
302	001369	双欣材料	442	5,975.84	0.00
303	601112	振石股份	160	2,814.40	0.00
304	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
305	603284	林平发展	34	1,185.58	0.00
306	603293	埃泰克	22	746.46	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	300308	中际旭创	2,455,598.00	1.41
2	300750	宁德时代	2,259,499.00	1.30
3	300502	新易盛	1,970,890.00	1.13
4	300476	胜宏科技	1,311,981.00	0.75
5	002475	立讯精密	1,281,388.00	0.74
6	600519	贵州茅台	1,249,517.00	0.72
7	002384	东山精密	1,036,427.00	0.60
8	600030	中信证券	887,426.00	0.51
9	300274	阳光电源	873,025.00	0.50

10	688256	寒武纪	865,715.50	0.50
11	600036	招商银行	776,374.00	0.45
12	601899	紫金矿业	692,724.00	0.40
13	600900	长江电力	675,791.00	0.39
14	601318	中国平安	672,826.00	0.39
15	002594	比亚迪	618,827.00	0.36
16	601166	兴业银行	570,890.00	0.33
17	002625	光启技术	558,157.00	0.32
18	600276	恒瑞医药	527,782.00	0.30
19	600522	中天科技	518,451.00	0.30
20	688041	海光信息	505,393.28	0.29

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	300750	宁德时代	3,470,697.96	2.00
2	300308	中际旭创	2,471,876.00	1.42
3	600519	贵州茅台	2,246,639.00	1.29
4	300502	新易盛	1,942,851.00	1.12
5	601899	紫金矿业	1,709,329.00	0.98
6	002475	立讯精密	1,416,436.00	0.81
7	601318	中国平安	1,324,739.00	0.76
8	600036	招商银行	1,188,724.00	0.68
9	688041	海光信息	1,125,565.70	0.65
10	688012	中微公司	1,029,656.78	0.59
11	002371	北方华创	1,016,662.00	0.58
12	603986	兆易创新	992,788.00	0.57
13	002384	东山精密	961,368.00	0.55
14	600900	长江电力	901,484.00	0.52
15	688256	寒武纪	893,876.13	0.51
16	603259	药明康德	889,303.00	0.51
17	600183	生益科技	885,056.00	0.51
18	002594	比亚迪	875,183.00	0.50
19	688008	澜起科技	873,963.50	0.50
20	300059	东方财富	852,824.00	0.49

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	49,374,620.75
卖出股票的收入（成交）总额	77,860,310.88

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	7,649,262.58	5.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,649,262.58	5.41

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019827	26 国债 01	76,000	7,649,262.58	5.41

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

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约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	88,091.55
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	500.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	88,591.55

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
国泰安益灵活配置混合 A	199	252,002.95	49,951,929.89	99.61%	196,657.89	0.39%
国泰安益灵活配置混合 C	81	367,972.68	29,781,682.21	99.92%	24,104.49	0.08%
国泰安益灵活配置混合 E	8	1,863.05	-	0.00%	14,904.39	100.00%
合计	288	277,671.11	79,733,612.10	99.71%	235,666.77	0.29%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	90.91%

8.3 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	国泰安益灵活配置混合 A	9,250.39	0.02%
	国泰安益灵活配置混合 C	9,987.17	0.03%

	国泰安益灵活配置混合 E	74.27	0.50%
	合计	19,311.83	0.02%

8.4 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	国泰安益灵活配置混合 A	0~10
	国泰安益灵活配置混合 C	0
	国泰安益灵活配置混合 E	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰安益灵活配置混合 A	0
	国泰安益灵活配置混合 C	0
	国泰安益灵活配置混合 E	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰安益灵活配置混合 A	国泰安益灵活配置混合 C	国泰安益灵活配置混合 E
基金合同生效日（2016年12月23日）基金份额总额	200,031,347.54	-	-
本报告期期初基金份额总额	64,674,267.10	40,182,262.27	107,351.57
本报告期基金总申购份额	82,288.01	22,880,135.91	5,734.21
减：本报告期基金总赎回份额	14,607,967.33	33,256,611.48	98,181.39
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	50,148,587.78	29,805,786.70	14,904.39

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：

2026 年 5 月 9 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四十三次会议审议通过，吴洪涛先生任公司首席信息官。

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立信会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人未受调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人相关从业人员未受调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人未有受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人相关从业人员未有受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣 金总量的 比例	

广发证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	80,887,246.83	63.73%	36,877.07	63.73%	-
东方财富证券	2	46,043,855.09	36.27%	20,991.39	36.27%	-

注：1、交易单元的选择标准：

（1）实力雄厚、信誉良好；

（2）财务状况良好，经营行为稳健、规范，合规风控能力较强；

（3）具备基金交易所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司管理的基金进行证券交易的需要；

（4）研究实力较强，能及时为本公司管理的基金提供高质量服务，包括但不限于各类研究分析报告、上市公司路演及反路演、各类研究策略会等。

2、选择程序：

券商按照我司要求提供机构情况介绍说明，该说明作为券商尽调材料进行内部审议，符合要求的券商经批准进入券商白名单，白名单内的券商根据其提供的研究服务情况进行考评，符合交易席位租用标准的，经审批后可成为我司签约券商并签订交易业务单元租用协议。

3、本基金本报告期内未有交易单元变更情况发生。

10.7.2 基金租用或者通过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
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	2,209,271.59	20.43%	-	-	-	-
东方财富证券	8,605,294.62	79.57%	-	-	-	-

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关于深圳市分公司办公地址变更的公告	《中国证券报》	2026-04-02

2	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》	2026-05-09
---	----------------------	---------	------------

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	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	29,348,003.31	-	-	29,348,003.31	36.70%
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、关于准予国泰安益灵活配置混合型证券投资基金注册的批复
- 2、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 3、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

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。

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

二〇二六年八月三十一日