

国泰海通红利量化选股混合型证券投资基金

2026 年中期报告

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 08 月 31 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月21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	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	9
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15

§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53

§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 盈利投资者数量占比	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
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	57
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰海通红利量化选股混合型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	135,893,439.80 份	
基金合同存续期	不定期	
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。

2.2 基金产品说明

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。

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		上海国泰海通证券资产管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	王小飞
	联系电话	95521	021-60637103
	电子邮箱	zgxxpl@gtht.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95521	021-60637228
传真		021-38871190	021-60635778
注册地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200011	100033
法定代表人		陶耿	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.gthtzg.com
基金中期报告置备地点	上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机构	上海国泰海通证券资产管理有限公司	上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 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 01 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
本期已实现收益	308,805.79	360,308.96
本期利润	-9,434,335.34	-4,784,715.77
加权平均基金份额本期利润	-0.1141	-0.0982
本期加权平均净值利润率	-9.82%	-8.48%
本期基金份额净值增长率	-7.49%	-7.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	3,805,600.38	1,742,039.12
期末可供分配基金份额利润	0.0433	0.0363
期末基金资产净值	91,766,422.68	49,674,656.62
期末基金份额净值	1.0433	1.0363
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	4.33%	3.63%

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）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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	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	-10.52%	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%

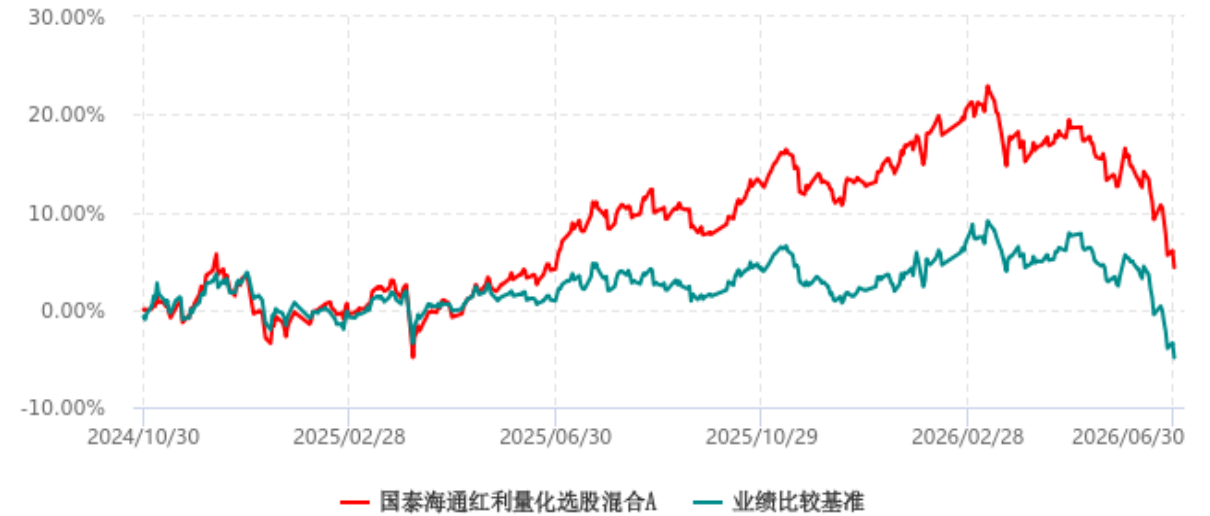
自基金合同生效起至今	4.33%	0.80%	-4.91%	0.68%	9.24%	0.12%
------------	-------	-------	--------	-------	-------	-------

国泰海通红利量化选股混合 C 净值表现

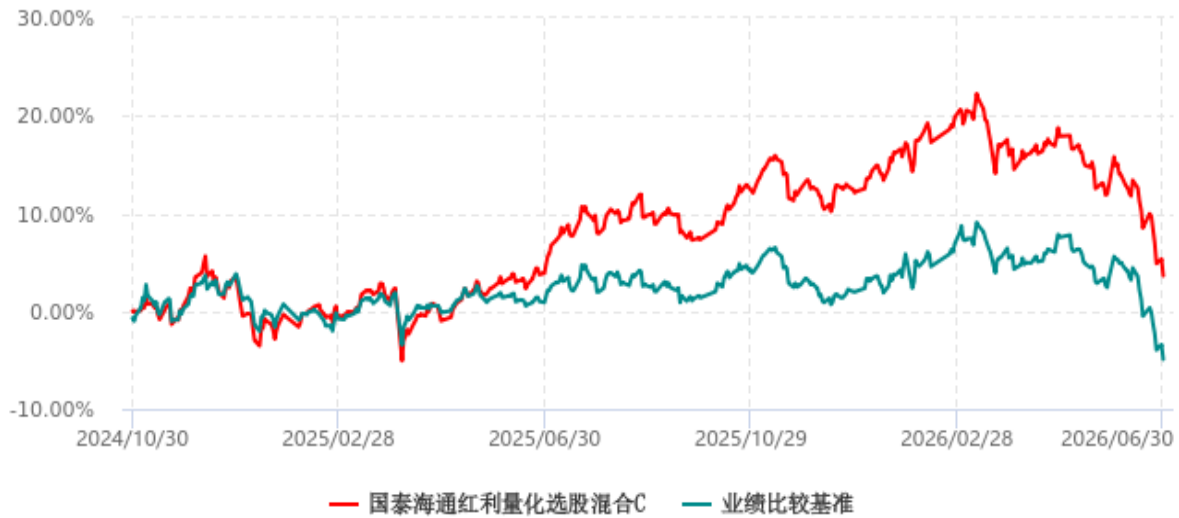
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-10.63%	0.85%	-9.83%	0.74%	-0.80%	0.11%
过去六个月	-7.68%	0.87%	-6.81%	0.79%	-0.87%	0.08%
过去一年	-0.24%	0.75%	-5.76%	0.66%	5.52%	0.09%
自基金合同生效起至今	3.63%	0.80%	-4.91%	0.68%	8.54%	0.12%

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

国泰海通红利量化选股混合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
 (2024年10月30日-2026年06月30日)



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

上海国泰海通证券资产管理有限公司正式成立于 2010 年 10 月 18 日，经中国证监会证监许可【2010】631 号文批准，是业内首批券商系资产管理公司。公司注册资本金 20 亿元，注册地上海。

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理国泰海通现金管家货币市场基金、国泰海通 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰海通君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、国泰海通中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金、国泰海通量化选股混合型发起式证券投资基金、国泰海通君得明混合型证券投资基金、国泰海通东久新经济产业园封闭式基础设施证券投资基金、国泰海通君得利短债债券型证券投资基金、国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)、国泰海通 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰海通安弘六个月定期开放债券型证券投资基金、国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金等 80 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经 理（助理）期限		证 券 从 业 年	说明
		任职日期	离任日期		

				限	
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。	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。

4.2 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，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 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，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 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

2026 年上半年 A 股整体震荡上行，但月度节奏与结构明显分化。一季度初受益于春季躁动、政策偏暖和科技成长主线，风险偏好较高；2 月受海外利率偏紧、美债收益率走高和获利回吐影响，市场震荡整固，节后在宏观数据偏强和政策预期修复下，科技成长、资源品与部分顺周期方向轮动活跃。3 月受中东地缘冲突升级、能源价格攀升和美联储降息预期后移冲击，风险偏好快速下降，贵金属、煤炭、公用事业等防御方向阶段性占优。二季度市场逐步修复，稳定资本市场、支持新质生产力和科技创新的政策取向，叠加业绩验证，带动风险偏好回升。5 月结构性分化加剧，机会向 AI 算力、半导体、通信、电子、先进制造等产业趋势明确的方向集中。6 月转为高位波动，受海外流动性预期和半年末资金压力影响，资金面维持紧平衡。总体而言，上半年科技成长、硬科技和部分先进制造表现突出，传统消费、金融及红利类资产相对承压，市场机会主要由产业趋势、盈利预期和资金偏好共同驱动。上半年，中证红利指数（跌幅 8.75%）表现较弱，弱于沪深 300 指数（涨幅 7.55%）、中证 500 指数（涨幅 20.97%）、创业板综指（涨幅 24.15%）和科创综指（涨幅 53.99%）等主要指数。

从主要风险因子表现看，动量和残差波动因子在上半年走势连续性较强，其中动量因子持续贡献正向收益，仅在 6 月末出现小幅度回调，市场整体动量效应显著。行业层面，科技成长赛道一骑绝尘，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。2026 年上半年 A 股 31 个申万一级行业中共有十个行业录得上涨，其余均为下跌，其中电子行业大涨 86.29%，通信上涨 73.59%，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。

过去一段时间当中，红利类股票在市场风险偏好快速提升的阶段相对承压，在科技成长主线活跃的环境中表现不占优，但从中长期绝对收益和组合防御的角度看，其配置价值和长期逻辑仍然存在：1)、低利率环境下，高股息股票仍具有一定吸引力，尤其适合长期配置；2)、政策推动上市公司提高分红，稳定的股东回报有助于红利资产成为权益资产配置的重要组成部分；3)、红利资产中

不少公司以内需业务为主，对外部经贸和地缘环境的直接敏感度相对较低，在市场波动较大阶段具有一定防御属性。本基金采取量化方式开展红利股票投资，通过高股息、稳定分红、低估值等指标和投资约束，将红利投资逻辑转化为系统化选股框架，并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选择因子，改善红利策略在高波动行情下的适应能力；同时通过投资组合管理控制相对于基准的主要市场风险和行业暴露，争取以较为稳定的方式增强中证红利指数。鉴于市场环境持续变化，我们将继续引入有效因子、改良原有模型，并通过多策略配置提升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 的双击。量化投资策略通过积少成多、以概率取胜的方式增厚投资收益，更需要投资者耐心持有。中证红利指数的股东回报和现金流特征仍具有长期配置意义，我们将努力通过科学的手段增强量化模型的超额收益能力，力争为投资者创造长期优质的投资体验。

4.4.2 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-7.49%，同期业绩比较基准收益率为-6.81%；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-7.68%，同期业绩比较基准收益率为-6.81%。

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 2026 年下半年，A 股市场有望在国内经济结构转型、政策支持和流动性合理充裕的背景下保持韧性，指数层面或以震荡消化和结构轮动为主。科技成长仍有产业趋势和盈利扩张支撑，AI 算力、半导体、先进制造、创新药等方向具备中长期机会，但前期强势板块估值和交易拥挤度较高，后续表现将更多取决于中报及后续业绩兑现，内部或由主题扩散转向景气筛选。随着市场宽度变化，顺周期、制造出海、证券、消费修复及红利低波等方向也可能出现阶段性机会。总体来看，下半年市场仍具备结构性机会，需要在产业景气、盈利质量、估值水平和交易拥挤度之间保持平衡，并关注海外流动性变化和地缘风险对风险偏好的扰动。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关规定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰海通红利量化选股混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	9,429,999.52	38,570,629.07
结算备付金		2,346,176.82	1,100,025.77
存出保证金		283,557.60	332,013.60
交易性金融资产	6.4.7.2	131,141,670.01	100,752,438.97
其中：股票投资		131,141,670.01	100,752,438.97
基金投资		—	—
债券投资		—	—
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		28,080.84	147,576.69
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.5	—	—
资产总计		143,229,484.79	140,902,684.10
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 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		-	-
应付赎回款		1,355,431.98	31,000,282.23
应付管理人报酬		151,741.90	143,043.40
应付托管费		25,290.34	23,840.56
应付销售服务费		16,805.43	24,232.18
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6,112.58	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	233,023.26	149,000.27
负债合计		1,788,405.49	31,340,398.64
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	135,893,439.80	97,314,532.60
未分配利润	6.4.7.8	5,547,639.50	12,247,752.86
净资产合计		141,441,079.30	109,562,285.46
负债和净资产总计		143,229,484.79	140,902,684.10

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 135,893,439.80 份。其中国泰海通红利量化选股混合 A 基金份额净值 1.0433 元，基金份额总额 87,960,822.30 份；国泰海通红利量化选股混合 C 基金份额净值 1.0363 元，基金份额总额 47,932,617.50 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰海通红利量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-12,974,852.62	3,609,775.00
1. 利息收入		19,773.73	28,368.17
其中：存款利息收入	6.4.7.9	17,492.15	25,589.06
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		2,281.58	2,779.11
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,815,920.60	2,199,046.25
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-462,882.00	-827,676.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.11	154,065.71	366.61
股利收益	6.4.7.12	2,124,736.89	3,026,355.96
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-14,888,165.86	1,139,075.11
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	77,618.91	243,285.47
减：二、营业总支出		1,244,198.49	1,599,788.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	905,099.96	1,188,059.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	150,850.05	198,009.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	112,076.63	135,165.08

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		591.72	746.77
8. 其他费用	6.4.7.15	75,580.13	77,807.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,219,051.11	2,009,986.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,219,051.11	2,009,986.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-14,219,051.11	2,009,986.73

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰海通红利量化选股混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 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	97,314,532.60	12,247,752.86	109,562,285.46
二、本期期初净资产	97,314,532.60	12,247,752.86	109,562,285.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	38,578,907.20	-6,700,113.36	31,878,793.84
（一）、综合收益总额	-	-14,219,051.11	-14,219,051.11
（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）	38,578,907.20	7,518,937.75	46,097,844.95
其中：1. 基金申购款	97,606,287.91	16,571,063.61	114,177,351.52
2. 基金赎回款	-59,027,380.71	-9,052,125.86	-68,079,506.57
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净	-	-	-

资产减少以“-”号填列)			
四、本期期末净资产	135,893,439.80	5,547,639.50	141,441,079.30
项 目	上年度可比期间		
	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 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	197,942,472.88	5,207,193.94	203,149,666.82
二、本期期初净资产	197,942,472.88	5,207,193.94	203,149,666.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-68,068,527.28	21,315.94	-68,047,211.34
（一）、综合收益总额	-	2,009,986.73	2,009,986.73
（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）	-68,068,527.28	-1,988,670.79	-70,057,198.07
其中：1. 基金申购款	90,792,833.59	457,883.33	91,250,716.92
2. 基金赎回款	-158,861,360.87	-2,446,554.12	-161,307,914.99
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	129,873,945.60	5,228,509.88	135,102,455.48

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：

叶明	叶明	王红莲
_____	_____	_____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰海通红利量化选股混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“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。国泰君安红利量化选股混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2024 年 7 月 10 日证监许可【2024】1045 号文注册募集，由上海国泰海通证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安红利量化选股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，存续期限不定期，首次设立募集为 313,494,063.41 份基金份额，业经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）毕马威华振验字第 2400508 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰君安红利量化选股混合型证券投资基金基金合同》于 2024 年 10 月 30 日生效。基金合同生效日的基金份额总额为 313,494,063.41 份基金份额，其中认购资金利息折合 122,762.16 份基金份额。本基金的基金管理人为上海国泰海通证券资产管理有限公司，托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）。

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（以下简称“国泰海通资管”）。2025 年 9 月 29 日，国泰君安红利量化选股混合型证券投资基金变更为国泰海通红利量化选股混合型证券投资基金。《国泰海通红利量化选股混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）自基金管理人公告的生效之日起生效，原《国泰君安红利量化选股混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

根据《国泰海通红利量化选股混合型证券投资基金基金合同》，本基金根据是否收取认购费、申购费、销售服务费，将基金份额分为不同的类别。投资人在认购、申购时收取认购费、申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；投资人在认购、申购时不收取认购费、申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《国泰海通红利量化选股混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括内地依法发行上市的股票（含主板、创业板、科创板及其他依法发行、上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、可转换债券、可交换债券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，本基金可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%；投资于本基金界定的红利主题相关股票资产的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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：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%。

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，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、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

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报告所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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号文《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号文《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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（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（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。

b) 对证券投资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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金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。

d) 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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 06 月 30 日
活期存款	5,084,297.31
等于：本金	5,083,842.26
加：应计利息	455.05
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
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	4,345,702.21
等于：本金	4,345,644.16
加：应计利息	58.05
减：坏账准备	—
合计	9,429,999.52

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	146,365,526.79	—	131,141,670.01	-15,223,856.78
贵金属投资—金交所 黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	146,365,526.79	—	131,141,670.01	-15,223,856.78

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	2,344,900.00	—	—	—
—股指期货	2,344,900.00	—	—	—
其他衍生工具	—	—	—	—
合计	2,344,900.00	—	—	—

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/	合约市值	公允价值变动
----	----	--------	------	--------

		卖)		
IF2607	IF2607	1	1,476,600.00	15,560.00
IH2607	IH2607	1	886,380.00	2,520.00
合计				18,080.00
减：可抵销期货暂收款				18,080.00
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	1,694.44
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	—
其中：交易所市场	—
银行间市场	—
应付利息	—
预提信息披露费	179,507.37

预提审计费	43,380.45
其他应付	8,441.00
合计	233,023.26

6.4.7.7 实收基金

国泰海通红利量化选股混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	61,792,391.82	61,792,391.82
本期申购	54,180,272.63	54,180,272.63
本期赎回（以“-”号填列）	-28,011,842.15	-28,011,842.15
本期末	87,960,822.30	87,960,822.30

国泰海通红利量化选股混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	35,522,140.78	35,522,140.78
本期申购	43,426,015.28	43,426,015.28
本期赎回（以“-”号填列）	-31,015,538.56	-31,015,538.56
本期末	47,932,617.50	47,932,617.50

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

国泰海通红利量化选股混合 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	9,476,388.30	-1,580,459.49	7,895,928.81
本期期初	9,476,388.30	-1,580,459.49	7,895,928.81
本期利润	308,805.79	-9,743,141.13	-9,434,335.34
本期基金份额交易产生的变动数	4,955,096.73	388,910.18	5,344,006.91
其中：基金申购款	9,882,671.88	-392,132.00	9,490,539.88
基金赎回款	-4,927,575.15	781,042.18	-4,146,532.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,740,290.82	-10,934,690.44	3,805,600.38

国泰海通红利量化选股混合 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	5,257,702.72	-905,878.67	4,351,824.05
本期期初	5,257,702.72	-905,878.67	4,351,824.05
本期利润	360,308.96	-5,145,024.73	-4,784,715.77
本期基金份额交易产生的变动数	2,047,035.93	127,894.91	2,174,930.84
其中：基金申购款	7,493,734.73	-413,211.00	7,080,523.73
基金赎回款	-5,446,698.80	541,105.91	-4,905,592.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,665,047.61	-5,923,008.49	1,742,039.12

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	9,841.72
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,612.16
结算备付金利息收入	6,038.27
其他	-
合计	17,492.15

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	396,555,061.00
减：卖出股票成本总额	396,706,103.32
减：交易费用	311,839.68
买卖股票差价收入	-462,882.00

6.4.7.11 衍生工具收益

6.4.7.11.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股指期货投资收益	169,300.00
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	4,931.07
减：交易费用	10,303.22

合计	154,065.71
----	------------

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,124,736.89
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	2,124,736.89

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-14,920,236.07
——股票投资	-14,920,236.07
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	32,660.00
——权证投资	-
——期货投资	32,660.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	589.79
合计	-14,888,165.86

6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	76,439.88
转换费收入	1,179.03
合计	77,618.91

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	14,380.45
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行汇划费	1,692.31
合计	75,580.13

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要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

本报告期内与本基金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
上海国泰海通证券资产管理有限公司 (以下简称“国泰海通资管”)	基金管理人
中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)	基金托管人、代销机构
国泰海通证券股份有限公司(以下简称“国泰海通证券”)	基金管理人的股东、代销机构

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

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰海通证券	838,482,159.08	100.00%	1,310,521,282.99	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券	59,761.56	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券	93,420.46	100.00%	0.00	0.00%

注：1. 上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席位租用协议进行约定，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结算风险基金后的净额列示。

2. 该类席位租用协议服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，针对被动股票型基金佣金协议的服务范围不包括研究服务、流动性服务等。

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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	905,099.96	1,188,059.05

其中：应支付销售机构的客户维护费	279,474.61	465,440.42
应支付基金管理人的净管理费	625,625.35	722,618.63

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 1.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	150,850.05	198,009.85

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
建设银行	-	16,510.76	16,510.76
国泰海通资管	-	43,652.12	43,652.12
国泰海通证券	-	20,607.43	20,607.43
合计	-	80,770.31	80,770.31
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
国泰海通资管直销	-	11,594.33	11,594.33
建设银行	-	36,755.42	36,755.42
国泰海通证券	-	50,710.84	50,710.84
合计	-	99,060.59	99,060.59

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

本基金本报告期内及上年度可比期间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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率从事证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国泰海通红利量化选股混合 A

份额单位：份

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	—	8,004,040.00
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份 额	—	—
报告期末持有的基金份额	—	8,004,040.00
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	—	11.51%

注：1. 基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。2. 报告期期末持有的本基金份额占基金分类份额比例，比例的分母采用各自类别的份额计算。

6.4.10.5.2 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

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行，本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰海通证券	4,345,702.21	1,612.16	7,203,790.88	5,283.30
建设银行	5,084,297.31	9,841.72	4,430,282.73	10,029.74

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金的其他存款由基金结算机构国泰海通证券保管，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须做说明的其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 06 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
603459	红板科技	2026 年 03	6 个月	主板打新	17.70	84.32	106	1,876.20	8,937.92	-

		月 31 日		限售						
603407	长裕集团	2026 年 04 月 29 日	6 个月	主板打新限售	13.86	73.46	118	1,635.48	8,668.28	-
603435	嘉德利	2026 年 05 月 15 日	6 个月	主板打新限售	15.76	46.71	81	1,276.56	3,783.51	-
601112	振石股份	2026 年 01 月 21 日	6 个月	主板打新限售	11.18	17.59	106	1,185.08	1,864.54	-
603352	至信股份	2026 年 01 月 08 日	6 个月	主板打新限售	21.88	25.52	50	1,094.00	1,276.00	-
603293	埃泰克	2026 年 04 月 09 日	6 个月	主板打新限售	33.49	33.93	30	1,004.70	1,017.90	-
603284	林平发展	2026 年 02 月 03 日	6 个月	主板打新限售	37.88	34.87	23	871.24	802.01	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值	复牌日期	复牌开盘	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	------	------	------	-------	--------	--------	----

				单 价		单 价				
300332	天壕能源	2026-06-26	筹划发行股份及支付现金购买资产	4.30	2026-07-09	4.64	26,400	132,964.34	113,520.00	-

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

截至本报告期末，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了由董事会（含内部控制委员会）、经营管理层（含风险控制委员会、首席风险官）、风险管理部门，以及业务部门构成的四级风险管理架构体系。

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。本基金的活期存款存

放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，其他银行存款为国泰海通证券股份有限公司保证金，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，本基金未持有信用类债券(2025 年 12 月 31 日：本基金未持有信用类债券)。

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 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)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%。

本基金所持证券均在证券交易所交易，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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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、结算备付金。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 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	9,429,999.52	-	-	-	9,429,999.52
结算备付金	2,346,176.82	-	-	-	2,346,176.82
存出保证金	-	-	-	283,557.60	283,557.60
交易性金融资产	-	-	-	131,141,670.01	131,141,670.01
应收申购款	-	-	-	28,080.84	28,080.84
资产总计	11,776,176.34	-	-	131,453,308.45	143,229,484.79

负债					
应付赎回款	-	-	-	1,355,431.98	1,355,431.98
应付管理人报酬	-	-	-	151,741.90	151,741.90
应付托管费	-	-	-	25,290.34	25,290.34
应付销售服务费	-	-	-	16,805.43	16,805.43
应交税费	-	-	-	6,112.58	6,112.58
其他负债	-	-	-	233,023.26	233,023.26
负债总计	-	-	-	1,788,405.49	1,788,405.49
利率敏感度缺口	11,776,176.34	-	-	129,664,902.96	141,441,079.30
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	38,570,629.07	-	-	-	38,570,629.07
结算备付金	1,100,025.77	-	-	-	1,100,025.77
存出保证金	-	-	-	332,013.60	332,013.60
交易性金融资产	-	-	-	100,752,438.97	100,752,438.97
应收申购款	-	-	-	147,576.69	147,576.69
资产总计	39,670,654.84	-	-	101,232,029.26	140,902,684.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	31,000,282.23	31,000,282.23
应付管理人报酬	-	-	-	143,043.40	143,043.40
应付托管费	-	-	-	23,840.56	23,840.56
应付销售服务费	-	-	-	24,232.18	24,232.18
其他负债	-	-	-	149,000.27	149,000.27
负债总计	-	-	-	31,340,398.64	31,340,398.64
利率敏感度缺口	39,670,654.84	-	-	69,891,630.62	109,562,285.46

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日或行权日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例 0.00%(2025 年 12 月 31 日:0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(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，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 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	131,141,670.01	92.72	100,752,438.97	91.96
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	131,141,670.01	92.72	100,752,438.97	91.96

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

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（附注 6.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
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：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注 6.4.1) 上升 5%	7,555,643.65	6,627,859.20
	业绩比较基准(附注 6.4.1) 下降 5%	-7,555,643.65	-6,627,859.20

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 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	131,001,799.85	100,739,159.54
第二层次	113,520.00	-
第三层次	26,350.16	13,279.43
合计	131,141,670.01	100,752,438.97

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的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

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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	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	其他各项资产	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%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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

7.2.2 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。

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	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
11	601658	邮储银行	446,900	2,203,217.00	1.56
12	601009	南京银行	207,100	2,048,219.00	1.45
13	600971	恒源煤电	289,500	1,997,550.00	1.41
14	600938	中国海油	72,600	1,971,090.00	1.39
15	600019	宝钢股份	362,800	1,970,004.00	1.39
16	601898	中煤能源	156,700	1,908,606.00	1.35
17	601919	中远海控	136,100	1,804,686.00	1.28
18	600395	盘江股份	373,600	1,703,616.00	1.20
19	600188	兖矿能源	93,400	1,659,718.00	1.17
20	601872	招商轮船	91,300	1,604,141.00	1.13
21	600999	招商证券	71,700	1,512,870.00	1.07
22	002966	苏州银行	199,000	1,385,040.00	0.98
23	300483	首华燃气	77,000	1,353,660.00	0.96
24	002641	公元股份	342,700	1,322,822.00	0.94
25	600018	上港集团	277,400	1,309,328.00	0.93
26	601077	渝农商行	211,700	1,293,487.00	0.91
27	000001	平安银行	119,400	1,199,970.00	0.85
28	600801	华新建材	76,600	1,194,960.00	0.84
29	002016	世荣兆业	298,200	1,192,800.00	0.84
30	600787	中储股份	284,800	1,190,464.00	0.84
31	600989	宝丰能源	56,900	1,156,777.00	0.82
32	002468	申通快递	77,200	1,124,032.00	0.79
33	601328	交通银行	173,400	1,114,962.00	0.79
34	601088	中国神华	28,304	1,104,988.16	0.78
35	600037	歌华有线	173,600	1,088,472.00	0.77
36	601665	齐鲁银行	186,600	1,076,682.00	0.76
37	600585	海螺水泥	63,100	1,069,545.00	0.76
38	000672	上峰材料	43,900	1,039,552.00	0.73
39	601000	唐山港	232,700	965,705.00	0.68
40	002399	海普瑞	106,200	953,676.00	0.67
41	600348	华阳股份	121,100	926,415.00	0.65
42	603511	爱慕股份	77,800	894,700.00	0.63
43	600908	无锡银行	171,900	873,252.00	0.62
44	000937	冀中能源	211,460	841,610.80	0.60
45	301206	三元生物	37,400	831,402.00	0.59
46	601333	广深铁路	296,900	816,475.00	0.58
47	601229	上海银行	94,000	815,920.00	0.58
48	600741	华域汽车	51,600	800,832.00	0.57
49	601916	浙商银行	299,900	788,737.00	0.56

50	601995	中金公司	21,600	780,840.00	0.55
51	600020	中原高速	210,900	778,221.00	0.55
52	600026	中远海能	42,900	769,626.00	0.54
53	300438	鹏辉能源	8,800	729,080.00	0.52
54	003016	欣贺股份	117,800	722,114.00	0.51
55	300511	雪榕生物	139,600	702,188.00	0.50
56	000708	中信特钢	54,200	684,004.00	0.48
57	600985	淮北矿业	47,200	663,160.00	0.47
58	603565	中谷物流	66,900	656,289.00	0.46
59	603006	联明股份	45,100	642,675.00	0.45
60	601288	农业银行	104,200	632,494.00	0.45
61	600814	杭州解百	101,800	620,980.00	0.44
62	600619	海立股份	38,500	610,225.00	0.43
63	600269	赣粤高速	152,800	608,144.00	0.43
64	600256	广汇能源	121,000	597,740.00	0.42
65	600724	宁波富达	112,800	571,896.00	0.40
66	600104	上汽集团	57,600	562,176.00	0.40
67	601918	新集能源	65,100	559,209.00	0.40
68	600299	安迪苏	70,300	551,855.00	0.39
69	002756	永兴材料	9,600	543,744.00	0.38
70	600386	北巴传媒	173,000	539,760.00	0.38
71	001965	招商公路	57,400	525,784.00	0.37
72	300607	拓斯达	12,700	523,621.00	0.37
73	601949	中国出版	110,500	513,825.00	0.36
74	301238	瑞泰新材	20,900	509,960.00	0.36
75	600426	华鲁恒升	20,800	497,536.00	0.35
76	600717	天津港	126,692	492,831.88	0.35
77	600628	新世界	86,300	485,869.00	0.34
78	300840	酷特智能	22,400	462,112.00	0.33
79	600598	北大荒	41,400	448,776.00	0.32
80	601858	中国科传	25,100	434,481.00	0.31
81	000895	双汇发展	19,200	430,080.00	0.30
82	000617	中油资本	65,000	428,350.00	0.30
83	600153	建发股份	53,000	420,290.00	0.30
84	000690	宝新能源	88,700	416,890.00	0.29
85	301487	盟固利	21,500	411,725.00	0.29
86	003022	联泓新科	15,300	396,270.00	0.28
87	600738	丽尚国潮	109,500	394,200.00	0.28
88	601816	京沪高铁	85,300	386,409.00	0.27
89	002004	华邦健康	98,200	385,926.00	0.27
90	002128	电投能源	16,300	376,856.00	0.27
91	300031	宝通科技	13,000	371,410.00	0.26
92	301305	朗坤科技	12,800	365,056.00	0.26

93	601985	中国核电	40,400	364,812.00	0.26
94	300750	宁德时代	900	353,709.00	0.25
95	600548	深高速	43,200	351,216.00	0.25
96	601139	深圳燃气	61,800	349,788.00	0.25
97	600061	国投资本	53,200	348,460.00	0.25
98	002521	齐峰新材	48,100	348,244.00	0.25
99	600827	百联股份	46,900	347,529.00	0.25
100	003025	思进智能	24,400	343,552.00	0.24
101	603587	地素时尚	30,800	342,188.00	0.24
102	002948	青岛银行	66,800	339,344.00	0.24
103	601818	光大银行	116,800	337,552.00	0.24
104	002398	垒知集团	89,600	336,000.00	0.24
105	600050	中国联通	81,500	326,000.00	0.23
106	600846	同济科技	32,000	320,000.00	0.23
107	600015	华夏银行	50,000	319,500.00	0.23
108	605138	盛泰集团	57,500	317,400.00	0.22
109	301587	中瑞股份	14,400	316,080.00	0.22
110	300281	金明精机	50,900	306,927.00	0.22
111	600887	伊利股份	12,800	306,688.00	0.22
112	002930	宏川智慧	33,100	304,520.00	0.22
113	000011	深物业 A	46,500	301,320.00	0.21
114	600282	南钢股份	65,300	299,727.00	0.21
115	001212	中旗新材	6,300	298,494.00	0.21
116	600028	中国石化	66,200	295,252.00	0.21
117	000026	飞亚达	13,700	295,098.00	0.21
118	002419	天虹股份	69,700	294,831.00	0.21
119	600810	神马股份	47,500	293,075.00	0.21
120	301265	华新科技	10,400	286,520.00	0.20
121	601800	中国交建	49,800	284,358.00	0.20
122	601298	青岛港	35,000	281,750.00	0.20
123	001391	国货航	68,000	276,760.00	0.20
124	002761	浙江建投	41,000	271,830.00	0.19
125	300741	华宝股份	21,600	270,432.00	0.19
126	603327	福蓉科技	30,800	261,184.00	0.18
127	600704	物产中大	55,000	259,600.00	0.18
128	002772	众兴菌业	22,200	252,192.00	0.18
129	600928	西安银行	75,800	247,866.00	0.18
130	600223	福瑞达	48,300	242,949.00	0.17
131	002952	亚世光电	10,800	237,924.00	0.17
132	603928	兴业股份	16,050	237,540.00	0.17
133	603638	艾迪精密	10,000	234,500.00	0.17
134	603216	梦天家居	11,400	234,498.00	0.17
135	600320	振华重工	56,700	234,171.00	0.17

136	600346	恒力石化	13,000	230,230.00	0.16
137	301260	格力博	17,000	229,670.00	0.16
138	600008	首创环保	82,400	224,128.00	0.16
139	601156	东航物流	13,600	219,232.00	0.15
140	600309	万华化学	3,200	218,912.00	0.15
141	601963	重庆银行	21,700	218,736.00	0.15
142	000703	恒逸石化	15,700	213,049.00	0.15
143	002293	罗莱生活	21,100	208,679.00	0.15
144	002042	华孚时尚	59,000	201,190.00	0.14
145	600740	山西焦化	62,500	199,375.00	0.14
146	688266	泽璟制药	1,700	198,322.00	0.14
147	601107	四川成渝	40,425	197,274.00	0.14
148	600125	铁龙物流	38,900	197,223.00	0.14
149	300867	圣元环保	10,800	195,696.00	0.14
150	601186	中国铁建	32,500	193,375.00	0.14
151	601117	中国化学	26,200	192,570.00	0.14
152	688107	安路科技	4,200	191,520.00	0.14
153	000090	天健集团	62,000	186,620.00	0.13
154	600690	海尔智家	8,900	181,649.00	0.13
155	600865	百大集团	21,800	178,542.00	0.13
156	002821	凯莱英	1,100	178,200.00	0.13
157	600858	银座股份	40,200	177,282.00	0.13
158	002204	大连重工	32,600	172,128.00	0.12
159	002111	威海广泰	18,500	166,500.00	0.12
160	603018	华设集团	32,156	165,281.84	0.12
161	600886	国投电力	12,400	165,044.00	0.12
162	000900	现代投资	45,900	158,814.00	0.11
163	601086	国芳集团	23,700	157,131.00	0.11
164	000990	诚志股份	19,100	156,238.00	0.11
165	002746	仙坛股份	30,500	155,550.00	0.11
166	601668	中国建筑	35,400	153,636.00	0.11
167	301246	宏源药业	5,600	150,640.00	0.11
168	002391	长青股份	30,400	148,048.00	0.10
169	601366	利群股份	45,500	146,965.00	0.10
170	002228	合兴包装	49,200	144,648.00	0.10
171	002034	旺能环境	9,500	143,925.00	0.10
172	601766	中国中车	27,500	143,000.00	0.10
173	603758	秦安股份	15,900	142,146.00	0.10
174	000557	西部创业	40,100	138,746.00	0.10
175	002010	传化智联	31,000	138,570.00	0.10
176	600515	海南机场	48,800	133,712.00	0.09
177	301025	读客文化	16,800	130,368.00	0.09
178	002317	众生药业	5,200	127,764.00	0.09

179	002404	嘉欣丝绸	22,000	125,840.00	0.09
180	688609	九联科技	11,300	124,413.00	0.09
181	603808	歌力思	16,400	124,148.00	0.09
182	603185	弘元绿能	7,400	123,506.00	0.09
183	603659	璞泰来	4,100	118,613.00	0.08
184	600727	鲁北化工	17,600	118,272.00	0.08
185	002406	远东传动	17,500	114,800.00	0.08
186	300691	联合光电	7,200	113,832.00	0.08
187	300332	天壕能源	26,400	113,520.00	0.08
188	002811	郑中设计	10,000	111,900.00	0.08
189	603305	旭升集团	8,900	107,868.00	0.08
190	300788	中信出版	4,800	107,856.00	0.08
191	603132	金徽股份	6,900	107,502.00	0.08
192	605123	派克新材	1,100	106,711.00	0.08
193	002187	广百股份	22,700	106,236.00	0.08
194	300681	英搏尔	3,700	105,894.00	0.07
195	601375	中原证券	26,300	104,937.00	0.07
196	603999	读者传媒	20,300	101,500.00	0.07
197	002344	海宁皮城	28,900	101,150.00	0.07
198	601666	平煤股份	13,800	98,670.00	0.07
199	603507	振江股份	3,000	98,670.00	0.07
200	600398	海澜之家	18,800	98,324.00	0.07
201	000333	美的集团	1,300	98,189.00	0.07
202	603878	武进不锈	19,100	98,174.00	0.07
203	603799	华友钴业	2,000	96,520.00	0.07
204	600016	民生银行	29,900	96,278.00	0.07
205	002064	华峰化学	10,100	95,849.00	0.07
206	601116	三江购物	9,700	95,739.00	0.07
207	600988	赤峰黄金	3,500	92,120.00	0.07
208	300121	阳谷华泰	7,300	91,980.00	0.07
209	600805	悦达投资	22,500	90,675.00	0.06
210	000505	京粮控股	17,300	87,019.00	0.06
211	603486	科沃斯	1,700	86,275.00	0.06
212	603848	好太太	6,300	86,058.00	0.06
213	601600	中国铝业	10,400	85,488.00	0.06
214	600057	厦门象屿	15,600	84,552.00	0.06
215	600177	雅戈尔	11,000	82,830.00	0.06
216	002493	荣盛石化	7,700	82,775.00	0.06
217	601518	吉林高速	29,200	81,760.00	0.06
218	600640	国脉文化	8,400	81,228.00	0.06
219	000935	四川双马	3,100	80,879.00	0.06
220	601218	吉鑫科技	18,800	80,840.00	0.06
221	002593	日上集团	20,000	79,800.00	0.06

222	688680	海优新材	1,900	79,800.00	0.06
223	002001	新和成	2,800	79,576.00	0.06
224	605577	龙版传媒	8,700	76,647.00	0.05
225	601158	重庆水务	19,500	75,270.00	0.05
226	600547	山东黄金	3,200	73,888.00	0.05
227	300055	万邦达	11,200	72,016.00	0.05
228	600429	三元股份	17,800	71,912.00	0.05
229	300575	中旗股份	14,600	71,832.00	0.05
230	600308	华泰股份	23,900	71,461.00	0.05
231	688620	安凯微	4,300	69,660.00	0.05
232	301517	陕西华达	1,400	69,482.00	0.05
233	601068	中铝国际	16,000	69,120.00	0.05
234	600859	王府井	7,400	67,932.00	0.05
235	603868	飞科电器	2,200	67,760.00	0.05
236	000810	创维数字	5,100	67,575.00	0.05
237	601101	昊华能源	6,300	66,528.00	0.05
238	002752	昇兴股份	11,700	64,584.00	0.05
239	603071	物产环能	5,800	64,148.00	0.05
240	000886	海南高速	15,700	64,056.00	0.05
241	002812	恩捷股份	900	60,219.00	0.04
242	002443	金洲管道	6,300	60,039.00	0.04
243	003816	中国广核	15,200	59,432.00	0.04
244	600638	新黄浦	12,900	56,373.00	0.04
245	603393	新天然气	2,600	55,666.00	0.04
246	603195	公牛集团	1,400	54,810.00	0.04
247	002107	沃华医药	9,600	54,624.00	0.04
248	605011	杭州热电	3,400	52,564.00	0.04
249	300512	中亚股份	7,700	52,514.00	0.04
250	600903	贵州燃气	7,900	52,456.00	0.04
251	002577	雷柏科技	2,800	51,408.00	0.04
252	603728	鸣志电器	800	48,736.00	0.03
253	688302	海创药业	1,300	45,721.00	0.03
254	601368	绿城水务	10,300	42,127.00	0.03
255	603130	云中马	1,000	41,750.00	0.03
256	002558	巨人网络	1,500	41,340.00	0.03
257	603108	润达医疗	4,300	38,270.00	0.03
258	600803	新奥股份	2,300	36,340.00	0.03
259	600508	上海能源	4,640	34,196.80	0.02
260	301177	迪阿股份	1,200	33,084.00	0.02
261	600232	金鹰股份	5,200	32,760.00	0.02
262	600785	新华百货	3,240	31,752.00	0.02
263	002250	联化科技	2,300	31,441.00	0.02
264	300817	双飞集团	2,000	31,200.00	0.02

265	002563	森马服饰	6,100	30,744.00	0.02
266	605188	国光连锁	2,600	30,394.00	0.02
267	600011	华能国际	3,900	29,601.00	0.02
268	600872	中炬高新	1,700	29,512.00	0.02
269	601326	秦港股份	9,300	29,388.00	0.02
270	300154	瑞凌股份	3,900	29,328.00	0.02
271	000807	云铝股份	1,300	28,782.00	0.02
272	300315	掌趣科技	7,300	28,470.00	0.02
273	605055	迎丰股份	2,700	27,540.00	0.02
274	301536	星辰科技	200	25,742.00	0.02
275	600746	江苏索普	4,900	25,627.00	0.02
276	002923	润都股份	2,600	24,596.00	0.02
277	600502	安徽建工	5,400	23,490.00	0.02
278	000514	渝开发	6,100	21,838.00	0.02
279	600755	厦门国贸	4,000	21,680.00	0.02
280	601827	三峰环境	2,800	20,356.00	0.01
281	002027	分众传媒	4,200	20,328.00	0.01
282	002564	天沃科技	4,600	19,780.00	0.01
283	603897	长城科技	600	19,476.00	0.01
284	003000	劲仔食品	1,900	18,734.00	0.01
285	300284	苏交科	3,700	18,500.00	0.01
286	001337	四川黄金	500	18,330.00	0.01
287	600295	鄂尔多斯	1,600	17,152.00	0.01
288	300191	潜能恒信	600	16,590.00	0.01
289	688598	金博股份	300	14,835.00	0.01
290	600298	安琪酵母	400	14,480.00	0.01
291	603045	福达合金	200	14,278.00	0.01
292	603686	福龙马	1,000	12,920.00	0.01
293	000987	越秀资本	1,500	11,730.00	0.01
294	002245	蔚蓝锂芯	600	11,226.00	0.01
295	600267	海正药业	1,100	11,121.00	0.01
296	002648	卫星化学	400	9,396.00	0.01
297	603459	红板科技	106	8,937.92	0.01
298	603407	长裕集团	118	8,668.28	0.01
299	002745	木林森	600	7,530.00	0.01
300	601777	千里科技	900	7,344.00	0.01
301	300492	华图山鼎	200	6,870.00	0.00
302	600535	天士力	500	6,615.00	0.00
303	002041	登海种业	700	5,509.00	0.00
304	003027	同兴科技	300	5,229.00	0.00
305	002365	永安药业	500	5,060.00	0.00
306	603066	音飞储存	500	4,880.00	0.00
307	000983	山西焦煤	800	4,640.00	0.00

308	603435	嘉德利	81	3,783.51	0.00
309	000968	蓝焰控股	400	2,396.00	0.00
310	601112	振石股份	106	1,864.54	0.00
311	300509	新美星	200	1,676.00	0.00
312	603352	至信股份	50	1,276.00	0.00
313	603889	新澳股份	200	1,022.00	0.00
314	603293	埃泰克	30	1,017.90	0.00
315	603284	林平发展	23	802.01	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	601225	陕西煤业	5,285,115.60	4.82
2	601699	潞安环能	5,158,399.00	4.71
3	600188	兖矿能源	4,883,921.00	4.46
4	601658	邮储银行	4,735,708.00	4.32
5	600985	淮北矿业	4,636,150.00	4.23
6	601088	中国神华	4,620,943.00	4.22
7	601398	工商银行	4,482,304.00	4.09
8	601919	中远海控	4,461,062.00	4.07
9	601998	中信银行	4,293,251.00	3.92
10	600546	山煤国际	4,275,474.00	3.90
11	601857	中国石油	4,192,585.00	3.83
12	000933	神火股份	3,887,539.00	3.55
13	601997	贵阳银行	3,832,930.00	3.50
14	000651	格力电器	3,779,538.00	3.45
15	300483	首华燃气	3,729,172.09	3.40
16	601988	中国银行	3,717,380.00	3.39
17	601288	农业银行	3,579,031.00	3.27
18	600395	盘江股份	3,539,483.00	3.23
19	600971	恒源煤电	3,521,280.69	3.21
20	600256	广汇能源	3,143,886.00	2.87
21	600938	中国海油	3,066,565.00	2.80
22	600028	中国石化	3,025,093.00	2.76
23	600740	山西焦化	2,965,914.00	2.71
24	600585	海螺水泥	2,888,871.00	2.64
25	601898	中煤能源	2,776,157.00	2.53
26	600015	华夏银行	2,715,291.00	2.48
27	600919	江苏银行	2,558,896.00	2.34

28	000001	平安银行	2,508,121.00	2.29
29	601872	招商轮船	2,485,232.00	2.27
30	601665	齐鲁银行	2,458,687.00	2.24
31	000937	冀中能源	2,436,143.00	2.22
32	600299	安迪苏	2,394,879.00	2.19
33	601963	重庆银行	2,368,649.00	2.16
34	601077	渝农商行	2,285,207.00	2.09
35	002948	青岛银行	2,252,295.00	2.06
36	002128	电投能源	2,219,312.00	2.03
37	600801	华新建材	2,208,960.00	2.02
38	600348	华阳股份	2,200,411.00	2.01
39	601117	中国化学	2,193,690.00	2.00

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

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	600188	兖矿能源	7,645,563.00	6.98
2	601088	中国神华	4,402,633.24	4.02
3	600985	淮北矿业	4,218,205.00	3.85
4	601398	工商银行	3,921,088.00	3.58
5	600015	华夏银行	3,706,607.00	3.38
6	601077	渝农商行	3,675,342.00	3.35
7	000651	格力电器	3,658,477.00	3.34
8	601225	陕西煤业	3,522,749.00	3.22
9	600919	江苏银行	3,099,259.00	2.83
10	601229	上海银行	3,040,624.00	2.78
11	601898	中煤能源	3,024,635.00	2.76
12	601988	中国银行	2,979,485.00	2.72
13	601288	农业银行	2,769,069.00	2.53
14	600016	民生银行	2,755,626.00	2.52
15	601998	中信银行	2,744,589.64	2.51
16	601658	邮储银行	2,723,926.00	2.49
17	600011	华能国际	2,721,286.00	2.48
18	601117	中国化学	2,681,587.00	2.45
19	600028	中国石化	2,597,417.00	2.37
20	601298	青岛港	2,500,957.00	2.28
21	300483	首华燃气	2,486,103.80	2.27
22	601857	中国石油	2,474,527.00	2.26
23	600740	山西焦化	2,435,299.00	2.22

24	601919	中远海控	2,423,144.00	2.21
25	601107	四川成渝	2,243,980.00	2.05
26	601918	新集能源	2,201,721.00	2.01

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

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

买入股票成本（成交）总额	442,015,570.43
卖出股票收入（成交）总额	396,555,061.00

注：买入股票成本（成交）总额和卖出股票收入（成交）总额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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 月因信披违规被证监会分局警示。

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。

7.12.2 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约定备选股票库之外的情况。

7.12.3 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	283,557.60
2	应收清算款	-
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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	311,638.44

7.12.4 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处于转股期的可转换债券。

7.12.5 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
国泰海通红利量化选股混合 A	702	125,300.32	48,456,654.81	55.09%	39,504,167.49	44.91%
国泰海通红利量化选股混合 C	703	68,182.96	31,674,839.24	66.08%	16,257,778.26	33.92%
合计	1,405	96,721.31	80,131,494.05	58.97%	55,761,945.75	41.03%

注：分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	51.98%

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	国泰海通红利量化选股混合 A	1,465,982.69	1.6666%
	国泰海通红利量化选股混合 C	80,628.63	0.1682%
	合计	1,546,611.32	1.1381%

注：分类基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	国泰海通红利量化选股混合 A	>100
	国泰海通红利量化选股混合 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰海通红利量化选股混合 A	>100
	国泰海通红利量化选股混合 C	0
	合计	>100

注：同时为基金管理人高级管理人员（含基金投资和研究部门负责人）和基金经理的，其持有份额总量的数量区间分别计算在内。

§ 9 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
基金合同生效日（2024 年 10 月 30 日）基金	184,866,895.09	128,627,168.32

份额总额		
本报告期期初基金份额总额	61,792,391.82	35,522,140.78
本报告期基金总申购份额	54,180,272.63	43,426,015.28
减：本报告期基金总赎回份额	28,011,842.15	31,015,538.56
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内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

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2026 年 3 月 24 日，本基金管理人发布了《上海国泰海通证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，陈颖同志担任公司首席信息官，叶明同志不再代为履行公司首席信息官职责，生效日期为 2026 年 3 月 23 日。

2026 年 6 月 13 日，本基金管理人发布了《上海国泰海通证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，叶明同志担任公司总裁、财务负责人，陶耿同志不再兼任公司总裁、财务负责人职务，生效日期为 2026 年 6 月 12 日。

2、本报告期内本基金托管人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，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

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，本基金无涉及管理人受稽查或处罚等情况。

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，本基金无涉及管理人相关从业人员受稽查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

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	
国泰海通证券股份有限公司	2	838,482,159.08	100.00%	59,761.56	100.00%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

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	国泰海通红利量化选股混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-01-22
2	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年 4 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2026-01-22
3	上海国泰海通证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证	2026-03-24

		监会指定网站、公司官网、上交所	
4	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	证监会指定网站、公司官网	2026-03-28
5	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2026-03-31
6	国泰海通红利量化选股混合型证券投资基金 2025 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-03-31
7	国泰海通红利量化选股混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-04-22
8	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2026-04-22
9	关于上海国泰海通证券资产管理有限公司吸收合并上海海通证券资产管理有限公司重要事项的公告	证监会指定网站、公司官网	2026-04-30
10	关于上海国泰海通证券资产管理有限公司吸收合并上海海通证券资产管理有限公司重要事项的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2026-05-06
11	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于旗下公募基金产品在直销平台实施认购及申购费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2026-05-22
12	在本报告期内刊登的其他公告	-	-

§ 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

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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>。

12.3 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
二〇二六年八月三十一日