# 国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

# 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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 境外资产托管人 ..... 6
2.5 信息披露方式 ..... 6
2.6 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** ..... 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 ..... 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 ..... 12
**5 托管人报告** ..... 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..... 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 ..... 13
**6 半年度财务会计报告（未经审计）** ..... 13
6.1 资产负债表 ..... 13
6.2 利润表 ..... 14
6.3 净资产变动表 ..... 15
6.4 报表附注 ..... 17
**7 投资组合报告** ..... 36
7.1 期末基金资产组合情况 ..... 36
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布 ..... 36
7.3 期末按行业分类的权益投资组合 ..... 36
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 ..... 37
7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 ..... 37
7.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 ..... 42
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 ..... 42
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 ..... 44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 ..... 44
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 ..... 44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 ..... 44
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 ..... 44
7.11 投资组合报告附注 ..... 44

**8 基金份额持有人信息** ..... 45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 45
8.2 盈利投资者数量占比 ..... 46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 46
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 ..... 46
**9 开放式基金份额变动** ..... 46
**10 重大事件揭示** ..... 46
10.1 基金份额持有人大会决议 ..... 46
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 ..... 46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 46
10.4 基金投资策略的改变 ..... 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 47
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 ..... 47
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 ..... 47
10.8 其他重大事件 ..... 49
**11 影响投资者决策的其他重要信息** ..... 50
**12 备查文件目录** ..... 51
12.1 备查文件目录 ..... 51
12.2 存放地点 ..... 51
12.3 查阅方式 ..... 51

# 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII） |
| 基金简称 | 国泰中证香港内地国有企业 ETF（QDII） |
| 场内简称 | 港股国企 ETF 国泰 |
| 基金主代码 | 159519 |
| 交易代码 | 159519 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 8 月 23 日 |
| 基金管理人 | 国泰基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 65,157,854.00 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2023 年 8 月 31 日 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 1、股票投资策略：本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、融资与转融通证券出借投资策略；6、金融衍生品投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中证香港内地国有企业指数收益率（经估值汇率调整） |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，理论上其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。<br>本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。<br>本基金可投资境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。 |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|
| 名称 | 国泰基金管理有限公司 | 招商银行股份有限公司 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 信息披露负责人 | 姓名 | 倪鋆 | 张姗 |
| | 联系电话 | 021-31081600转 | 400-61-95555 |
| | 电子邮箱 | xinxipilu@gtfund.com | zhangshan_1027@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | （021）31089000，400-888-8688 | 400-61-95555 |
| 传真 | | 021-31081800 | 0755-83195201 |
| 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 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦 |
| 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 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦 |
| 邮政编码 | | 200082 | 518040 |
| 法定代表人 | | 周向勇 | 缪建民 |

**2.4 境外资产托管人**

| 项目 | | 境外资产托管人 |
|---|---|---|
| 名称 | 英文 | The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited |
| | 中文 | 香港上海汇丰银行有限公司 |
| 注册地址 | | 香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦 |
| 办公地址 | | 香港九龙深旺道一号，汇丰中心一座六楼 |
| 邮政编码 | | - |

**2.5 信息披露方式**

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《证券时报》 |
| 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 |

**2.6 其他相关资料**

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

## 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）** |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 10,422,965.94 |

| | |
|---|---|
| 本期利润 | -2,670,639.65 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0377 |
| 本期加权平均净值利润率 | -2.14% |
| 本期基金份额净值增长率 | -2.99% |
| **3.1.2 期末数据和指标** | **报告期末(2026 年 6 月 30 日)** |
| 期末可供分配利润 | 42,508,513.26 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.6524 |
| 期末基金资产净值 | 107,666,367.26 |
| 期末基金份额净值 | 1.6524 |
| **3.1.3 累计期末指标** | **报告期末(2026 年 6 月 30 日)** |
| 基金份额累计净值增长率 | 65.24% |

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

| 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 | -3.73% | 0.82% | -4.79% | 0.83% | 1.06% | -0.01% |
| 过去六个月 | -2.99% | 0.91% | -3.95% | 0.93% | 0.96% | -0.02% |
| 过去一年 | 6.95% | 0.89% | 4.09% | 0.90% | 2.86% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 65.24% | 1.13% | 54.88% | 1.16% | 10.36% | -0.03% |

注：同期业绩比较基准以人民币计价。

### 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

国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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

(2023 年 8 月 23 日至 2026 年 6 月 30 日)




注：(1)本基金合同生效日为 2023 年 8 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。

(2)同期业绩比较基准以人民币计价。

# 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 | | |
| 吴中昊 | 国泰中证 500 指数增强、国泰中证内地运输主题 ETF、国泰沪深 300 指数增强、国泰国证新能源汽车指数（LOF）、国泰国证有色金属行业指数、国泰上证综合 ETF、国泰沪深 300 指数、国泰国证房地产行业指数、国泰沪深 300 增强策略 ETF、国泰中证 1000 增强策略 ETF、国泰中证钢铁 ETF、国泰中证煤炭 ETF、国泰创业板指数（LOF）、国泰中证香港内地国有企业 ETF（QDII）、国泰中证机器人 ETF、国泰北证 50 成份指数发起、国泰富时中国国企开放共赢 ETF、国泰恒生 A 股电网设备 ETF 的基金经理 | 2023-08-23 | - | 11 年 | 硕士研究生。曾任职于 Arrowstreet Capital（美国）。2019 年 12 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2022 年 1 月起任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理，2022 年 11 月起兼任国泰中证内地运输主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2022 年 12 月起兼任国泰沪深 300 指数证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰国证房地产行业指数证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数证券投资基金和国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 2 月起兼任国泰中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 5 月起兼任国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 6 月起兼任国泰创业板指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2023 年 8 月起兼任国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII） |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 的基金经理，2023 年 11 月起兼任国泰中证机器人交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2024 年 11 月起兼任国泰北证 50 成份指数型发起式证券投资基金的基金经理，2024 年 12 月起兼任国泰富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金和国泰恒生 A 股电网设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 |
| 朱丹 | 国泰大宗商品(QDII-LOF)、国泰纳斯达克 100 指数（QDII）、国泰中证港股通高股息投资 ETF、国泰中国企业境外高收益债券（QDII）、国泰中证香港内地国有企业 ETF（QDII）、国泰中证港股通高股息投资 ETF 发起联接、国泰中证港股通汽车产业主题 ETF 的基金经理、国际业务部副总监 | 2024-08-29 | - | 10 年 | 硕士研究生。2016 年 1 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2020 年 11 月至 2023 年 5 月任国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）的基金经理，2022 年 1 月起兼任国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）和国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金的基金经理，2022 年 12 月至 2024 年 2 月任国泰蓝筹精选混合型证券投资基金的基金经理，2024 年 7 月起兼任国泰中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2024 年 8 月起兼任国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金和国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理，2024 年 10 月起兼任国泰中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2025 年 9 月起兼任国泰中证港股通汽车产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月起任国际业务 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 部副总监。 |

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遵规守信情况的说明**

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人所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同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**

26 年上半年，中证香港内地国有企业指数下跌 0.1%，同期，恒生指数下跌 10.98%，恒生科技

指数下跌 19.52%。作为指数基金，本基金旨在为看好港股内地国有企业概念的投资者提供投资工具。报告期内，我们将跟踪误差控制在合理水平，尽力为投资人提供更精准的投资工具。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为-2.99%，同期业绩比较基准收益率为-3.95%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金跟踪中证香港内地国有企业指数，在内地国有企业概念证券中选出市值最大的 40 个证券组成指数样本。自 924 行情后，港股由于其良好的基本面，较低的估值水平，重新进入到了国际投资者的视野之中。长期来看，中证香港内地国有企业指数成分股质地优良，代表了中国的优质资产，具有较好的长期配置价值。

## 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资产：** | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 1,038,238.77 | 1,035,756.90 |
| 结算备付金 | | 2,955,309.58 | - |
| 存出保证金 | | 2,549.40 | 4,298.94 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 106,236,753.86 | 135,038,008.98 |
| 其中：股票投资 | | 106,236,753.86 | 135,038,008.98 |
| 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 | | 1,753,913.25 | 6,598,871.66 |
| 应收股利 | | 799,127.17 | 867,051.81 |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 资产总计 | | 112,785,892.03 | 143,543,988.29 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2026 年 6 月 30 日** | **上年度末<br>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 | | 4,962,268.92 | 6,769,655.24 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 49,555.68 | 59,762.10 |
| 应付托管费 | | 14,866.71 | 17,928.64 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 92,833.46 | 159,981.83 |
| 负债合计 | | 5,119,524.77 | 7,007,327.81 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 65,157,854.00 | 80,157,854.00 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 42,508,513.26 | 56,378,806.48 |
| 净资产合计 | | 107,666,367.26 | 136,536,660.48 |
| 负债和净资产总计 | | 112,785,892.03 | 143,543,988.29 |

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6524 元，基金份额总额 65,157,854.00 份。

### 6.2 利润表

会计主体：国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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<br>2026 年 1 月 1 日至<br>2026 年 6 月 30 日** | **上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至<br>2025 年 6 月 30 日** |
|---|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | -2,186,951.38 | 30,273,317.83 |
| 1.利息收入 | | 4,891.75 | 11,315.45 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 4,891.75 | 11,315.45 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 10,567,826.37 | 19,938,184.08 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | 8,868,685.97 | 14,741,358.21 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金投资收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.14 | 1,699,140.40 | 5,196,825.87 |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.15 | -13,093,605.59 | 9,810,457.70 |
| 4.汇兑收益（损失以“一”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 333,936.09 | 513,360.60 |
| **减：二、营业总支出** | | 483,688.27 | 731,020.27 |
| 1．管理人报酬 | | 309,267.00 | 494,634.03 |
| 2．托管费 | | 92,780.09 | 148,390.22 |
| 3．销售服务费 | | - | - |
| 4．投资顾问费 | | - | - |
| 5．利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | | - | - |
| 7．税金及附加 | | - | - |
| 8．其他费用 | 6.4.7.17 | 81,641.18 | 87,996.02 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | **-2,670,639.65** | **29,542,297.56** |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | **-2,670,639.65** | **29,542,297.56** |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - | - |
| **六、综合收益总额** | | -2,670,639.65 | 29,542,297.56 |

**6.3 净资产变动表**

会计主体：国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

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<br>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 | 80,157,854.00 | 56,378,806.48 | 136,536,660.48 |
| 二、本期期初净资产 | 80,157,854.00 | 56,378,806.48 | 136,536,660.48 |
| 三、本期增减变 | -15,000,000.00 | -13,870,293.22 | -28,870,293.22 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 动额（减少以“-”号填列） | | | |
| （一）、综合收益总额 | - | -2,670,639.65 | -2,670,639.65 |
| （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） | -15,000,000.00 | -11,199,653.57 | -26,199,653.57 |
| 其中：1.基金申购款 | 20,000,000.00 | 14,702,711.27 | 34,702,711.27 |
| 2.基金赎回款 | -35,000,000.00 | -25,902,364.84 | -60,902,364.84 |
| （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 | 65,157,854.00 | 42,508,513.26 | 107,666,367.26 |
| **项目** | **上年度可比期间<br>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 | 146,157,854.00 | 50,271,728.66 | 196,429,582.66 |
| 二、本期期初净资产 | 146,157,854.00 | 50,271,728.66 | 196,429,582.66 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -26,000,000.00 | 15,212,798.17 | -10,787,201.83 |
| （一）、综合收益总额 | - | 29,542,297.56 | 29,542,297.56 |
| （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） | -26,000,000.00 | -14,329,499.39 | -40,329,499.39 |
| 其中：1.基金申购款 | 65,000,000.00 | 24,573,775.10 | 89,573,775.10 |
| 2.基金赎回款 | -91,000,000.00 | -38,903,274.49 | -129,903,274.49 |
| （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 | 120,157,854.00 | 65,484,526.83 | 185,642,380.83 |

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

国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(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[2023]1424 号《关于准予国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金(QDII)注册的批复》准予注册，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《国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》公开募集。本基金为交易型开放式，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 201,147,000.00 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(2023)第 0425 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2023 年 8 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 201,157,854.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 10,854.00 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，基金托管人为招商银行股份有限公司，境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上[2023]794 号文审批同意，本基金 201,157,854.00 份基金份额于 2023 年 8 月 31 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为标的指数成份股(含存托凭证)、备选成份股(含存托凭证)和其他香港联合交易所上市的股票(含港股通标的股票)。此外，为更好地实现投资目标，本基金可参与其他境外市场投资工具和境内市场投资工具投资。境外市场投资工具包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(包括交易型开放式基金(ETF))；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证

券以及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；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的相关规定。本基金可以进行境外证券借贷交易及境外正回购交易、逆回购交易。在投资香港市场时，本基金可通过合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。境内市场投资工具包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、股指期货、货币市场工具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)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为：中证香港内地国有企业指数收益率(经估值汇率调整)。本基金的标的指数为中证香港内地国有企业指数。

本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）(以下简称“国泰中证香港内地国有企业 ETF 发起联接（QDII）”)。国泰中证香港内地国有企业 ETF 发起联接（QDII）为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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]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[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]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》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) 目前税收政策法规未对合格境内机构投资者（“QDII”）产品的税收处理给予特别的说明。在法规未有明确说明的情况下，参考现有的针对证券投资基金的税收法规进行处理。

(b) 目前本基金取得的源自境外的差价收入和股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(c) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入, 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(d) 对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

(e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本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。

(f) 对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现

行税法规定缴纳印花税。

### 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 1,038,238.77 |
| 等于：本金 | 1,038,155.05 |
| 加：应计利息 | 83.72 |
| 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 | 1,038,238.77 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 98,252,861.06 | - | 106,236,753.86 | 7,983,892.80 |
| 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 | 98,252,861.06 | - | 106,236,753.86 | 7,983,892.80 |

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末无衍生金融资产/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<br>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 | 19,441.58 |
| 其中：交易所市场 | 19,441.58 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 73,391.88 |
| 合计 | 92,833.46 |

**6.4.7.7 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 80,157,854.00 | 80,157,854.00 |
| 本期申购 | 20,000,000.00 | 20,000,000.00 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -35,000,000.00 | -35,000,000.00 |

| | | |
|---|---|---|
| 本期末 | 65,157,854.00 | 65,157,854.00 |

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

**6.4.7.8 未分配利润**

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 41,788,617.73 | 14,590,188.75 | 56,378,806.48 |
| 本期期初 | 41,788,617.73 | 14,590,188.75 | 56,378,806.48 |
| 本期利润 | 10,422,965.94 | -13,093,605.59 | -2,670,639.65 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -8,774,804.10 | -2,424,849.47 | -11,199,653.57 |
| 其中：基金申购款 | 12,055,999.59 | 2,646,711.68 | 14,702,711.27 |
| 基金赎回款 | -20,830,803.69 | -5,071,561.15 | -25,902,364.84 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 43,436,779.57 | -928,266.31 | 42,508,513.26 |

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 3,681.96 |
| 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 | 1,202.75 |
| 其他 | 7.04 |
| 合计 | 4,891.75 |

**6.4.7.10 股票投资收益**

**6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 60,862,195.77 |
| 减：卖出股票成本总额 | 51,863,643.23 |
| 减：交易费用 | 129,866.57 |
| 买卖股票差价收入 | 8,868,685.97 |

**6.4.7.10.2 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|

| | |
|---|---|
| 赎回基金份额对价总额 | 60,902,364.84 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 60,902,364.84 |
| 减：赎回股票成本总额 | - |
| 减：交易费用 | - |
| 赎回差价收入 | - |

**6.4.7.11 基金投资收益**

本基金本报告期内无基金投资收益。

**6.4.7.12 债券投资收益**

本基金本报告期内无债券投资收益。

**6.4.7.13 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.14 股利收益**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,699,140.40 |
| 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 | 1,699,140.40 |

**6.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | -13,093,605.59 |
| ——股票投资 | -13,093,605.59 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——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 | -13,093,605.59 |

**6.4.7.16 其他收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | - |
| ETF 替代损益 | 333,936.09 |
| 合计 | 333,936.09 |

注：ETF 替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

**6.4.7.17 其他费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---|---|
| 审计费用 | 13,884.51 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费 | 3,354.49 |
| 深港通证券组合费 | 4,894.81 |
| 合计 | 81,641.18 |

**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 |
| 国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）（“国泰中证香港内地国有企业 ETF 发起联接（QDII） ”） | 本基金的基金管理人管理的其他基金 |

| | |
|---|---|
| 香港上海汇丰银行有限公司（The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited，“汇丰银行”） | 境外资产托管人 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 基金托管人 |

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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 | 上年度可比期间<br>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 | 309,267.00 | 494,634.03 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 13,837.21 | 15,239.75 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 295,429.79 | 479,394.28 |

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

**6.4.10.2.2基金托管费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 | 上年度可比期间<br>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 | 92,780.09 | 148,390.22 |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.15% / 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**

本基金本报告期内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**

本基金本报告期及上年度可比期间内均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

**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**

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 国泰中证香港内地国有企业 ETF 发起联接（QDII） | 27,469,835.00 | 42.16% | 32,581,495.00 | 40.65% |

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规定支付。

**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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>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 |
| 招商银行 | 1,038,238.77 | 3,681.96 | 2,088,274.07 | 7,294.35 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按适用利率计息。

**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**

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有基金托管人招商银行的 H 股普通股 113,487.00 股，成本总额为人民币 4,426,943.71 元，估值总额为人民币 4,427,725.49 元，占基金资产净值的比例为 4.11%。

**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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

#### 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

本基金属于股票型基金，理论上其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金可投资境外证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金的投资目标为紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

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招商银行及境外资产托管人汇丰银行，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通过有资格的经纪商进行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，有效保障基金份额持有人利益。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》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时间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。

本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的 3%。本基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的 10%，持有境外基金的市值合计不得超过基金净值的 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只境外基金不得超过该境外基金总份额的 20%。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%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。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资产净值的 10%。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、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<br>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 | 1,038,238.77 | - | - | - | 1,038,238.77 |
| 结算备付金 | 2,955,309.58 | - | - | - | 2,955,309.58 |
| 存出保证金 | 2,549.40 | - | - | - | 2,549.40 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 106,236,753.86 | 106,236,753.86 |
| 应收清算款 | - | - | - | 1,753,913.25 | 1,753,913.25 |
| 应收股利 | - | - | - | 799,127.17 | 799,127.17 |
| 资产总计 | 3,996,097.75 | - | - | 108,789,794.28 | 112,785,892.03 |
| 负债 | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | 4,962,268.92 | 4,962,268.92 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 49,555.68 | 49,555.68 |
| 应付托管费 | - | - | - | 14,866.71 | 14,866.71 |
| 其他负债 | - | - | - | 92,833.46 | 92,833.46 |
| 负债总计 | - | - | - | 5,119,524.77 | 5,119,524.77 |
| 利率敏感度缺口 | 3,996,097.75 | - | - | 103,670,269.51 | 107,666,367.26 |
| 上年度末<br>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 | 1,035,756.90 | - | - | - | 1,035,756.90 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 存出保证金 | 4,298.94 | - | - | - | 4,298.94 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 135,038,008.98 | 135,038,008.98 |
| 应收清算款 | - | - | - | 6,598,871.66 | 6,598,871.66 |
| 应收股利 | - | - | - | 867,051.81 | 867,051.81 |
| 资产总计 | 1,040,055.84 | - | - | 142,503,932.45 | 143,543,988.29 |
| 负债 | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | 6,769,655.24 | 6,769,655.24 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 59,762.10 | 59,762.10 |
| 应付托管费 | - | - | - | 17,928.64 | 17,928.64 |
| 其他负债 | - | - | - | 159,981.83 | 159,981.83 |
| 负债总计 | - | - | - | 7,007,327.81 | 7,007,327.81 |
| 利率敏感度缺口 | 1,040,055.84 | - | - | 135,496,604.64 | 136,536,660.48 |

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

**6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

于 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 0.00%（2025 年 12 月 31 日：0.00%），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。本基金持有以非记账本位币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

**6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口**

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 美元<br>折合人民币 | 港币<br>折合人民币 | 合计 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **以外币计价的资产** | | | |
| 交易性金融资产 | - | 106,236,753.86 | 106,236,753.86 |
| 应收股利 | - | 799,127.17 | 799,127.17 |
| **资产合计** | **-** | **107,035,881.03** | **107,035,881.03** |
| **以外币计价的负债** | | | |
| **负债合计** | **-** | **-** | **-** |
| **资产负债表外汇风险敞口净额** | **-** | **107,035,881.03** | **107,035,881.03** |

| **项目** | **上年度末 2025年12月31日** | | |
|---|---|---|---|
| | **美元 折合人民币** | **港币 折合人民币** | **合计** |
| **以外币计价的资产** | | | |
| 交易性金融资产 | - | 135,038,008.98 | 135,038,008.98 |
| 应收股利 | - | 867,051.81 | 867,051.81 |
| **资产合计** | **-** | **135,905,060.79** | **135,905,060.79** |
| **以外币计价的负债** | | | |
| **负债合计** | **-** | **-** | **-** |
| **资产负债表外汇风险敞口净额** | **-** | **135,905,060.79** | **135,905,060.79** |

**6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析**

| 假设 | 除汇率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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
| | 港币相对人民币升值 5% | 增加约 5,351,794.05 | 增加约 6,795,253.04 |
| | 港币相对人民币贬值 5% | 减少约 5,351,794.05 | 减少约 6,795,253.04 |

**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<br>2026 年 6 月 30 日 | | 上年度末<br>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 | 106,236,753.86 | 98.67 | 135,038,008.98 | 98.90 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产－权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 106,236,753.86 | 98.67 | 135,038,008.98 | 98.90 |

**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：人民币元） | |
| | | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 业绩比较基准上升 5% | 增加约 5,304,053.94 | 增加约 6,694,941.10 |
| | 业绩比较基准下降 5% | 减少约 5,304,053.94 | 减少约 6,694,941.10 |

**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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 第一层次 | 106,236,753.86 | 135,038,008.98 |
| 第二层次 | - | - |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 106,236,753.86 | 135,038,008.98 |

**6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

**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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

(1) 基金申购款

于本会计期间，本基金申购基金份额的对价总额为 34,702,711.27 元，其中包括以股票支付的申购款 0.00 元和以现金支付的申购款 34,702,711.27 元(于 2025 年上半年度，本基金申购基金份额的对价总额为 89,573,775.10 元，其中包括以股票支付的申购款 0.00 元和以现金支付的申购款 89,573,775.10 元)。

(2) 除基金申购款外，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 | 106,236,753.86 | 94.19 |
| | 其中：普通股 | 106,236,753.86 | 94.19 |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中：远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 3,993,548.35 | 3.54 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,555,589.82 | 2.27 |
| 9 | 合计 | 112,785,892.03 | 100.00 |

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家（地区） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| 中国香港 | 106,236,753.86 | 98.67 |
| 合计 | 106,236,753.86 | 98.67 |

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

### 7.3.1 期末指数投资按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| 金融 | 47,951,768.48 | 44.54 |
| 能源 | 17,380,249.98 | 16.14 |
| 通讯业务 | 13,142,166.42 | 12.21 |
| 信息技术 | 13,002,776.82 | 12.08 |
| 原材料 | 4,190,556.94 | 3.89 |
| 房地产 | 3,997,440.68 | 3.71 |
| 公用事业 | 2,805,260.39 | 2.61 |
| 工业 | 1,850,567.57 | 1.72 |
| 日常消费品 | 1,829,290.50 | 1.70 |
| 非日常生活消费品 | 86,676.08 | 0.08 |
| 医疗保健 | - | - |
| 合计 | 106,236,753.86 | 98.67 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS)。

### 7.3.2 期末积极投资按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票及存托凭证。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

### 7.4.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称(英文) | 公司名称(中文) | 证券代码 | 所在证券市场 | 所属国家(地区) | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | Industrial and Commercial Bank of China Limited | 中国工商银行股份有限公司 | 01398 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 1,892,786.00 | 10,570,786.77 | 9.82 |
| 2 | China Construction Bank Corporation | 中国建设银行股份有限公司 | 00939 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 1,497,086.00 | 10,493,372.95 | 9.75 |
| 3 | China Mobile Limited | 中国移动有限公司 | 00941 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 153,769.00 | 10,170,294.35 | 9.45 |
| 4 | Semiconductor | 中芯国际集成电路 | 00981 | 深港通联合市 | 中国香港 | 119,314.00 | 9,264,537.62 | 8.60 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Manufacturing International Corporation | 制造有限公司 | | 场 | | | | |
| 5 | CNOOC Limited | 中国海洋石油有限公司 | 00883 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 441,525.00 | 7,792,446.47 | 7.24 |
| 6 | Bank of China Limited | 中国银行股份有限公司 | 03988 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 1,656,683.00 | 7,180,170.98 | 6.67 |
| 7 | China Merchants Bank Co.,Ltd. | 招商银行股份有限公司 | 03968 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 113,487.00 | 4,427,725.49 | 4.11 |
| 8 | China Life Insurance Company Limited | 中国人寿保险股份有限公司 | 02628 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 184,872.00 | 4,280,811.55 | 3.98 |
| 9 | PetroChina Company Limited | 中国石油天然气股份有限公司 | 00857 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 522,192.00 | 3,846,102.83 | 3.57 |
| 10 | Hua Hong Grace Semiconductor Limited | 华虹宏力半导体有限公司 | 01347 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 20,000.00 | 3,738,239.20 | 3.47 |
| 11 | Zijin Mining Group Company Limited | 紫金矿业集团股份有限公司 | 02899 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 150,066.00 | 3,571,311.19 | 3.32 |
| 12 | AGRICULTURAL BANK OF CHINA LIMITED | 中国农业银行股份有限公司 | 01288 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 762,082.00 | 3,534,579.75 | 3.28 |
| 13 | China Shenhua Energy Company | 中国神华能源股份有限公司 | 01088 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 83,585.00 | 2,912,621.80 | 2.71 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Limited | | | | | | | |
| 14 | China Resources Land Limited | 华润置地有限公司 | 01109 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 88,514.00 | 2,306,365.04 | 2.14 |
| 15 | Picc Property And Casualty Company Limited | 中国人民财产保险股份有限公司 | 02328 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 173,081.00 | 2,152,718.48 | 2.00 |
| 16 | China Petroleum & Chemical Corporation | 中国石油化工股份有限公司 | 00386 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 589,855.00 | 2,049,274.24 | 1.90 |
| 17 | China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd. | 中国太平洋保险(集团)股份有限公司 | 02601 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 68,939.00 | 1,609,492.91 | 1.49 |
| 18 | China Citic Bank Corporation Limited | 中信银行股份有限公司 | 00998 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 221,470.00 | 1,279,179.16 | 1.19 |
| 19 | China Telecom Corporation Limited | 中国电信股份有限公司 | 00728 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 343,546.00 | 1,274,111.97 | 1.18 |
| 20 | China Overseas Land And Investment Ltd. | 中国海外发展有限公司 | 00688 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 108,872.00 | 1,140,402.95 | 1.06 |
| 21 | China Mengniu Dairy Company Limited | 中国蒙牛乳业有限公司 | 02319 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 77,244.00 | 1,079,482.54 | 1.00 |
| 22 | Citic Securities | 中信证券股份有限 | 06030 | 深港通联合市 | 中国香港 | 45,587.00 | 1,079,348.49 | 1.00 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Company Limited | 公司 | | 场 | | | | |
| 23 | China Tower Corporation Limited | 中国铁塔股份有限公司 | 00788 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 115,536.00 | 884,072.86 | 0.82 |
| 24 | COSCO Shipping Holdings Co.,Ltd. | 中远海运控股股份有限公司 | 01919 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 73,500.00 | 830,537.91 | 0.77 |
| 25 | China Unicom (Hong Kong) Limited | 中国联合网络通信(香港)股份有限公司 | 00762 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 153,328.00 | 813,687.24 | 0.76 |
| 26 | Postal Savings Bank Of China Corporation Limited | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 01658 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 197,502.00 | 783,939.45 | 0.73 |
| 27 | China Resources Power Holdings Company Limited | 华润电力控股有限公司 | 00836 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 53,224.00 | 782,172.77 | 0.73 |
| 28 | Yankuang Energy Group Company Limited | 兖矿能源集团股份有限公司 | 01171 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 81,251.00 | 779,804.64 | 0.72 |
| 29 | China Resources Beer (Holdings) Company Limited | 华润啤酒(控股)有限公司 | 00291 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 40,568.00 | 749,807.96 | 0.70 |
| 30 | Sinotruk (Hong Kong) Ltd. | 中国重汽(香港)有限公司 | 03808 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 20,376.00 | 682,064.53 | 0.63 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 31 | Zhaojin Mining Industry Company Limited | 招金矿业股份有限公司 | 01818 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 43,500.00 | 619,245.75 | 0.58 |
| 32 | Kunlun Energy Company Limited | 昆仑能源有限公司 | 00135 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 108,642.00 | 606,741.29 | 0.56 |
| 33 | China Taiping Insurance Holdings Company Limited | 中国太平保险控股有限公司 | 00966 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 35,757.00 | 559,642.50 | 0.52 |
| 34 | China Resources Mixc Lifestyle Services Limited | 华润万象生活有限公司 | 01209 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 17,285.00 | 550,672.69 | 0.51 |
| 35 | Guangdong Investment Limited | 粤海投资有限公司 | 00270 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 79,952.00 | 538,872.32 | 0.50 |
| 36 | China Gas Holdings Limited | 中国燃气控股有限公司 | 00384 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 81,088.00 | 364,822.13 | 0.34 |
| 37 | China State Construction International Holdings Limited | 中国建筑国际集团有限公司 | 03311 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 55,827.00 | 337,965.13 | 0.31 |
| 38 | China Resources Gas Group Limited | 华润燃气控股有限公司 | 01193 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 22,895.00 | 291,520.73 | 0.27 |
| 39 | China Power International | 中国电力国际发展有限公司 | 02380 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 92,919.00 | 221,131.15 | 0.21 |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Development Limited | | | | | | | |
| 40 | Chery Automobile Co.,Ltd. | 奇瑞汽车股份有限公司 | 09973 | 深港通联合市场 | 中国香港 | 4,100.00 | 86,676.08 | 0.08 |

**7.4.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细**

本基金本报告期末未持有积极权益投资。

**7.5 报告期内权益投资组合的重大变动**

**7.5.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细**

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | Industrial and Commercial Bank of China Limited | 01398 | 3,705,980.21 | 2.71 |
| 2 | China Mobile Limited | 00941 | 3,682,854.65 | 2.70 |
| 3 | China Construction Bank Corporation | 00939 | 3,625,302.62 | 2.66 |
| 4 | CNOOC Limited | 00883 | 3,539,617.64 | 2.59 |
| 5 | Bank of China Limited | 03988 | 2,588,780.02 | 1.90 |
| 6 | Semiconductor Manufacturing International Corporation | 00981 | 2,090,820.59 | 1.53 |
| 7 | China Life Insurance Company Limited | 02628 | 1,564,037.96 | 1.15 |
| 8 | China Merchants Bank Co.,Ltd. | 03968 | 1,534,959.73 | 1.12 |
| 9 | PetroChina Company Limited | 00857 | 1,524,214.39 | 1.12 |
| 10 | Zijin Mining Group Company Limited | 02899 | 1,336,671.85 | 0.98 |
| 11 | AGRICULTURAL BANK OF CHINA LIMITED | 01288 | 1,222,112.06 | 0.90 |
| 12 | China Shenhua Energy Company Limited | 01088 | 1,061,626.60 | 0.78 |
| 13 | China Petroleum & Chemical Corporation | 00386 | 808,189.84 | 0.59 |
| 14 | China Resources Land | 01109 | 746,584.34 | 0.55 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | Limited | | | |
| 15 | China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd. | 02601 | 687,379.08 | 0.50 |
| 16 | Picc Property And Casualty Company Limited | 02328 | 618,342.24 | 0.45 |
| 17 | China Citic Bank Corporation Limited | 00998 | 484,154.42 | 0.35 |
| 18 | China Telecom Corporation Limited | 00728 | 472,308.01 | 0.35 |
| 19 | China Overseas Land And Investment Ltd. | 00688 | 420,067.01 | 0.31 |
| 20 | China Tower Corporation Limited | 00788 | 351,023.95 | 0.26 |

注：1.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

2.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。

**7.5.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细**

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文） | 证券代码 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | Industrial and Commercial Bank of China Limited | 01398 | 7,066,538.53 | 5.18 |
| 2 | China Construction Bank Corporation | 00939 | 7,051,983.50 | 5.16 |
| 3 | Bank of China Limited | 03988 | 5,957,917.03 | 4.36 |
| 4 | China Mobile Limited | 00941 | 5,236,591.92 | 3.84 |
| 5 | CNOOC Limited | 00883 | 4,633,187.42 | 3.39 |
| 6 | Semiconductor Manufacturing International Corporation | 00981 | 3,657,465.92 | 2.68 |
| 7 | China Life Insurance Company Limited | 02628 | 2,414,681.39 | 1.77 |
| 8 | China Merchants Bank Co.,Ltd. | 03968 | 2,336,881.16 | 1.71 |
| 9 | Zijin Mining Group Company Limited | 02899 | 2,176,975.14 | 1.59 |
| 10 | PetroChina Company Limited | 00857 | 2,077,996.65 | 1.52 |
| 11 | AGRICULTURAL BANK OF CHINA LIMITED | 01288 | 1,850,640.11 | 1.36 |
| 12 | China Shenhua Energy Company Limited | 01088 | 1,519,317.45 | 1.11 |
| 13 | China Petroleum & Chemical Corporation | 00386 | 1,209,475.66 | 0.89 |
| 14 | China Resources Land Limited | 01109 | 1,111,541.84 | 0.81 |
| 15 | China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd. | 02601 | 1,063,434.15 | 0.78 |
| 16 | Picc Property And Casualty Company Limited | 02328 | 1,017,151.34 | 0.74 |
| 17 | China Citic Bank Corporation Limited | 00998 | 994,955.49 | 0.73 |
| 18 | Tsingtao Brewery Company Limited | 00168 | 829,077.62 | 0.61 |
| 19 | China Telecom Corporation Limited | 00728 | 741,470.52 | 0.54 |
| 20 | Postal Savings Bank Of China Corporation Limited | 01658 | 719,366.83 | 0.53 |

注：1.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

2.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。

**7.5.3权益投资的买入成本总额及卖出收入总额**

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入成本（成交）总额 | 36,155,993.70 |
| 卖出收入（成交）总额 | 60,862,195.77 |

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。

**7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

**7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

**7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

本基金本报告期末未持有基金。

**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，中国工商银行股份有限公司、中国人寿保险股份有限公司、中国银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国建设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 | 2,549.40 |
| 2 | 应收清算款 | 1,753,913.25 |
| 3 | 应收股利 | 799,127.17 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,555,589.82 |

**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**

**7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 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

| 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 | | 港股国企联接 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 1,259 | 51,753.66 | 23,955,978.00 | 36.77% | 13,732,041.00 | 21.08% | 27,469,835.00 | 42.16% |

### 8.2 盈利投资者数量占比

本基金不适用。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 0.00 | 0.00% |

### 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 | 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 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
| --- | --- |
| 基金合同生效日（2023 年 8 月 23 日）基金份额总额 | 201,157,854.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 80,157,854.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 20,000,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 35,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 65,157,854.00 |

## 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、基金财产相关的诉讼事项。

本报告期内，无涉及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**

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（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，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

**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，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

**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 | |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联民生 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 甬兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 粤开证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰海通 | 1 | 96,391,680.85 | 99.35% | 19,278.70 | 99.16% | - |
| 中信证券 | 2 | 626,508.62 | 0.65% | 162.88 | 0.84% | - |

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、本基金本报告期内中信证券增加 1 个席位。

**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 | | 基金交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国联民生 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 甬兴证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 粤开证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国泰海通 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

**10.8 其他重大事件**

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日 |
|---|---|---|---|

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | | 期 |
| 1 | 国泰基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 变更场内简称的公告 | 《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》 | 2026-02-02 |
| 2 | 关于旗下部分基金 2026 年 4 月 3 日至 4 月 7 日期间因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告 | 《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》 | 2026-03-31 |
| 3 | 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 |
| 4 | 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 |
| 5 | 关于旗下部分基金 2026 年 5 月 25 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告 | 《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》 | 2026-05-20 |
| 6 | 关于旗下部分基金 2026 年 7 月 1 日因港股通非交易日及境外主要投资市场节假日暂停申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告 | 《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》 | 2026-06-26 |

## 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 |
| 国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII） | 1 | 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 | 32,581,495.00 | 4,411,400.00 | 9,523,060.00 | 27,469,835.00 | 42.16% |
| 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、关于准予国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）注册的批复

2、国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同

3、国泰中证香港内地国有企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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