

国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

2024年第4季度报告

2024年12月31日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年一月二十二日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2025 年 01 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 10 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF） |
| 场内简称 | 国泰融丰 LOF |
| 基金主代码 | 501017 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 5 月 26 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 55,534,365.83 份 |
| 投资目标 | 深入挖掘并充分理解国内经济增长和结构转型所带来的外延式增长的投资机会，在积极把握宏观经济和市场发展趋势的基础上精选具有估值优势的公司股票进行投资，力争获取超越业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | 在有效控制风险的前提下，深入挖掘可能对行业或公司的当前或未来价值产生重大影响的事件，在积极把握宏观经济和市场发展趋势的基础上，将股权变动、资产重组等上市公司外延增长活动作为投资的主线，通过股票与债券等 |

| | | |
|-----------------|--|----------------------|
| | 资产的合理配置，力争基金资产的持续稳健增值。 本基金主要投资策略包括：1、大类资产配置策略；2、个股精选投资策略；3、存托凭证投资策略；4、固定收益类投资工具投资策略；5、股指期货交易策略；6、中小企业私募债投资策略；7、资产支持证券投资策略；8、权证投资策略。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40% | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益风险水平的投资品种。 | |
| 基金管理人 | 国泰基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）A | 国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）C |
| 下属分级基金的交易代码 | 501017 | 015017 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 53,838,443.14 份 | 1,695,922.69 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2024年10月1日-2024年12月31日) | |
|----------------|---------------------------------|----------------------|
| | 国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）A | 国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）C |
| 1.本期已实现收益 | 2,515,963.28 | 71,444.46 |
| 2.本期利润 | 346,481.86 | 7,481.53 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0060 | 0.0043 |
| 4.期末基金资产净值 | 62,524,297.72 | 1,946,522.81 |

| | | |
|------------|--------|--------|
| 5.期末基金份额净值 | 1.1613 | 1.1478 |
|------------|--------|--------|

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 本报告期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

1、国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）A：

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|--------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.40% | 0.52% | 0.04% | 1.04% | 0.36% | -0.52% |
| 过去六个月 | 4.05% | 0.45% | 10.11% | 0.98% | -6.06% | -0.53% |
| 过去一年 | 3.36% | 0.35% | 12.52% | 0.80% | -9.16% | -0.45% |
| 过去三年 | -1.17% | 0.28% | -6.00% | 0.70% | 4.83% | -0.42% |
| 过去五年 | 30.50% | 0.34% | 9.74% | 0.73% | 20.76% | -0.39% |
| 自基金转型 起至今 | 23.11% | 0.45% | 16.51% | 0.74% | 6.60% | -0.29% |

2、国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）C：

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.30% | 0.52% | 0.04% | 1.04% | 0.26% | -0.52% |
| 过去六个月 | 3.85% | 0.45% | 10.11% | 0.98% | -6.26% | -0.53% |
| 过去一年 | 2.96% | 0.35% | 12.52% | 0.80% | -9.56% | -0.45% |
| 自新增C类 份额起至今 | -0.50% | 0.27% | -1.59% | 0.70% | 1.09% | -0.43% |

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2017年11月27日至2024年12月31日)

1. 国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）A：



注：（1）本基金合同生效日为 2016 年 5 月 26 日。根据基金合同和国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书的有关规定，本基金的封闭期自 2016 年 5 月 26 日起至 2017 年 11 月 26 日止，自 2017 年 11 月 27 日起，本基金转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”；

（2）本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的建仓期为 3 个月，在 3 个月建仓结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

2. 国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）C：



注：（1）本基金合同生效日为 2016 年 5 月 26 日。根据基金合同和国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金招募说明书的有关规定，本基金的封闭期自 2016 年 5 月 26 日起至 2017 年 11 月 26 日止，自 2017 年 11 月 27 日起，本基金转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”；

（2）本基金转换为上市开放式基金（LOF）后的建仓期为 3 个月，在 3 个月建仓结束时，各项资产配置比例符合合同约定；

（3）自 2022 年 2 月 14 日起，本基金增加 C 类份额并分别设置对应的基金代码。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|-----------------------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 樊利安 | 国泰民益灵活配置混合（LOF）、国泰融丰外 | 2017-11-27 | - | 19 年 | 硕士。曾任职上海鑫地投资管理有限公司、天治基金管理有限公司等。2010 年 7 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2014 年 10 月起任国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（原国泰淘新灵活配置混合型证券投资 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | <p>延增长 灵活配 置混合 (LOF) 、国泰 科创板 两年定 期开放 混合、 国泰慧 益一年 持有混 合的基 金经理</p> | | | <p>基金)的基金经理,2014年10月至2024年1月任国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年1月至2018年8月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年3月至2019年1月任国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年5月至2020年5月任国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年6月至2019年12月任国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年6月至2018年2月任国泰生益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年6月至2017年1月任国泰金泰平衡混合型证券投资基金(由金泰证券投资基金转型而来)的基金经理,2016年5月至2017年11月任国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年8月至2018年8月任国泰添益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年10月至2018年4月任国泰福益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年11月至2018年12月任国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年12月至2019年12月任国泰普益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年12月至2020年5月任国泰安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年12月至2018年3月任国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年12月至2018年5月任国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年12月至2018年6月任国泰景益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年12月至2018年8月任国泰信益灵活配置混合型证券投资基金的</p> |
|--|--|--|--|--|

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>基金经理，2016 年 12 月至 2018 年 9 月任国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 5 月任国泰嘉益灵活配置混合型证券投资基金、国泰众益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 9 月任国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 7 月至 2018 年 11 月任国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 7 月至 2018 年 9 月任国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月至 2018 年 9 月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 11 月起兼任国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）的基金经理，2018 年 1 月至 2018 年 5 月任国泰瑞益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月至 2018 年 8 月任国泰恒益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 9 月至 2020 年 8 月任国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）的基金经理，2019 年 5 月至 2020 年 6 月任国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金和国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 8 月至 2020 年 10 月任国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 6 月至 2024 年 7 月任国泰宏益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 8 月至 2022 年 2 月任国泰浩益 18 个月封闭运作混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 4</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>月至 2023 年 11 月任国泰同益 18 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理，2022 年 2 月至 2024 年 5 月任国泰浩益混合型证券投资基金（由国泰浩益 18 个月封闭运作混合型证券投资基金变更而来）的基金经理，2022 年 2 月起兼任国泰科创板两年定期开放混合型证券投资基金的基金经理，2023 年 1 月至 2024 年 8 月任国泰安璟债券型证券投资基金的基金经理，2023 年 8 月起兼任国泰慧益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月至 2016 年 1 月任研究部副总监，2016 年 1 月至 2018 年 7 月任研究部副总监（主持工作），2018 年 7 月至 2019 年 7 月任研究部总监。</p> |
|--|--|--|--|---|

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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，

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，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，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，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年第四季度，A 股在井喷式暴涨后进入区间振荡，部分板块和主题表现活跃。具体来看，上证指数最终上涨 0.46%，深证成指下跌 1.09%，创业板指下跌 1.54%，前期跌幅较大的科创 50 指数上涨 13.36%。从申万一级行业来看，商贸零售、综合、电子及计算机行业涨幅超过 10%，而美容护理、有色金属、食品饮料三个行业跌幅较大，达到 10%左右。

三季度末，随着管理层一系列重磅政策的推出和落实，市场出现井喷式反转，上证指数在 6 个交易日最大涨幅达到 33.7%，随后在 3200-3500 点区间振荡，行业板块分化明显。总体风格上小盘成长占优，TMT 板块表现较好，尤其 AI 相关的半导体算力、通信、AI 端侧应用相关公司涨幅较大。另外，基于财政政策对消费的精准刺激，零售、纺织服装等消费相关行业也有较好表现。海外市场来看，美联储 9 月开启降息周期，2024 年下半年降息 3 次共 100BP，也为国内货币宽松提供了有利条件。不过，年末美国大选特朗普再次胜选，美国经济再通胀的风险加大，对中国商品大幅加征关税等因素也成为未来一段时间 A 股市场的潜在利空。

回顾本基金在 2024 年第四季度的投资操作，权益方面，我们 9 月中下旬逐步提升了股票仓位，增加了成长股的持仓占比，并在 10 月初锁定了部分收益。在债券投资方面，我们仍然以高等级信用债配置为主，并逐步加大了可转债的仓位，为组合贡献了较好收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类本报告期内的净值增长率为 0.40%，同期业绩比较基准收益率为 0.04%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为 0.30%，同期业绩比较基准收益率为 0.04%。

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 2025 年，我们看好中国经济和资本市场的总体表现。国内经济仍然面临着房地产市场的拖累，有效需求不足、通货紧缩的压力仍然存在，美国加征关税也制约着出口，但国内经济政策调整的力度也在加大。2024 年 12 月，中央经济工作会议对货币政策的基调进行了调整，由之前

的“稳健”转为“适度宽松”，这是时隔 10 多年来的首次转变，财政政策会更加积极，优化财政支出结构，提高财政赤字率，积极化解地方债务。同时，全方位扩大内需成为政策的最优先任务，延续消费补贴政策，实施消费提振专项行动。2025 年，内需和制造业投资将成为支撑经济增长的主要力量。

基于以上判断，我们认为 2025 年 A 股市场主要表现为结构性的机会。我们看好的方向包括以下几个方面：首先在科技方面，AI 产业仍然处于高速发展中，各大云厂商仍在大力布局算力建设；AI 端侧应用将重新定义可穿戴设备，AI 也成为汽车智能化、机器人等领域发展的加速器；创新药行业 2025 年也将有很多产品进入商业化的收获期；在强力政策的刺激下，低估值的消费行业有修复的机会；另外，我们继续看好黄金等大宗商品的机会，在逆全球化趋势下仍有较高投资价值。同时我们从中长周期也继续看好高股息板块的表现。债券方面我们仍然维持原有信用债票息策略不变。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|----------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 12,709,049.85 | 19.59 |
| | 其中：股票 | 12,709,049.85 | 19.59 |
| 2 | 固定收益投资 | 16,194,234.30 | 24.96 |
| | 其中：债券 | 16,194,234.30 | 24.96 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 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 | 银行存款和结算备付金合计 | 35,969,898.92 | 55.44 |
| 7 | 其他各项资产 | 11,692.60 | 0.02 |
| 8 | 合计 | 64,884,875.67 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 814,017.00 | 1.26 |
| C | 制造业 | 9,963,889.72 | 15.45 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 480,928.00 | 0.75 |
| E | 建筑业 | 582,131.00 | 0.90 |
| F | 批发和零售业 | 106,260.00 | 0.16 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 559,926.13 | 0.87 |
| J | 金融业 | 201,898.00 | 0.31 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 12,709,049.85 | 19.71 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净 |
|----|------|------|-------|---------|--------|
|----|------|------|-------|---------|--------|

| | | | | | 值比例(%) |
|----|--------|------|--------|--------------|--------|
| 1 | 300750 | 宁德时代 | 4,800 | 1,276,800.00 | 1.98 |
| 2 | 002475 | 立讯精密 | 17,400 | 709,224.00 | 1.10 |
| 3 | 601058 | 赛轮轮胎 | 41,500 | 594,695.00 | 0.92 |
| 4 | 300274 | 阳光电源 | 6,800 | 502,044.00 | 0.78 |
| 5 | 301525 | 儒竞科技 | 8,300 | 494,680.00 | 0.77 |
| 6 | 000543 | 皖能电力 | 60,800 | 480,928.00 | 0.75 |
| 7 | 600079 | 人福医药 | 18,200 | 425,516.00 | 0.66 |
| 8 | 601117 | 中国化学 | 47,100 | 390,459.00 | 0.61 |
| 9 | 600031 | 三一重工 | 23,200 | 382,336.00 | 0.59 |
| 10 | 601899 | 紫金矿业 | 25,100 | 379,512.00 | 0.59 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 16,194,234.30 | 25.12 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 16,194,234.30 | 25.12 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 110059 | 浦发转债 | 40,570 | 4,422,124.44 | 6.86 |
| 2 | 128124 | 科华转债 | 14,651 | 1,534,050.01 | 2.38 |
| 3 | 127016 | 鲁泰转债 | 9,520 | 1,070,841.68 | 1.66 |
| 4 | 113606 | 荣泰转债 | 7,640 | 865,193.37 | 1.34 |

| | | | | | |
|---|--------|------|-------|------------|------|
| 5 | 113046 | 金田转债 | 6,930 | 743,290.92 | 1.15 |
|---|--------|------|-------|------------|------|

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“浦发银行”违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

浦发银行下属分支机构因贷后管理不到位，流动资金贷款部分被挪用作股东投资款；贷前调查不尽职，部分个人贷款材料虚假；个人贷款未按约定用途使用；违反账户管理规定；违反清算管理规定；未尽职审查办理收汇业务等情形，受到金管局、央行、外管局分支机构的罚款、警告。

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。

5.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 11,262.98 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |

| | | |
|---|-------|-----------|
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 429.62 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 11,692.60 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|--------------|--------------|
| 1 | 110059 | 浦发转债 | 4,422,124.44 | 6.86 |
| 2 | 128124 | 科华转债 | 1,534,050.01 | 2.38 |
| 3 | 127016 | 鲁泰转债 | 1,070,841.68 | 1.66 |
| 4 | 113606 | 荣泰转债 | 865,193.37 | 1.34 |
| 5 | 113046 | 金田转债 | 743,290.92 | 1.15 |
| 6 | 113657 | 再22转债 | 742,339.18 | 1.15 |
| 7 | 123178 | 花园转债 | 690,311.23 | 1.07 |
| 8 | 118000 | 嘉元转债 | 677,512.70 | 1.05 |
| 9 | 128121 | 宏川转债 | 653,616.99 | 1.01 |
| 10 | 118034 | 晶能转债 | 648,038.26 | 1.01 |
| 11 | 113636 | 甬金转债 | 604,081.69 | 0.94 |
| 12 | 113047 | 旗滨转债 | 444,150.16 | 0.69 |
| 13 | 110087 | 天业转债 | 423,848.67 | 0.66 |
| 14 | 113059 | 福莱转债 | 416,415.25 | 0.65 |
| 15 | 127091 | 科数转债 | 400,055.33 | 0.62 |
| 16 | 110075 | 南航转债 | 399,205.87 | 0.62 |
| 17 | 128097 | 奥佳转债 | 394,813.19 | 0.61 |
| 18 | 113048 | 晶科转债 | 322,427.81 | 0.50 |
| 19 | 113640 | 苏利转债 | 316,233.60 | 0.49 |
| 20 | 123113 | 仙乐转债 | 239,718.85 | 0.37 |
| 21 | 127022 | 恒逸转债 | 185,965.10 | 0.29 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）A | 国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）C |
|----------------|----------------------|----------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 65,407,535.23 | 1,847,232.62 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 168,725.15 | 3,757.47 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 11,737,817.24 | 155,067.40 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 53,838,443.14 | 1,695,922.69 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | |
|--------------------------|-----------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 87,320.99 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 87,320.99 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.16 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金注册的批复
- 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

8.2 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。

8.3 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

二〇二五年一月二十二日