

国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 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 03 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年03月20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。

本报告期自2025年11月04日起至2025年12月31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..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 7 |
| § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 7 |
| 3.2 基金净值表现..... | 8 |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况..... | 10 |
| § 4 管理人报告 | 10 |
| 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..... | 13 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 14 |

| | |
|---|-----------|
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 15 |
| 4.9 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 | 15 |
| § 6 审计报告 | 15 |
| 6.1 审计报告基本信息 | 15 |
| 6.2 审计报告的基本内容 | 16 |
| § 7 年度财务报表 | 18 |
| 7.1 资产负债表 | 18 |
| 7.2 利润表 | 20 |
| 7.3 净资产变动表 | 22 |
| 7.4 报表附注 | 22 |
| § 8 投资组合报告 | 50 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 | 50 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 51 |
| 8.3 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 | 52 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 68 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 70 |
| 8.6 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 | 70 |
| 8.7 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 | 70 |

| | |
|--|-----------|
| 8.8 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..... | 71 |
| 8.9 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..... | 71 |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 71 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 71 |
| 8.12 投资组合报告附注..... | 71 |
| § 9 基金份额持有人信息..... | 72 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 72 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 72 |
| 9.3 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..... | 73 |
| 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况..... | 73 |
| § 10 开放式基金份额变动..... | 74 |
| § 11 重大事件揭示..... | 74 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议..... | 74 |
| 11.2 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..... | 74 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 75 |
| 11.4 基金投资策略的改变..... | 75 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 75 |
| 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况..... | 75 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 76 |
| 11.8 其他重大事件..... | 77 |
| § 12 影响投资者决策的其他重要信息..... | 77 |
| 12.1 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..... | 77 |

| | |
|--------------------------|-----------|
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 78 |
| § 13 备查文件目录 | 78 |
| 13.1 备查文件目录..... | 78 |
| 13.2 存放地点 | 78 |
| 13.3 查阅方式..... | 78 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|------------------------|---------------------|
| 基金名称 | 国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金 | |
| 基金简称 | 国泰海通稳健泰裕债券发起 | |
| 基金主代码 | 025000 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2025 年 11 月 04 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 | 1, 559, 222, 920. 51 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 国泰海通稳健泰裕债券发起 A | 国泰海通稳健泰裕债券发起 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 025000 | 025001 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 971, 224, 702. 65 份 | 587, 998, 217. 86 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。 |
| 投资策略 | 本基金将采取自上而下的投资策略对各种投资工具进行合理的配置。在风险与收益的匹配方面，力求降低信用风险，并在良好控制利率风险与市场风险的基础上力争为投资者获取稳定的收益。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价(总值)指数收益率×85%+中证 500 指数收益率×15% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 |

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 | 021-38676022 | 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 | 《上海证券报》 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.gthtzg.com |
| 基金年度报告备置地点 | 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 |
|--------|---------------------|---------------------------------|
| 会计师事务所 | 毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层 |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）-2025 年 12 月 31 日 | |
|---------------|--|----------------|
| | 国泰海通稳健泰裕债券发起 A | 国泰海通稳健泰裕债券发起 C |
| 本期已实现收益 | 1,614,123.40 | 610,063.38 |
| 本期利润 | 1,035,520.80 | 259,354.74 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0011 | 0.0004 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.11% | 0.04% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.11% | 0.04% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2025 年末 | |
| 期末可供分配利润 | 1,035,520.80 | 259,354.74 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0011 | 0.0004 |
| 期末基金资产净值 | 972,260,223.45 | 588,257,572.60 |
| 期末基金份额净值 | 1.0011 | 1.0004 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2025 年末 | |

| | | |
|-------------|-------|-------|
| 基金份额累计净值增长率 | 0.11% | 0.04% |
|-------------|-------|-------|

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）。

（4）本基金于 2025 年 11 月 04 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

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

国泰海通稳健泰裕债券发起 A 净值表现

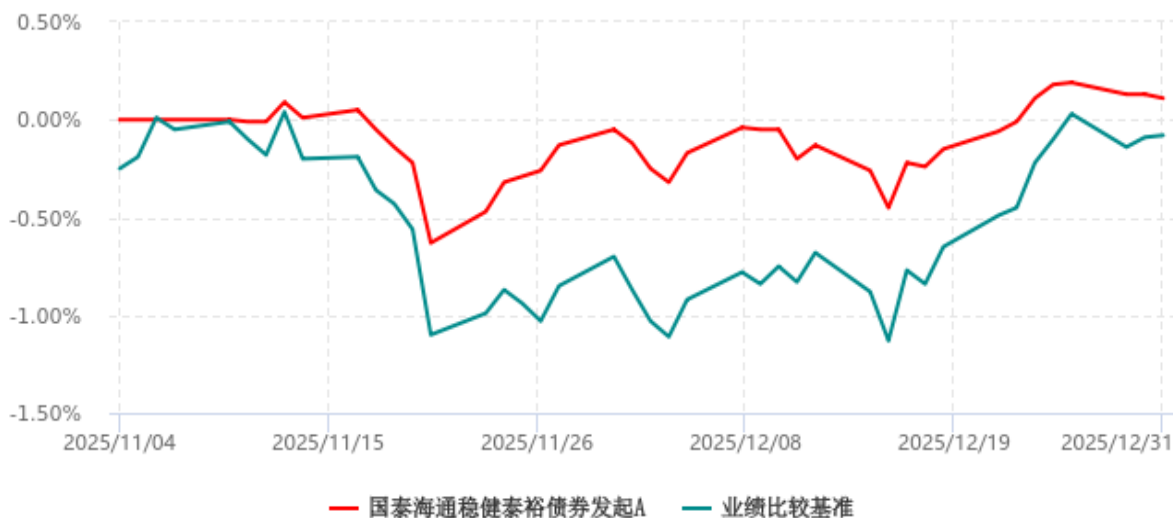
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 0.11% | 0.11% | -0.08% | 0.17% | 0.19% | -0.06% |

国泰海通稳健泰裕债券发起 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 自基金合同生效起至今 | 0.04% | 0.11% | -0.08% | 0.17% | 0.12% | -0.06% |

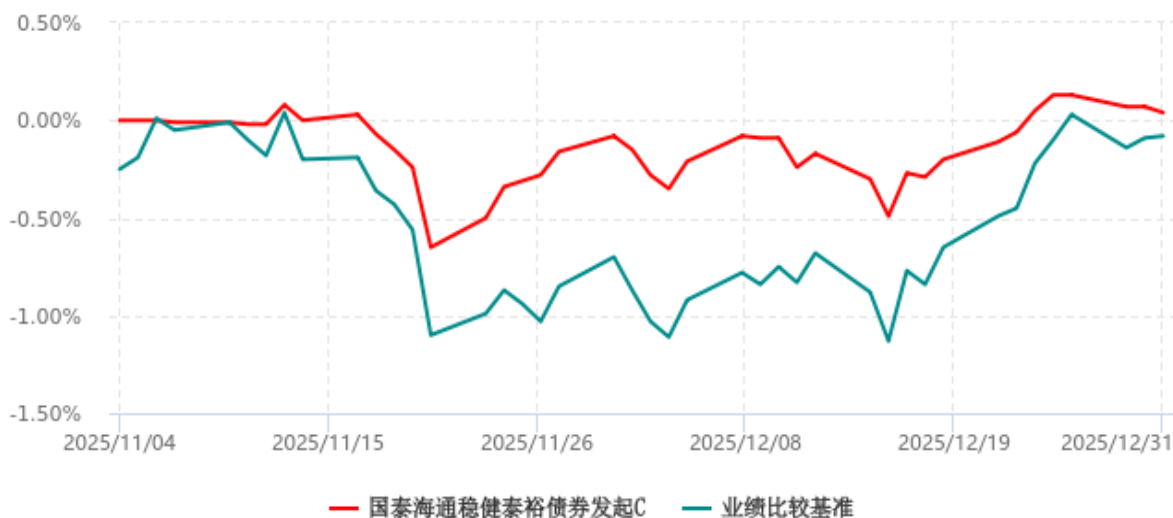
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰海通稳健泰裕债券发起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
(2025年11月04日-2025年12月31日)



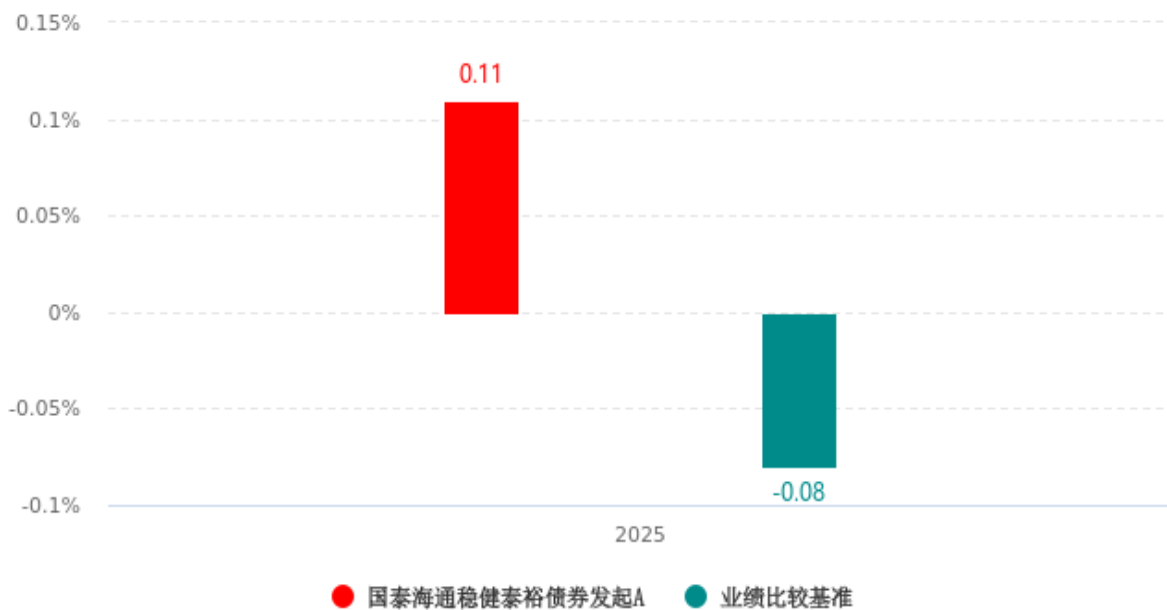
注：1、本基金于 2025 年 11 月 04 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。
2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，截止本报告期末基金成立未满六个月。

国泰海通稳健泰裕债券发起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
(2025年11月04日-2025年12月31日)

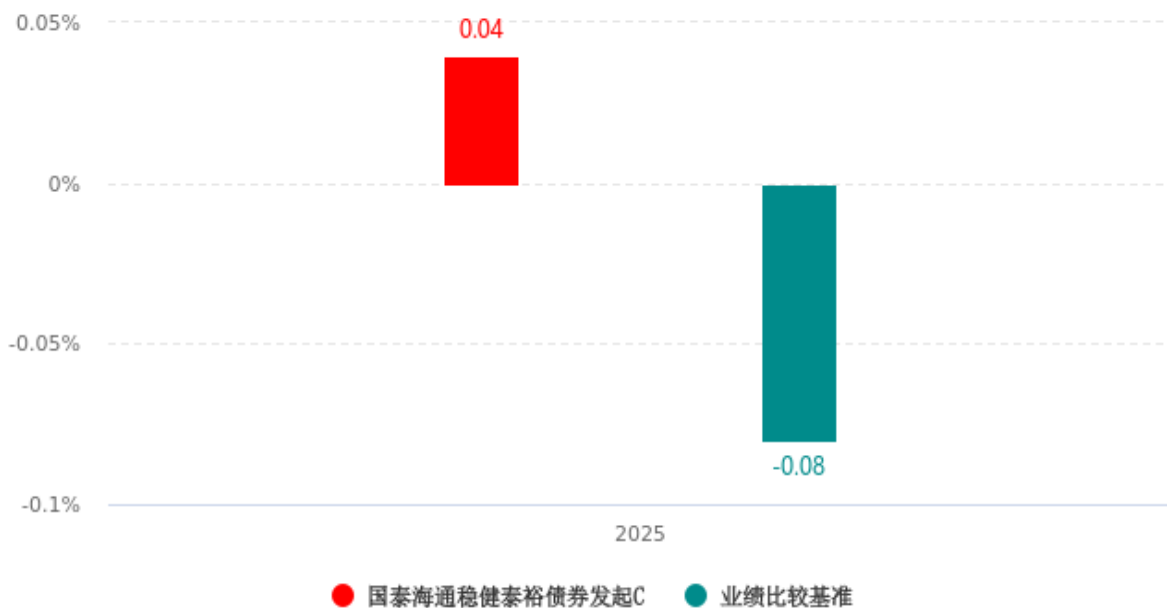


注：1、本基金于 2025 年 11 月 04 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。
2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，截止本报告期末基金成立未满六个月。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为 2025 年 11 月 04 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



注：本基金合同生效日为 2025 年 11 月 04 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

§ 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 2025 年 12 月 31 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 71 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 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 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，国泰海通稳债增利债券发起基金经理，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 | 2025-11-04 | - | 14 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。 |

| | | | | | |
|----|---|------------|---|-----|---|
| | 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。 | | | | |
| 刘明 | 国泰海通中债 0-3 年政策性金融债基金经理，国泰海通 180 天持有债券发起基金经理，国泰海通中债 1-3 年政金债基金经理，国泰海通稳健悦享 90 天持有债券发起基金经理，国泰海通稳健泰裕债券发起基金经理。现任固定收益投资部（北京）基金经理。 | 2025-11-04 | - | 8 年 | 刘明，北京大学经济学硕士，历任中国建设银行股份有限公司金融市场部投资经理，融通基金管理有限公司固定收益部投资经理、基金经理。2023 年 7 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，现任固定收益投资部（北京）基金经理。 |

注：1、上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《上海国泰海通证券资产管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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 1 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

2025 年债券市场打破单边下行的牛市行情，债市收益率总体呈现震荡调整，全年在修正“适度宽松”货币政策预期，并叠加中美经贸摩擦、权益市场上涨的冲击扰动，债券收益率在低位波动加大，长端上行幅度更为明显，10 年期国债到期收益率自年初 1.61% 上行 24BP 至年底 1.85%，30 年期国债到期收益率自年初 1.84% 上行 43BP 至年底 2.27%。本产品成立以来，权益市场经过一段时间震荡盘整后，迎来春季躁动和开门红行情。组合充分研判大类资产轮动，做好流动性管理的同时，通过量化的方法参与双创和红利的风格轮动和股票交易，力争创造稳健收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰海通稳健泰裕债券发起 A 基金份额净值为 1.0011 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.11%，同期业绩比较基准收益率为-0.08%；截至报告期末国泰海通稳健泰裕债券发起 C 基金份额净值为 1.0004 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.04%，同期业绩比较基准收益率为-0.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年为十五五开局之年，财政和货币政策仍将协同发力，预计货币政策主动性会有所提高；受地缘政治等因素影响的外部不确定性依然较大，全球各类风险资产进入价值重估阶段，黄金等贵金属波动加大，而债券作为避险品种有利于控制回撤，而股市行情在以科技为主线可能快速轮动和风格切换。开年一月份债市走出了超跌反弹，本质上是悲观预期修正的配置行情，个人预测 2026 全年债市总体表现或好于 2025 年，但可能延续结构性分化行情，短端受益于资金宽松确定性较强，长端围绕通胀预期及风险偏好波动加大；股市开年表现亮眼，本产品权益中枢也有所提升。本产品旨在通过量化的手段，在股债平衡中追求超额业绩，力求打造成中高波量化固收+代表性基

金。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合规运作角度出发，在合规文化建设、制度体系建设、合规审查及检查、反洗钱、员工执业行为规范等角度开展工作，不断深化员工的合规意识，推动公司合规文化和内部风险控制机制的完善和优化。

内部监察工作重点包括以下几个方面：

1、合规文化建设。管理人通过内外部合规培训、合规考试、法规解读、法律法规库维护更新、监管会议精神传达等多种形式推动公司合规文化建设，不断提高全体员工合规意识，为公司业务健康发展提供良好的文化土壤。

2、制度体系建设和完善。管理人根据法律法规变化，结合行业新动态，围绕新业务需要，不断优化和健全公司制度体系，并注重相关制度体系的落实和执行。通过制度体系的建设和完善，不断提升了业务管理流程的健全性、规范性、精细化和可操作性，为公司业务规范运营和合规管理进一步夯实了制度基础。

3、合规审查和检查。根据法律法规、监管要求和公司制度规定，做好对公司新业务、新产品、新投资品种及其他创新业务的法律合规及风险控制支持，定期对产品销售、投资、研究及交易等相关业务活动的日常合规性进行检查，查漏补缺。合规检查工作促进了内部控制管理的完善，防范了合规风险的进一步发生。

4、员工执业与投资行为管理。根据法律法规和公司制度要求，管理人不断加强员工执业行为管理。管理人要求新员工入职时需提供和完善个人信息并完成相关投资的申报工作，对投资、交易人员的通讯工具实行交易时间段集中管理，并对监控摄像、电子邮件、电话录音和即时通讯工具聊天记录定期进行合规检查。通过一系列常态化的员工执业和投资行为管理，促进员工执业和投资行为持续符合监管要求。

5、反洗钱合规管理。本报告期内，管理人持续加强反洗钱合规管理，制定反洗钱工作方案，并在年度内推进落实。持续做好日常可疑交易监控排查、客户风险等级划分、修订反洗钱内部控制管理制度、跟进反洗钱系统改造、完成各类反洗钱工作报告、反洗钱金融机构分类评级自评工作等。

管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部合规风控工作的科学性和有效性，努力防范和控制各类风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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约定，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。

4.8 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。

4.9 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

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

§ 5 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|--------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 毕马威华振审字第 2600291 号 |

6.2 审计报告的基本内容

| | |
|-----------|--|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金全体基金份额持有人 |
| 审计意见 | <p>我们审计了后附的国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，自 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> |
| 强调事项 | - |
| 其他事项 | - |
| 其他信息 | <p>该基金管理人上海国泰海通证券资产管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2025 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，</p> |

| | |
|------------------------|--|
| | <p>在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p> |
| <p>管理层和治理层对财务报表的责任</p> | <p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p> |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> |

| | |
|-----------|--|
| | <p>(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 注册会计师的姓名 | 虞京京 楚济铭 |
| 会计师事务所的地址 | 中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层 |
| 审计报告日期 | 2026-03-27 |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|----------------------|
| 资产： | | |
| 货币资金 | 7.4.7.1 | 51,019,857.79 |
| 结算备付金 | | 70,104,000.41 |
| 存出保证金 | | - |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 931,557,528.35 |
| 其中：股票投资 | | 181,344,327.81 |
| 基金投资 | | - |

| | | |
|---------------|------------|-----------------------------|
| 债券投资 | | 750,213,200.54 |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |
| 其他投资 | | - |
| 衍生金融资产 | | - |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.3 | 510,061,691.51 |
| 应收清算款 | | - |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | - |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 7.4.7.4 | - |
| 资产总计 | | 1,562,743,078.06 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 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 | | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - |
| 应付清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,459,161.33 |
| 应付托管费 | | 364,790.36 |
| 应付销售服务费 | | 366,772.53 |

| | | |
|-------------|---------|------------------|
| 应付投资顾问费 | | - |
| 应交税费 | | 13,169.29 |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 7.4.7.5 | 21,388.50 |
| 负债合计 | | 2,225,282.01 |
| 净资产： | | |
| 实收基金 | 7.4.7.6 | 1,559,222,920.51 |
| 未分配利润 | 7.4.7.7 | 1,294,875.54 |
| 净资产合计 | | 1,560,517,796.05 |
| 负债和净资产总计 | | 1,562,743,078.06 |

注：1、报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,559,222,920.51 份。其中国泰海通稳健泰裕债券发起 A 基金份额净值 1.0011 元，基金份额总额 971,224,702.65 份；国泰海通稳健泰裕债券发起 C 基金份额净值 1.0004 元，基金份额总额 587,998,217.86 份。

2、本基金于 2025 年 11 月 04 日成立，本财务报表的实际编制期间为 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止。

7.2 利润表

会计主体：国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|----------------|---------|--|
| 一、营业总收入 | | 3,526,622.09 |
| 1. 利息收入 | | 1,511,551.23 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.8 | 137,683.53 |
| 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 | | 1,372,694.07 |
| 其他利息收入 | | 1,173.63 |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 2,944,382.10 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.9 | 1,403,425.77 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.10 | 1,380,328.18 |
| 资产支持证券投资收益 | | - |
| 贵金属投资收益 | | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.11 | 30,761.38 |
| 股利收益 | 7.4.7.12 | 129,866.77 |
| 其他投资收益 | | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.13 | -929,311.24 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | | - |
| 减：二、营业总支出 | | 2,231,746.55 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 1,459,161.33 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 364,790.36 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 366,772.53 |
| 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 | | 2,288.52 |
| 8. 其他费用 | 7.4.7.14 | 38,733.81 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 1,294,875.54 |
| 减：所得税费用 | | - |

| | | |
|-------------------|--|--------------|
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 1,294,875.54 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - |
| 六、综合收益总额 | | 1,294,875.54 |

注：本基金于 2025 年 11 月 04 日成立，无上年度同期可比数据。

7.3 净资产变动表

会计主体：国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 | | |
|--|--|--------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 1,559,222,920.51 | - | 1,559,222,920.51 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | - | 1,294,875.54 | 1,294,875.54 |
| （一）、综合收益总额 | - | 1,294,875.54 | 1,294,875.54 |
| （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） | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| （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 | 1,559,222,920.51 | 1,294,875.54 | 1,560,517,796.05 |

注：本基金于 2025 年 11 月 04 日成立，无上年度同期可比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

陶耿

陶耿

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)经中国证券监

督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予国泰君安稳健泰裕债券型发起式证券投资基金》(证监许可[2025]1428号)批准,由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”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金》(以下简称“基金合同”)发售,基金合同于2025年11月4日生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期限不定期,首次设立募集规模为1,559,222,920.51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2500109号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金基金合同》于2025年11月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,559,222,920.51份基金份额,其中认购资金利息折合628,018.32份基金份额。本基金的基金管理人为国泰海通资管,托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,009,389.28份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金基金合同》,本基金根据认购费用、申购费用、销售服务费等收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购基金时收取认购费、申购费,而不计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资人认购、申购基金时不收取认购费、申购费,且从本类别基金资产中计提销售服务费的,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《国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金主要投资于国内依法发行上市的股票(包括主板、科创板、创业板以及其他经中国证监会允许上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可交换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、国债期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%,本基金投资于股票和存托凭证、可交换债券、可转换债券的投资比例为基金资产的5%-20%,其中投资于境内股票资产的比例不低于基金资产的5%。每个交易日日终,在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率 \times 85%+中证500指数收益率 \times 15%。

7.4.2 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 7.4.4 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。

7.4.3 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 7.4.2 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况、自 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、基金投资、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定期末偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准：

(1) 各类基金份额之间由于是否收取销售服务费的不同将导致在可供分配利润上有所不同；本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，红利再投资增加的份额计入基金份额总规模，投资人可选择现金红利或将现金红利转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类

基金份额的基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 法律、法规或中国证监会另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值或减值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 |
|----------------|----------------------|
| 活期存款 | 482,286.84 |
| 等于：本金 | 481,880.63 |
| 加：应计利息 | 406.21 |
| 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 | 50,537,570.95 |
| 等于：本金 | 50,536,827.62 |
| 加：应计利息 | 743.33 |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 51,019,857.79 |

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | | | |
|---------------|----------------------|----------------|----------------|----------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 181,049,019.31 | - | 181,344,327.81 | 295,308.50 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 889,162.74 | 117,442,562.74 | -755,415.87 |
| | 银行间市场 | 626,846,203.87 | 6,393,637.80 | -469,203.87 |
| | 合计 | 744,155,019.74 | 7,282,800.54 | 750,213,200.54 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |

| | | | | |
|----|----------------|--------------|----------------|-------------|
| 合计 | 925,204,039.05 | 7,282,800.54 | 931,557,528.35 | -929,311.24 |
|----|----------------|--------------|----------------|-------------|

7.4.7.3 买入返售金融资产

7.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | |
|-------|----------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 440,057,330.69 | - |
| 银行间市场 | 70,004,360.82 | - |
| 合计 | 510,061,691.51 | - |

7.4.7.3.2 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。

7.4.7.4 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 12 月 31 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 | 18,288.50 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 18,288.50 |
| 应付利息 | - |
| 预提账户维护费 | 3,100.00 |
| 合计 | 21,388.50 |

7.4.7.6 实收基金

国泰海通稳健泰裕债券发起 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|----|--|
|----|--|

| | 基金份额（份） | 账面金额 |
|---------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日 | 971,224,702.65 | 971,224,702.65 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 971,224,702.65 | 971,224,702.65 |

国泰海通稳健泰裕债券发起 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 | |
|---------------|--|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 587,998,217.86 | 587,998,217.86 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 587,998,217.86 | 587,998,217.86 |

7.4.7.7 未分配利润

国泰海通稳健泰裕债券发起 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 |
|----------------|--------------|-------------|--------------|
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 1,614,123.40 | -578,602.60 | 1,035,520.80 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,614,123.40 | -578,602.60 | 1,035,520.80 |

国泰海通稳健泰裕债券发起 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 |
|------------|------------|-------------|------------|
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 610,063.38 | -350,708.64 | 259,354.74 |
| 本期基金份额交易产生 | - | - | - |

| | | | |
|--------------|------------|-------------|------------|
| 的变动数 | | | |
| 其中：基金 申购款 | - | - | - |
| 基金 赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配 利润 | - | - | - |
| 本期末 | 610,063.38 | -350,708.64 | 259,354.74 |

7.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|-----------|--|
| 活期存款利息收入 | 56,901.15 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | 8,475.39 |
| 结算备付金利息收入 | 72,306.99 |
| 其他 | - |
| 合计 | 137,683.53 |

7.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|------------|--|
| 卖出股票成交总额 | 243,302,232.00 |
| 减：卖出股票成本总额 | 241,661,916.03 |
| 减：交易费用 | 236,890.20 |
| 买卖股票差价收入 | 1,403,425.77 |

7.4.7.10 债券投资收益

7.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|--------------------------------------|--|
| 债券投资收益——利息收入 | 1,711,017.65 |
| 债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付）差 价收入 | -330,689.47 |
| 债券投资收益——赎回差价收 | - |

| | |
|----------------|--------------|
| 入 | |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 1,380,328.18 |

7.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|------------------------|--|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 721,498,091.22 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 717,459,379.26 |
| 减：应计利息总额 | 4,347,313.22 |
| 减：交易费用 | 22,088.21 |
| 买卖债券差价收入 | -330,689.47 |

7.4.7.11 衍生工具收益

7.4.7.11.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|------------------|--|
| 国债期货投资收益 | 32,000.00 |
| 减：其他衍生工具收益应缴纳增值税 | 932.04 |
| 减：交易费用 | 306.58 |
| 合计 | 30,761.38 |

7.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|---------------|--|
| 股票投资产生的股利收益 | 129,866.77 |
| 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 | 129,866.77 |

7.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|------------------------|--|
| 1. 交易性金融资产 | -929,311.24 |
| ——股票投资 | 295,308.50 |
| ——债券投资 | -1,224,619.74 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | -929,311.24 |

7.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|---------|--|
| 审计费用 | - |
| 信息披露费 | 30,000.00 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费 | 5,633.81 |
| 账户维护费 | 3,100.00 |
| 合计 | 38,733.81 |

7.4.7.15 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 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 |

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 | |
|--------|--|--------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 国泰海通证券 | 278,388,720.64 | 41.80% |

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 | |
|--------|--|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 国泰海通证券 | 1,328,827,931.52 | 100.00% |

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 | |
|--------|--|----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 国泰海通证券 | 4,809,000,000.00 | 100.00% |

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 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 | 33,132.13 | 38.61% | 0.00 | 0.00% |

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,459,161.33 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 710,831.94 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 748,329.39 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 |
|----------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 364,790.36 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 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 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 | | |
|----------------|--|----------------|------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 国泰海通稳健泰裕债券发起 A | 国泰海通稳健泰裕债券发起 C | 合计 |
| 建设银行 | - | 280,934.97 | 280,934.97 |
| 国泰海通资管 | - | 1,272.60 | 1,272.60 |
| 国泰海通证券 | - | 68,926.79 | 68,926.79 |
| 合计 | - | 351,134.36 | 351,134.36 |

注：销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，其中，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%。

本基金 C 类基金份额的基金销售服务费计提的计算公式如下：

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

H 为每日应计提 C 类基金份额的基金销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

本基金本报告期末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。

7.4.10.4.2 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

本基金本报告期末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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国泰海通稳健泰裕债券发起 A

份额单位：份

| 项目 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日） 至 2025 年 12 月 31 日 |
|--------------------------------------|--|
| 基金合同生效日（2025 年 11 月 04 日）持有的 基金份额 | 8,009,311.50 |
| 报告期初持有的基金份额 | - |
| 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 | 8,009,311.50 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.82% |

国泰海通稳健泰裕债券发起 C

份额单位：份

| 项目 | 本期 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日） 至 2025 年 12 月 31 日 |
|--------------------------------------|--|
| 基金合同生效日（2025 年 11 月 04 日）持有的 基金份额 | 2,000,077.78 |
| 报告期初持有的基金份额 | - |
| 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 | 2,000,077.78 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.34% |

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。

7.4.10.5.2 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，本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 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 2025 年 11 月 04 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日 | |
|--------|--|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 国泰海通证券 | 3,958,526.15 | 6,113.73 |
| 建设银行 | 482,286.84 | 56,901.15 |

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须做说明的其他关联方交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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/增发证券而流通受限证券。

7.4.12.2 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 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量（股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|------------|--------|------------|--------|-------|------------|------------|----|
| 688012 | 中微公司 | 2025-12-19 | 筹划发行股份购买资产 | 272.72 | 2026-01-05 | 278.00 | 600 | 168,417.04 | 163,632.00 | - |

| | | | | | | | | | |
|--|--|--|---|--|--|--|--|--|--|
| | | | 产 | | | | | | |
|--|--|--|---|--|--|--|--|--|--|

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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同责任，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、国金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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|
|--------|----------------------|

| | |
|--------|----------------|
| A-1 | - |
| A-1 以下 | - |
| 未评级 | 100,328,613.70 |
| 合计 | 100,328,613.70 |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、本基金持有的未评级债券包括政策性金融债、超短期融资券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|
| AAA | 87,090,729.32 |
| AAA 以下 | - |
| 未评级 | 562,793,857.52 |
| 合计 | 649,884,586.84 |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、本基金持有的未评级债券包括国债、政策性金融债、公司债、中期票据。

7.4.13.3 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 2025 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，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。

7.4.13.3.1 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发行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%。

本基金所持证券大部分在银行间市场交易，其余亦可在证券交易所交易，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 7.4.12。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| | | | | | |
|------------------------------------|-------|-------|-------|-----|----|
| 本 期 末 202 5 年 12 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------------------|-------|-------|-------|-----|----|

| | | | | | |
|--------------|----------------|----------------|----------------|----------------|------------------|
| 月 31 日 | | | | | |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 51,019,857.79 | - | - | - | 51,019,857.79 |
| 结算备付金 | 70,104,000.41 | - | - | - | 70,104,000.41 |
| 交易性金融资产 | 161,359,948.49 | 426,354,615.89 | 162,498,636.16 | 181,344,327.81 | 931,557,528.35 |
| 买入返售金融资产 | 510,061,691.51 | - | - | - | 510,061,691.51 |
| 资产总计 | 792,545,498.20 | 426,354,615.89 | 162,498,636.16 | 181,344,327.81 | 1,562,743,078.06 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,459,161.33 | 1,459,161.33 |
| 应付 | - | - | - | 364,790.36 | 364,790.36 |

| | | | | | |
|---------|----------------|----------------|----------------|----------------|------------------|
| 托管费 | | | | | |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 366,772.53 | 366,772.53 |
| 应交税费 | - | - | - | 13,169.29 | 13,169.29 |
| 其他负债 | - | - | - | 21,388.50 | 21,388.50 |
| 负债总计 | - | - | - | 2,225,282.01 | 2,225,282.01 |
| 利率敏感度缺口 | 792,545,498.20 | 426,354,615.89 | 162,498,636.16 | 179,119,045.80 | 1,560,517,796.05 |

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动 | |
|----|---------------------------|-----------------------------|
| 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 2025 年 12 月 31 日 |
| | 基准利率点利率增加 0.1% | -2,620,706.29 |
| | 基准利率点利率减少 0.1% | 2,638,747.88 |

注：上表反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债

券公允价值的变动将对基金净值产生的影响

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 12 月 31 日 | |
|---------------|----------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 181,344,327.81 | 11.62 |
| 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 | 181,344,327.81 | 11.62 |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 11.62%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------------|
| 第一层次 | 181,180,695.81 |
| 第二层次 | 750,376,832.54 |
| 第三层次 | - |
| 合计 | 931,557,528.35 |

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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 | 181,344,327.81 | 11.60 |
| | 其中：股票 | 181,344,327.81 | 11.60 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 750,213,200.54 | 48.01 |
| | 其中：债券 | 750,213,200.54 | 48.01 |
| | 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 | 510,061,691.51 | 32.64 |
| | 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 | 121,123,858.20 | 7.75 |
| 8 | 其他各项资产 | - | - |
| 9 | 合计 | 1,562,743,078.06 | 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%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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 | 412,395.00 | 0.03 |
| B | 采矿业 | 6,622,765.00 | 0.42 |
| C | 制造业 | 117,481,190.08 | 7.53 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,185,405.00 | 0.20 |
| E | 建筑业 | 2,084,952.00 | 0.13 |
| F | 批发和零售业 | 5,266,531.00 | 0.34 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 4,236,958.00 | 0.27 |
| H | 住宿和餐饮业 | 893,284.00 | 0.06 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 15,773,545.09 | 1.01 |
| J | 金融业 | 13,380,205.00 | 0.86 |
| K | 房地产业 | 1,576,184.00 | 0.10 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,051,132.00 | 0.20 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 3,903,617.64 | 0.25 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,434,110.00 | 0.16 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------|----------------|-------|
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 49,565.00 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 914,840.00 | 0.06 |
| S | 综合 | 77,649.00 | 0.00 |
| | 合计 | 181,344,327.81 | 11.62 |

8.2.2 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。

8.3 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（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 300750 | 宁德时代 | 25,200 | 9,254,952.00 | 0.59 |
| 2 | 300308 | 中际旭创 | 5,700 | 3,477,000.00 | 0.22 |
| 3 | 300502 | 新易盛 | 6,100 | 2,628,368.00 | 0.17 |
| 4 | 688041 | 海光信息 | 10,400 | 2,333,864.00 | 0.15 |
| 5 | 688981 | 中芯国际 | 18,000 | 2,210,940.00 | 0.14 |
| 6 | 688256 | 寒武纪 | 1,600 | 2,168,880.00 | 0.14 |
| 7 | 300433 | 蓝思科技 | 71,400 | 2,161,278.00 | 0.14 |
| 8 | 300274 | 阳光电源 | 12,200 | 2,086,688.00 | 0.13 |
| 9 | 300394 | 天孚通信 | 8,200 | 1,664,846.00 | 0.11 |
| 10 | 300604 | 长川科技 | 14,900 | 1,509,519.00 | 0.10 |
| 11 | 601398 | 工商银行 | 187,800 | 1,489,254.00 | 0.10 |
| 12 | 601077 | 渝农商行 | 221,200 | 1,428,952.00 | 0.09 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|------------------|------|
| 13 | 300008 | 天海防务 | 168,700 | 1,331,043.0 0 | 0.09 |
| 14 | 300206 | 理邦仪器 | 101,300 | 1,295,627.0 0 | 0.08 |
| 15 | 600919 | 江苏银行 | 123,600 | 1,285,440.0 0 | 0.08 |
| 16 | 688396 | 华润微 | 24,200 | 1,279,212.0 0 | 0.08 |
| 17 | 600188 | 兖矿能源 | 96,300 | 1,266,345.0 0 | 0.08 |
| 18 | 300760 | 迈瑞医疗 | 6,600 | 1,256,970.0 0 | 0.08 |
| 19 | 300438 | 鹏辉能源 | 23,100 | 1,229,382.0 0 | 0.08 |
| 20 | 688336 | 三生国健 | 20,223 | 1,204,684.1 1 | 0.08 |
| 21 | 600015 | 华夏银行 | 169,100 | 1,161,717.0 0 | 0.07 |
| 22 | 600019 | 宝钢股份 | 154,900 | 1,154,005.0 0 | 0.07 |
| 23 | 688365 | 光云科技 | 67,300 | 1,135,351.0 0 | 0.07 |
| 24 | 601009 | 南京银行 | 98,500 | 1,125,855.0 0 | 0.07 |
| 25 | 300775 | 三角防务 | 36,700 | 1,115,680.0 0 | 0.07 |
| 26 | 300034 | 钢研高纳 | 56,100 | 1,098,438.0 0 | 0.07 |
| 27 | 300127 | 银河磁体 | 36,200 | 1,097,946.0 0 | 0.07 |
| 28 | 301408 | 华人健康 | 58,300 | 1,082,048.0 0 | 0.07 |
| 29 | 688772 | 珠海冠宇 | 49,900 | 1,074,347.0 0 | 0.07 |
| 30 | 002004 | 华邦健康 | 222,200 | 1,062,116.0 0 | 0.07 |
| 31 | 688385 | 复旦微电 | 14,000 | 1,031,800.0 0 | 0.07 |
| 32 | 300033 | 同花顺 | 3,200 | 1,030,976.0 0 | 0.07 |
| 33 | 002367 | 康力电梯 | 127,800 | 1,030,068.0 0 | 0.07 |
| 34 | 300709 | 精研科技 | 20,900 | 985,644.00 | 0.06 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 35 | 301526 | 国际复材 | 140,300 | 982,100.00 | 0.06 |
| 36 | 688779 | 五矿新能 | 131,100 | 981,939.00 | 0.06 |
| 37 | 300129 | 泰胜风能 | 91,700 | 959,182.00 | 0.06 |
| 38 | 601898 | 中煤能源 | 76,700 | 954,148.00 | 0.06 |
| 39 | 300735 | 光弘科技 | 38,000 | 944,680.00 | 0.06 |
| 40 | 300358 | 楚天科技 | 96,100 | 940,819.00 | 0.06 |
| 41 | 300867 | 圣元环保 | 48,800 | 930,128.00 | 0.06 |
| 42 | 688208 | 道通科技 | 24,832 | 913,817.60 | 0.06 |
| 43 | 302132 | 中航成飞 | 11,500 | 908,500.00 | 0.06 |
| 44 | 301529 | 福赛科技 | 8,000 | 904,800.00 | 0.06 |
| 45 | 600742 | 富维股份 | 87,600 | 876,000.00 | 0.06 |
| 46 | 300132 | 青松股份 | 100,400 | 874,484.00 | 0.06 |
| 47 | 002758 | 浙农股份 | 86,700 | 873,069.00 | 0.06 |
| 48 | 688347 | 华虹公司 | 8,000 | 862,960.00 | 0.06 |
| 49 | 300063 | 天龙集团 | 99,700 | 854,429.00 | 0.05 |
| 50 | 000895 | 双汇发展 | 32,000 | 847,040.00 | 0.05 |
| 51 | 600057 | 厦门象屿 | 98,800 | 841,776.00 | 0.05 |
| 52 | 600039 | 四川路桥 | 84,400 | 839,780.00 | 0.05 |
| 53 | 688700 | 东威科技 | 23,288 | 821,600.64 | 0.05 |
| 54 | 600795 | 国电电力 | 158,800 | 800,352.00 | 0.05 |
| 55 | 688629 | 华丰科技 | 7,900 | 790,474.00 | 0.05 |
| 56 | 000726 | 鲁泰 A | 110,500 | 786,760.00 | 0.05 |
| 57 | 601107 | 四川成渝 | 127,100 | 772,768.00 | 0.05 |
| 58 | 301150 | 中一科技 | 18,200 | 764,218.00 | 0.05 |
| 59 | 300014 | 亿纬锂能 | 11,600 | 762,816.00 | 0.05 |
| 60 | 300219 | 鸿利智汇 | 104,400 | 752,724.00 | 0.05 |
| 61 | 688023 | 安恒信息 | 14,602 | 750,688.82 | 0.05 |
| 62 | 300171 | 东富龙 | 47,700 | 748,890.00 | 0.05 |
| 63 | 301038 | 深水规院 | 31,900 | 748,055.00 | 0.05 |
| 64 | 688280 | 精进电动 | 85,900 | 747,330.00 | 0.05 |
| 65 | 601225 | 陕西煤业 | 34,800 | 741,936.00 | 0.05 |
| 66 | 300139 | 晓程科技 | 24,200 | 734,712.00 | 0.05 |
| 67 | 300172 | 中电环保 | 133,100 | 725,395.00 | 0.05 |
| 68 | 600814 | 杭州解百 | 89,100 | 721,710.00 | 0.05 |
| 69 | 300945 | 曼卡龙 | 44,200 | 714,272.00 | 0.05 |
| 70 | 688387 | 信科移动 | 55,300 | 713,370.00 | 0.05 |
| 71 | 002293 | 罗莱生活 | 68,700 | 705,549.00 | 0.05 |
| 72 | 601229 | 上海银行 | 69,300 | 699,930.00 | 0.04 |
| 73 | 600016 | 民生银行 | 178,100 | 682,123.00 | 0.04 |
| 74 | 300753 | 爱朋医疗 | 23,500 | 652,125.00 | 0.04 |
| 75 | 301082 | 久盛电气 | 36,400 | 651,560.00 | 0.04 |
| 76 | 002111 | 威海广泰 | 61,300 | 644,876.00 | 0.04 |
| 77 | 300456 | 赛微电子 | 11,400 | 637,944.00 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 78 | 300299 | 富春股份 | 89,500 | 635,450.00 | 0.04 |
| 79 | 300768 | 迪普科技 | 34,000 | 630,020.00 | 0.04 |
| 80 | 600011 | 华能国际 | 83,600 | 623,656.00 | 0.04 |
| 81 | 300059 | 东方财富 | 26,600 | 616,588.00 | 0.04 |
| 82 | 600546 | 山煤国际 | 60,700 | 612,463.00 | 0.04 |
| 83 | 300570 | 太辰光 | 5,300 | 612,415.00 | 0.04 |
| 84 | 600267 | 海正药业 | 61,300 | 606,257.00 | 0.04 |
| 85 | 300620 | 光库科技 | 4,100 | 602,905.00 | 0.04 |
| 86 | 688222 | 成都先导 | 25,700 | 602,665.00 | 0.04 |
| 87 | 300381 | 溢多利 | 90,600 | 590,712.00 | 0.04 |
| 88 | 600028 | 中国石化 | 94,500 | 584,010.00 | 0.04 |
| 89 | 688499 | 利元亨 | 10,100 | 582,972.00 | 0.04 |
| 90 | 300221 | 银禧科技 | 56,400 | 582,048.00 | 0.04 |
| 91 | 601988 | 中国银行 | 101,200 | 579,876.00 | 0.04 |
| 92 | 301073 | 君亭酒店 | 22,100 | 575,926.00 | 0.04 |
| 93 | 688111 | 金山办公 | 1,864 | 572,378.48 | 0.04 |
| 94 | 300805 | 电声股份 | 53,200 | 561,260.00 | 0.04 |
| 95 | 601918 | 新集能源 | 84,800 | 560,528.00 | 0.04 |
| 96 | 300741 | 华宝股份 | 29,900 | 555,542.00 | 0.04 |
| 97 | 300296 | 利亚德 | 87,900 | 555,528.00 | 0.04 |
| 98 | 300662 | 科锐国际 | 21,700 | 549,661.00 | 0.04 |
| 99 | 688521 | 芯原股份 | 4,000 | 547,880.00 | 0.04 |
| 100 | 688062 | 迈威生物 | 14,100 | 542,427.00 | 0.03 |
| 101 | 301611 | 珂玛科技 | 6,300 | 540,099.00 | 0.03 |
| 102 | 600007 | 中国国贸 | 27,200 | 539,104.00 | 0.03 |
| 103 | 300905 | 宝丽迪 | 16,700 | 538,241.00 | 0.03 |
| 104 | 300259 | 新天科技 | 120,100 | 533,244.00 | 0.03 |
| 105 | 002142 | 宁波银行 | 18,900 | 530,901.00 | 0.03 |
| 106 | 688275 | 万润新能 | 7,000 | 527,800.00 | 0.03 |
| 107 | 688255 | 凯尔达 | 14,348 | 525,567.24 | 0.03 |
| 108 | 301116 | 益客食品 | 48,000 | 524,640.00 | 0.03 |
| 109 | 600018 | 上港集团 | 95,400 | 517,068.00 | 0.03 |
| 110 | 600757 | 长江传媒 | 58,200 | 516,816.00 | 0.03 |
| 111 | 300201 | 海伦哲 | 75,600 | 516,348.00 | 0.03 |
| 112 | 300644 | 南京聚隆 | 13,900 | 513,049.00 | 0.03 |
| 113 | 600717 | 天津港 | 113,200 | 506,004.00 | 0.03 |
| 114 | 603365 | 水星家纺 | 24,000 | 504,960.00 | 0.03 |
| 115 | 688484 | 南芯科技 | 12,400 | 504,184.00 | 0.03 |
| 116 | 300016 | 北陆药业 | 63,000 | 500,220.00 | 0.03 |
| 117 | 002940 | 昂利康 | 14,900 | 499,448.00 | 0.03 |
| 118 | 300434 | 金石亚药 | 48,500 | 498,580.00 | 0.03 |
| 119 | 601728 | 中国电信 | 77,600 | 488,880.00 | 0.03 |
| 120 | 601326 | 秦港股份 | 139,100 | 485,459.00 | 0.03 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 121 | 688146 | 中船特气 | 11,800 | 476,720.00 | 0.03 |
| 122 | 600300 | 维维股份 | 135,000 | 473,850.00 | 0.03 |
| 123 | 600853 | 龙建股份 | 108,400 | 469,372.00 | 0.03 |
| 124 | 601857 | 中国石油 | 44,500 | 463,245.00 | 0.03 |
| 125 | 300289 | 利德曼 | 65,900 | 459,323.00 | 0.03 |
| 126 | 300771 | 智莱科技 | 29,500 | 457,250.00 | 0.03 |
| 127 | 688001 | 华兴源创 | 14,984 | 452,217.12 | 0.03 |
| 128 | 688008 | 澜起科技 | 3,800 | 447,640.00 | 0.03 |
| 129 | 301175 | 中科环保 | 75,600 | 446,796.00 | 0.03 |
| 130 | 300698 | 万马科技 | 10,500 | 442,365.00 | 0.03 |
| 131 | 300509 | 新美星 | 34,400 | 441,696.00 | 0.03 |
| 132 | 300973 | 立高食品 | 10,200 | 438,600.00 | 0.03 |
| 133 | 300382 | 斯莱克 | 28,100 | 437,236.00 | 0.03 |
| 134 | 002116 | 中国海诚 | 42,100 | 432,788.00 | 0.03 |
| 135 | 300726 | 宏达电子 | 8,500 | 432,735.00 | 0.03 |
| 136 | 300407 | 凯发电气 | 38,100 | 431,292.00 | 0.03 |
| 137 | 300248 | 新开普 | 34,700 | 430,627.00 | 0.03 |
| 138 | 688584 | 上海合晶 | 19,600 | 430,024.00 | 0.03 |
| 139 | 301365 | 矩阵股份 | 17,900 | 426,736.00 | 0.03 |
| 140 | 002091 | 江苏国泰 | 47,200 | 426,216.00 | 0.03 |
| 141 | 300214 | 日科化学 | 63,700 | 425,516.00 | 0.03 |
| 142 | 688046 | 药康生物 | 27,689 | 425,303.04 | 0.03 |
| 143 | 688525 | 佰维存储 | 3,700 | 424,723.00 | 0.03 |
| 144 | 688333 | 铂力特 | 3,800 | 423,738.00 | 0.03 |
| 145 | 688141 | 杰华特 | 9,700 | 421,271.00 | 0.03 |
| 146 | 300101 | 振芯科技 | 14,800 | 420,764.00 | 0.03 |
| 147 | 688220 | 翱捷科技 | 5,026 | 415,197.86 | 0.03 |
| 148 | 688249 | 晶合集成 | 12,500 | 414,875.00 | 0.03 |
| 149 | 300513 | 恒实科技 | 43,100 | 409,019.00 | 0.03 |
| 150 | 002746 | 仙坛股份 | 66,800 | 405,476.00 | 0.03 |
| 151 | 688331 | 荣昌生物 | 5,200 | 404,508.00 | 0.03 |
| 152 | 600741 | 华域汽车 | 20,000 | 400,000.00 | 0.03 |
| 153 | 300702 | 天宇股份 | 16,900 | 398,840.00 | 0.03 |
| 154 | 300017 | 网宿科技 | 38,900 | 398,725.00 | 0.03 |
| 155 | 300375 | 鹏翎股份 | 75,200 | 395,552.00 | 0.03 |
| 156 | 301128 | 强瑞技术 | 3,900 | 393,549.00 | 0.03 |
| 157 | 300596 | 利安隆 | 9,300 | 392,553.00 | 0.03 |
| 158 | 688187 | 时代电气 | 7,100 | 364,159.00 | 0.02 |
| 159 | 688435 | 英方软件 | 7,700 | 360,129.00 | 0.02 |
| 160 | 301536 | 星辰科技 | 6,000 | 359,460.00 | 0.02 |
| 161 | 601169 | 北京银行 | 64,900 | 355,652.00 | 0.02 |
| 162 | 300917 | 特发服务 | 9,000 | 351,900.00 | 0.02 |
| 163 | 301158 | 德石股份 | 15,700 | 351,209.00 | 0.02 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 164 | 300872 | 天阳科技 | 17,000 | 349,520.00 | 0.02 |
| 165 | 300476 | 胜宏科技 | 1,200 | 345,096.00 | 0.02 |
| 166 | 601997 | 贵阳银行 | 58,700 | 344,569.00 | 0.02 |
| 167 | 601088 | 中国神华 | 8,500 | 344,250.00 | 0.02 |
| 168 | 000990 | 诚志股份 | 43,300 | 342,936.00 | 0.02 |
| 169 | 300884 | 狄耐克 | 23,000 | 340,400.00 | 0.02 |
| 170 | 688158 | 优刻得 | 12,100 | 339,889.00 | 0.02 |
| 171 | 301236 | 软通动力 | 7,100 | 336,753.00 | 0.02 |
| 172 | 688561 | 奇安信 | 9,326 | 331,819.08 | 0.02 |
| 173 | 601298 | 青岛港 | 39,600 | 330,264.00 | 0.02 |
| 174 | 300277 | 海联讯 | 25,200 | 328,860.00 | 0.02 |
| 175 | 002440 | 闰土股份 | 43,100 | 321,957.00 | 0.02 |
| 176 | 301138 | 华研精机 | 8,200 | 318,160.00 | 0.02 |
| 177 | 688095 | 福昕软件 | 3,539 | 315,926.53 | 0.02 |
| 178 | 000919 | 金陵药业 | 39,600 | 314,820.00 | 0.02 |
| 179 | 002033 | 丽江股份 | 33,900 | 310,185.00 | 0.02 |
| 180 | 688162 | 巨一科技 | 10,066 | 310,032.80 | 0.02 |
| 181 | 688668 | 鼎通科技 | 2,500 | 310,000.00 | 0.02 |
| 182 | 002016 | 世荣兆业 | 53,500 | 309,230.00 | 0.02 |
| 183 | 603167 | 渤海轮渡 | 32,700 | 308,361.00 | 0.02 |
| 184 | 301509 | 金凯生科 | 9,100 | 307,398.00 | 0.02 |
| 185 | 000011 | 深物业 A | 33,900 | 305,439.00 | 0.02 |
| 186 | 600690 | 海尔智家 | 11,700 | 305,253.00 | 0.02 |
| 187 | 300733 | 西菱动力 | 16,000 | 300,640.00 | 0.02 |
| 188 | 300118 | 东方日升 | 20,500 | 300,530.00 | 0.02 |
| 189 | 301022 | 海泰科 | 9,000 | 297,810.00 | 0.02 |
| 190 | 601658 | 邮储银行 | 54,000 | 294,300.00 | 0.02 |
| 191 | 300774 | 倍杰特 | 15,400 | 292,600.00 | 0.02 |
| 192 | 601998 | 中信银行 | 37,900 | 291,830.00 | 0.02 |
| 193 | 300995 | 奇德新材 | 7,000 | 289,170.00 | 0.02 |
| 194 | 301558 | 三态股份 | 35,400 | 288,510.00 | 0.02 |
| 195 | 300681 | 英搏尔 | 11,500 | 288,190.00 | 0.02 |
| 196 | 300207 | 欣旺达 | 11,000 | 287,650.00 | 0.02 |
| 197 | 600585 | 海螺水泥 | 13,100 | 286,366.00 | 0.02 |
| 198 | 601117 | 中国化学 | 37,900 | 285,387.00 | 0.02 |
| 199 | 002556 | 辉隆股份 | 46,800 | 282,672.00 | 0.02 |
| 200 | 600573 | 惠泉啤酒 | 23,600 | 281,548.00 | 0.02 |
| 201 | 300043 | 星辉娱乐 | 49,800 | 281,370.00 | 0.02 |
| 202 | 300747 | 锐科激光 | 10,400 | 281,112.00 | 0.02 |
| 203 | 300898 | 熊猫乳品 | 10,300 | 277,379.00 | 0.02 |
| 204 | 688148 | 芳源股份 | 31,500 | 276,255.00 | 0.02 |
| 205 | 300347 | 泰格医药 | 4,800 | 272,160.00 | 0.02 |
| 206 | 688135 | 利扬芯片 | 9,800 | 272,048.00 | 0.02 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 207 | 688031 | 星环科技 | 2,500 | 270,475.00 | 0.02 |
| 208 | 688191 | 智洋创新 | 8,300 | 267,094.00 | 0.02 |
| 209 | 300567 | 精测电子 | 2,900 | 264,480.00 | 0.02 |
| 210 | 600100 | 同方股份 | 28,900 | 257,788.00 | 0.02 |
| 211 | 688237 | 超卓航科 | 5,223 | 254,621.25 | 0.02 |
| 212 | 603126 | 中材节能 | 37,400 | 251,328.00 | 0.02 |
| 213 | 688362 | 甬矽电子 | 7,700 | 249,557.00 | 0.02 |
| 214 | 002593 | 日上集团 | 42,200 | 249,402.00 | 0.02 |
| 215 | 688166 | 博瑞医药 | 5,080 | 249,224.80 | 0.02 |
| 216 | 301048 | 金鹰重工 | 21,800 | 248,520.00 | 0.02 |
| 217 | 300328 | 宜安科技 | 14,500 | 247,515.00 | 0.02 |
| 218 | 603185 | 弘元绿能 | 8,000 | 244,000.00 | 0.02 |
| 219 | 301607 | 富特科技 | 6,000 | 240,660.00 | 0.02 |
| 220 | 601665 | 齐鲁银行 | 41,600 | 238,784.00 | 0.02 |
| 221 | 600380 | 健康元 | 20,600 | 237,930.00 | 0.02 |
| 222 | 300932 | 三友联众 | 19,500 | 233,805.00 | 0.01 |
| 223 | 600782 | 新钢股份 | 60,100 | 233,188.00 | 0.01 |
| 224 | 688372 | 伟测科技 | 2,100 | 229,089.00 | 0.01 |
| 225 | 002398 | 垒知集团 | 40,300 | 226,486.00 | 0.01 |
| 226 | 688506 | 百利天恒 | 700 | 226,170.00 | 0.01 |
| 227 | 301308 | 江波龙 | 900 | 220,356.00 | 0.01 |
| 228 | 600469 | 风神股份 | 31,400 | 217,916.00 | 0.01 |
| 229 | 688678 | 福立旺 | 9,011 | 217,885.98 | 0.01 |
| 230 | 688388 | 嘉元科技 | 5,300 | 217,194.00 | 0.01 |
| 231 | 300047 | 天源迪科 | 17,200 | 215,860.00 | 0.01 |
| 232 | 300553 | 集智股份 | 5,300 | 214,067.00 | 0.01 |
| 233 | 688202 | 美迪西 | 3,704 | 208,905.60 | 0.01 |
| 234 | 301026 | 浩通科技 | 7,300 | 206,882.00 | 0.01 |
| 235 | 300408 | 三环集团 | 4,500 | 205,875.00 | 0.01 |
| 236 | 601318 | 中国平安 | 3,000 | 205,200.00 | 0.01 |
| 237 | 300450 | 先导智能 | 4,100 | 204,918.00 | 0.01 |
| 238 | 688608 | 恒玄科技 | 900 | 204,246.00 | 0.01 |
| 239 | 000601 | 韶能股份 | 43,300 | 203,510.00 | 0.01 |
| 240 | 300980 | 祥源新材 | 6,200 | 202,306.00 | 0.01 |
| 241 | 301109 | 军信股份 | 13,400 | 201,000.00 | 0.01 |
| 242 | 688182 | 灿勤科技 | 6,800 | 200,736.00 | 0.01 |
| 243 | 300619 | 金银河 | 4,500 | 197,550.00 | 0.01 |
| 244 | 688219 | 会通股份 | 15,600 | 193,752.00 | 0.01 |
| 245 | 603259 | 药明康德 | 2,100 | 190,344.00 | 0.01 |
| 246 | 300049 | 福瑞医科 | 2,700 | 190,107.00 | 0.01 |
| 247 | 301511 | 德福科技 | 5,300 | 189,687.00 | 0.01 |
| 248 | 300759 | 康龙化成 | 6,600 | 187,638.00 | 0.01 |
| 249 | 688536 | 思瑞浦 | 1,161 | 185,620.68 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 250 | 300801 | 泰和科技 | 6,700 | 185,121.00 | 0.01 |
| 251 | 301518 | 长华化学 | 5,200 | 184,964.00 | 0.01 |
| 252 | 300503 | 昊志机电 | 2,900 | 184,788.00 | 0.01 |
| 253 | 300403 | 汉宇集团 | 12,800 | 184,448.00 | 0.01 |
| 254 | 688343 | 云天励飞 | 2,400 | 182,592.00 | 0.01 |
| 255 | 000933 | 神火股份 | 6,600 | 181,302.00 | 0.01 |
| 256 | 600258 | 首旅酒店 | 10,800 | 180,900.00 | 0.01 |
| 257 | 000755 | 山西高速 | 36,000 | 180,720.00 | 0.01 |
| 258 | 000910 | 大亚圣象 | 23,900 | 178,294.00 | 0.01 |
| 259 | 300240 | 飞力达 | 23,100 | 174,174.00 | 0.01 |
| 260 | 600282 | 南钢股份 | 33,100 | 174,106.00 | 0.01 |
| 261 | 600269 | 赣粤高速 | 32,900 | 170,751.00 | 0.01 |
| 262 | 300435 | 中泰股份 | 7,600 | 168,872.00 | 0.01 |
| 263 | 601818 | 光大银行 | 48,300 | 168,567.00 | 0.01 |
| 264 | 600704 | 物产中大 | 30,000 | 167,100.00 | 0.01 |
| 265 | 300515 | 三德科技 | 8,400 | 165,144.00 | 0.01 |
| 266 | 000421 | 南京公用 | 23,700 | 163,767.00 | 0.01 |
| 267 | 688012 | 中微公司 | 600 | 163,632.00 | 0.01 |
| 268 | 000729 | 燕京啤酒 | 14,500 | 162,835.00 | 0.01 |
| 269 | 300418 | 昆仑万维 | 3,900 | 162,630.00 | 0.01 |
| 270 | 601000 | 唐山港 | 42,300 | 162,432.00 | 0.01 |
| 271 | 688322 | 奥比中光 | 1,800 | 161,406.00 | 0.01 |
| 272 | 000157 | 中联重科 | 18,700 | 161,381.00 | 0.01 |
| 273 | 601999 | 出版传媒 | 23,300 | 160,071.00 | 0.01 |
| 274 | 000050 | 深天马 A | 17,700 | 159,831.00 | 0.01 |
| 275 | 301439 | 泓淋电力 | 10,600 | 158,046.00 | 0.01 |
| 276 | 600908 | 无锡银行 | 26,600 | 157,738.00 | 0.01 |
| 277 | 688084 | 晶品特装 | 1,900 | 157,320.00 | 0.01 |
| 278 | 300693 | 盛弘股份 | 4,100 | 156,948.00 | 0.01 |
| 279 | 300806 | 斯迪克 | 5,100 | 156,774.00 | 0.01 |
| 280 | 300548 | 长芯博创 | 1,100 | 156,200.00 | 0.01 |
| 281 | 300113 | 顺网科技 | 7,500 | 151,800.00 | 0.01 |
| 282 | 600971 | 恒源煤电 | 24,300 | 151,632.00 | 0.01 |
| 283 | 600075 | 新疆天业 | 30,400 | 150,480.00 | 0.01 |
| 284 | 301338 | 凯格精机 | 1,700 | 149,787.00 | 0.01 |
| 285 | 601518 | 吉林高速 | 52,900 | 149,178.00 | 0.01 |
| 286 | 300765 | 新诺威 | 4,100 | 147,887.00 | 0.01 |
| 287 | 301316 | 慧博云通 | 3,300 | 147,444.00 | 0.01 |
| 288 | 600598 | 北大荒 | 9,600 | 143,520.00 | 0.01 |
| 289 | 688128 | 中国电研 | 4,900 | 142,492.00 | 0.01 |
| 290 | 301382 | 蜂助手 | 4,000 | 141,760.00 | 0.01 |
| 291 | 688311 | 盟升电子 | 3,100 | 141,360.00 | 0.01 |
| 292 | 601368 | 绿城水务 | 28,400 | 140,864.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|--------|------------|------|
| 293 | 001389 | 广合科技 | 1,700 | 138,771.00 | 0.01 |
| 294 | 300999 | 金龙鱼 | 4,800 | 137,952.00 | 0.01 |
| 295 | 600519 | 贵州茅台 | 100 | 137,718.00 | 0.01 |
| 296 | 688458 | 美芯晟 | 3,467 | 137,431.88 | 0.01 |
| 297 | 002128 | 电投能源 | 4,900 | 136,759.00 | 0.01 |
| 298 | 600754 | 锦江酒店 | 5,400 | 136,458.00 | 0.01 |
| 299 | 300832 | 新产业 | 2,400 | 135,000.00 | 0.01 |
| 300 | 600999 | 招商证券 | 8,100 | 134,784.00 | 0.01 |
| 301 | 300708 | 聚灿光电 | 15,100 | 134,088.00 | 0.01 |
| 302 | 688131 | 皓元医药 | 1,800 | 129,744.00 | 0.01 |
| 303 | 002222 | 福晶科技 | 2,300 | 129,582.00 | 0.01 |
| 304 | 300485 | 赛升药业 | 12,200 | 129,076.00 | 0.01 |
| 305 | 688590 | 新致软件 | 6,700 | 125,022.00 | 0.01 |
| 306 | 603323 | 苏农银行 | 24,600 | 124,230.00 | 0.01 |
| 307 | 600526 | 菲达环保 | 23,100 | 123,816.00 | 0.01 |
| 308 | 300927 | 江天化学 | 5,300 | 123,543.00 | 0.01 |
| 309 | 601019 | 山东出版 | 14,200 | 122,688.00 | 0.01 |
| 310 | 688602 | 康鹏科技 | 13,900 | 120,652.00 | 0.01 |
| 311 | 600031 | 三一重工 | 5,700 | 120,441.00 | 0.01 |
| 312 | 301339 | 通行宝 | 8,200 | 119,228.00 | 0.01 |
| 313 | 002195 | 岩山科技 | 16,700 | 118,403.00 | 0.01 |
| 314 | 300136 | 信维通信 | 1,900 | 117,800.00 | 0.01 |
| 315 | 300378 | 鼎捷数智 | 2,600 | 117,676.00 | 0.01 |
| 316 | 300779 | 惠城环保 | 900 | 117,099.00 | 0.01 |
| 317 | 603008 | 喜临门 | 5,700 | 116,736.00 | 0.01 |
| 318 | 301358 | 湖南裕能 | 1,800 | 116,388.00 | 0.01 |
| 319 | 300719 | 安达维尔 | 6,400 | 115,904.00 | 0.01 |
| 320 | 688631 | 莱斯信息 | 1,700 | 115,736.00 | 0.01 |
| 321 | 300454 | 深信服 | 1,000 | 115,160.00 | 0.01 |
| 322 | 600309 | 万华化学 | 1,500 | 115,020.00 | 0.01 |
| 323 | 000100 | TCL 科技 | 24,800 | 112,592.00 | 0.01 |
| 324 | 002697 | 红旗连锁 | 18,900 | 112,266.00 | 0.01 |
| 325 | 002772 | 众兴菌业 | 7,500 | 109,425.00 | 0.01 |
| 326 | 300684 | 中石科技 | 2,200 | 108,284.00 | 0.01 |
| 327 | 300380 | 安硕信息 | 2,600 | 107,562.00 | 0.01 |
| 328 | 300409 | 道氏技术 | 4,700 | 105,703.00 | 0.01 |
| 329 | 300871 | 回盛生物 | 5,000 | 103,650.00 | 0.01 |
| 330 | 688377 | 迪威尔 | 2,800 | 102,760.00 | 0.01 |
| 331 | 003031 | 中瓷电子 | 1,400 | 102,424.00 | 0.01 |
| 332 | 600571 | 信雅达 | 6,400 | 101,632.00 | 0.01 |
| 333 | 002950 | 奥美医疗 | 9,300 | 101,556.00 | 0.01 |
| 334 | 601328 | 交通银行 | 14,000 | 101,500.00 | 0.01 |
| 335 | 600787 | 中储股份 | 17,800 | 100,036.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 336 | 301110 | 青木科技 | 1,500 | 99,270.00 | 0.01 |
| 337 | 300624 | 万兴科技 | 1,400 | 98,910.00 | 0.01 |
| 338 | 688108 | 赛诺医疗 | 5,135 | 98,797.40 | 0.01 |
| 339 | 002281 | 光迅科技 | 1,400 | 97,930.00 | 0.01 |
| 340 | 688591 | 泰凌微 | 2,300 | 97,888.00 | 0.01 |
| 341 | 600887 | 伊利股份 | 3,400 | 97,240.00 | 0.01 |
| 342 | 002811 | 郑中设计 | 6,500 | 96,460.00 | 0.01 |
| 343 | 300087 | 荃银高科 | 8,200 | 95,776.00 | 0.01 |
| 344 | 688778 | 厦钨新能 | 1,200 | 92,844.00 | 0.01 |
| 345 | 300696 | 爱乐达 | 2,900 | 92,539.00 | 0.01 |
| 346 | 002365 | 永安药业 | 6,200 | 92,504.00 | 0.01 |
| 347 | 300859 | 西域旅游 | 2,500 | 92,425.00 | 0.01 |
| 348 | 300858 | 科拓生物 | 5,500 | 92,235.00 | 0.01 |
| 349 | 300546 | 雄帝科技 | 3,500 | 91,665.00 | 0.01 |
| 350 | 000019 | 深粮控股 | 13,000 | 90,350.00 | 0.01 |
| 351 | 002614 | 奥佳华 | 12,200 | 89,182.00 | 0.01 |
| 352 | 003025 | 思进智能 | 6,200 | 89,094.00 | 0.01 |
| 353 | 301032 | 新柴股份 | 7,400 | 89,022.00 | 0.01 |
| 354 | 300920 | 润阳科技 | 1,900 | 87,533.00 | 0.01 |
| 355 | 300390 | 天华新能 | 1,600 | 87,376.00 | 0.01 |
| 356 | 601919 | 中远海控 | 5,700 | 86,526.00 | 0.01 |
| 357 | 688036 | 传音控股 | 1,300 | 86,008.00 | 0.01 |
| 358 | 300873 | 海晨股份 | 3,900 | 85,683.00 | 0.01 |
| 359 | 688136 | 科兴制药 | 2,700 | 85,509.00 | 0.01 |
| 360 | 000949 | 新乡化纤 | 15,500 | 85,250.00 | 0.01 |
| 361 | 002010 | 传化智联 | 14,600 | 84,826.00 | 0.01 |
| 362 | 002625 | 光启技术 | 1,700 | 82,892.00 | 0.01 |
| 363 | 301270 | 汉仪股份 | 2,200 | 82,236.00 | 0.01 |
| 364 | 301286 | 侨源股份 | 1,900 | 80,351.00 | 0.01 |
| 365 | 300458 | 全志科技 | 1,900 | 79,857.00 | 0.01 |
| 366 | 601126 | 四方股份 | 2,600 | 78,208.00 | 0.01 |
| 367 | 001286 | 陕西能源 | 8,400 | 78,204.00 | 0.01 |
| 368 | 600805 | 悦达投资 | 14,300 | 77,649.00 | 0.00 |
| 369 | 688661 | 和林微纳 | 1,500 | 77,640.00 | 0.00 |
| 370 | 000166 | 申万宏源 | 14,600 | 76,942.00 | 0.00 |
| 371 | 300310 | 宜通世纪 | 12,900 | 76,239.00 | 0.00 |
| 372 | 603367 | 辰欣药业 | 4,400 | 76,208.00 | 0.00 |
| 373 | 688312 | 燕麦科技 | 2,283 | 75,749.94 | 0.00 |
| 374 | 300065 | 海兰信 | 4,100 | 74,497.00 | 0.00 |
| 375 | 000555 | 神州信息 | 4,500 | 74,475.00 | 0.00 |
| 376 | 688098 | 申联生物 | 8,300 | 73,704.00 | 0.00 |
| 377 | 603496 | 恒为科技 | 2,700 | 73,656.00 | 0.00 |
| 378 | 688443 | 智翔金泰 | 2,700 | 73,548.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 379 | 300247 | 融捷健康 | 14,300 | 73,359.00 | 0.00 |
| 380 | 002734 | 利民股份 | 4,400 | 70,136.00 | 0.00 |
| 381 | 002242 | 九阳股份 | 6,700 | 69,948.00 | 0.00 |
| 382 | 002916 | 深南电路 | 300 | 69,687.00 | 0.00 |
| 383 | 688373 | 盟科药业 | 11,500 | 69,460.00 | 0.00 |
| 384 | 601038 | 一拖股份 | 4,900 | 69,433.00 | 0.00 |
| 385 | 002386 | 天原股份 | 12,700 | 68,961.00 | 0.00 |
| 386 | 600738 | 丽尚国潮 | 13,000 | 67,080.00 | 0.00 |
| 387 | 601166 | 兴业银行 | 3,100 | 65,286.00 | 0.00 |
| 388 | 600425 | 青松建化 | 15,600 | 64,896.00 | 0.00 |
| 389 | 300153 | 科泰电源 | 2,200 | 63,954.00 | 0.00 |
| 390 | 603708 | 家家悦 | 5,400 | 63,882.00 | 0.00 |
| 391 | 002023 | 海特高新 | 4,700 | 63,638.00 | 0.00 |
| 392 | 301021 | 英诺激光 | 1,300 | 63,245.00 | 0.00 |
| 393 | 002137 | 实益达 | 7,200 | 61,776.00 | 0.00 |
| 394 | 688428 | 诺诚健华 | 3,000 | 61,560.00 | 0.00 |
| 395 | 688656 | 浩欧博 | 400 | 61,520.00 | 0.00 |
| 396 | 600017 | 日照港 | 20,500 | 61,500.00 | 0.00 |
| 397 | 300489 | 光智科技 | 1,200 | 60,960.00 | 0.00 |
| 398 | 300124 | 汇川技术 | 800 | 60,264.00 | 0.00 |
| 399 | 002878 | 元隆雅图 | 3,300 | 60,126.00 | 0.00 |
| 400 | 000030 | 富奥股份 | 10,300 | 59,122.00 | 0.00 |
| 401 | 301000 | 肇民科技 | 1,500 | 59,055.00 | 0.00 |
| 402 | 688199 | 久日新材 | 2,500 | 58,925.00 | 0.00 |
| 403 | 300130 | 新国都 | 2,100 | 58,233.00 | 0.00 |
| 404 | 600590 | 泰豪科技 | 6,100 | 57,401.00 | 0.00 |
| 405 | 300988 | 津荣天宇 | 2,500 | 56,875.00 | 0.00 |
| 406 | 002404 | 嘉欣丝绸 | 8,100 | 56,781.00 | 0.00 |
| 407 | 600662 | 外服控股 | 11,300 | 56,726.00 | 0.00 |
| 408 | 603739 | 蔚蓝生物 | 4,000 | 56,600.00 | 0.00 |
| 409 | 002204 | 大连重工 | 7,300 | 55,845.00 | 0.00 |
| 410 | 300045 | 华力创通 | 1,900 | 54,929.00 | 0.00 |
| 411 | 300654 | 世纪天鸿 | 5,500 | 54,505.00 | 0.00 |
| 412 | 002414 | 高德红外 | 3,700 | 54,279.00 | 0.00 |
| 413 | 688475 | 萤石网络 | 1,800 | 54,198.00 | 0.00 |
| 414 | 300146 | 汤臣倍健 | 4,500 | 54,045.00 | 0.00 |
| 415 | 000993 | 闽东电力 | 4,500 | 53,910.00 | 0.00 |
| 416 | 002174 | 游族网络 | 4,400 | 53,856.00 | 0.00 |
| 417 | 603387 | 基蛋生物 | 6,400 | 53,568.00 | 0.00 |
| 418 | 688512 | 慧智微 | 4,800 | 53,568.00 | 0.00 |
| 419 | 300145 | 南方泵业 | 11,300 | 53,336.00 | 0.00 |
| 420 | 300140 | 节能环境 | 7,800 | 52,806.00 | 0.00 |
| 421 | 688660 | 电气风电 | 3,100 | 52,731.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 422 | 000060 | 中金岭南 | 8,900 | 52,065.00 | 0.00 |
| 423 | 300389 | 艾比森 | 3,200 | 51,936.00 | 0.00 |
| 424 | 000930 | 中粮科技 | 8,800 | 50,776.00 | 0.00 |
| 425 | 002755 | 奥赛康 | 3,100 | 50,623.00 | 0.00 |
| 426 | 688209 | 英集芯 | 2,500 | 49,850.00 | 0.00 |
| 427 | 002097 | 山河智能 | 4,000 | 49,640.00 | 0.00 |
| 428 | 301486 | 致尚科技 | 400 | 49,620.00 | 0.00 |
| 429 | 600346 | 恒力石化 | 2,200 | 49,566.00 | 0.00 |
| 430 | 300363 | 博腾股份 | 2,100 | 48,804.00 | 0.00 |
| 431 | 300041 | 回天新材 | 4,300 | 47,644.00 | 0.00 |
| 432 | 002358 | 森源电气 | 8,700 | 47,154.00 | 0.00 |
| 433 | 601083 | 锦江航运 | 4,200 | 46,872.00 | 0.00 |
| 434 | 688006 | 杭可科技 | 1,600 | 46,864.00 | 0.00 |
| 435 | 688456 | 有研粉材 | 600 | 46,620.00 | 0.00 |
| 436 | 601319 | 中国人保 | 5,200 | 46,540.00 | 0.00 |
| 437 | 300971 | 博亚精工 | 1,900 | 46,474.00 | 0.00 |
| 438 | 300283 | 温州宏丰 | 6,100 | 45,933.00 | 0.00 |
| 439 | 002312 | 川发龙蟒 | 4,200 | 45,906.00 | 0.00 |
| 440 | 300664 | 鹏鹞环保 | 8,500 | 45,560.00 | 0.00 |
| 441 | 300850 | 新强联 | 1,100 | 45,507.00 | 0.00 |
| 442 | 600288 | 大恒科技 | 3,000 | 44,940.00 | 0.00 |
| 443 | 600335 | 国机汽车 | 6,900 | 44,919.00 | 0.00 |
| 444 | 300651 | 金陵体育 | 2,200 | 44,836.00 | 0.00 |
| 445 | 688281 | 华秦科技 | 600 | 44,280.00 | 0.00 |
| 446 | 300341 | 麦克奥迪 | 2,700 | 44,118.00 | 0.00 |
| 447 | 002967 | 广电计量 | 2,000 | 44,020.00 | 0.00 |
| 448 | 301321 | 翰博高新 | 2,300 | 43,815.00 | 0.00 |
| 449 | 300036 | 超图软件 | 2,400 | 43,584.00 | 0.00 |
| 450 | 600785 | 新华百货 | 3,200 | 43,360.00 | 0.00 |
| 451 | 002153 | 石基信息 | 4,000 | 43,320.00 | 0.00 |
| 452 | 301507 | 民生健康 | 2,800 | 43,008.00 | 0.00 |
| 453 | 603986 | 兆易创新 | 200 | 42,850.00 | 0.00 |
| 454 | 300491 | 通合科技 | 1,700 | 42,721.00 | 0.00 |
| 455 | 002603 | 以岭药业 | 2,500 | 42,675.00 | 0.00 |
| 456 | 002101 | 广东鸿图 | 3,400 | 41,888.00 | 0.00 |
| 457 | 002626 | 金达威 | 2,100 | 41,391.00 | 0.00 |
| 458 | 300215 | 电科院 | 6,500 | 41,340.00 | 0.00 |
| 459 | 600774 | 汉商集团 | 4,500 | 41,130.00 | 0.00 |
| 460 | 300138 | 晨光生物 | 3,200 | 39,712.00 | 0.00 |
| 461 | 600808 | 马钢股份 | 9,400 | 39,668.00 | 0.00 |
| 462 | 688612 | 威迈斯 | 1,200 | 39,564.00 | 0.00 |
| 463 | 003012 | 东鹏控股 | 6,000 | 39,300.00 | 0.00 |
| 464 | 600739 | 辽宁成大 | 3,500 | 39,130.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 465 | 002317 | 众生药业 | 2,000 | 37,960.00 | 0.00 |
| 466 | 601899 | 紫金矿业 | 1,100 | 37,917.00 | 0.00 |
| 467 | 601991 | 大唐发电 | 10,700 | 37,343.00 | 0.00 |
| 468 | 688543 | 国科军工 | 600 | 37,242.00 | 0.00 |
| 469 | 300348 | 长亮科技 | 2,400 | 37,152.00 | 0.00 |
| 470 | 603967 | 中创物流 | 2,700 | 37,071.00 | 0.00 |
| 471 | 300940 | 南极光 | 1,300 | 36,998.00 | 0.00 |
| 472 | 600982 | 宁波能源 | 8,400 | 36,456.00 | 0.00 |
| 473 | 688516 | 奥特维 | 800 | 36,208.00 | 0.00 |
| 474 | 003015 | 日久光电 | 2,300 | 35,880.00 | 0.00 |
| 475 | 301095 | 广立微 | 500 | 35,855.00 | 0.00 |
| 476 | 301165 | 锐捷网络 | 400 | 35,520.00 | 0.00 |
| 477 | 600212 | 绿能慧充 | 4,400 | 35,420.00 | 0.00 |
| 478 | 000001 | 平安银行 | 3,100 | 35,371.00 | 0.00 |
| 479 | 301606 | 绿联科技 | 600 | 35,244.00 | 0.00 |
| 480 | 000811 | 冰轮环境 | 1,900 | 35,188.00 | 0.00 |
| 481 | 600126 | 杭钢股份 | 4,300 | 35,088.00 | 0.00 |
| 482 | 688167 | 炬光科技 | 200 | 35,014.00 | 0.00 |
| 483 | 002349 | 精华制药 | 4,800 | 34,848.00 | 0.00 |
| 484 | 002558 | 巨人网络 | 800 | 34,632.00 | 0.00 |
| 485 | 600278 | 东方创业 | 4,500 | 34,200.00 | 0.00 |
| 486 | 000589 | 贵州轮胎 | 6,600 | 34,188.00 | 0.00 |
| 487 | 600729 | 重庆百货 | 1,300 | 33,800.00 | 0.00 |
| 488 | 603115 | 海星股份 | 1,800 | 33,678.00 | 0.00 |
| 489 | 600602 | 云赛智联 | 1,800 | 33,642.00 | 0.00 |
| 490 | 600780 | 通宝能源 | 5,900 | 33,512.00 | 0.00 |
| 491 | 300018 | 中元股份 | 3,000 | 33,000.00 | 0.00 |
| 492 | 300787 | 海能实业 | 2,800 | 32,900.00 | 0.00 |
| 493 | 688356 | 键凯科技 | 400 | 32,880.00 | 0.00 |
| 494 | 002624 | 完美世界 | 2,000 | 32,780.00 | 0.00 |
| 495 | 301299 | 卓创资讯 | 600 | 32,628.00 | 0.00 |
| 496 | 601066 | 中信建投 | 1,200 | 32,124.00 | 0.00 |
| 497 | 001979 | 招商蛇口 | 3,700 | 31,968.00 | 0.00 |
| 498 | 300882 | 万胜智能 | 1,700 | 31,960.00 | 0.00 |
| 499 | 300244 | 迪安诊断 | 2,000 | 31,700.00 | 0.00 |
| 500 | 300400 | 劲拓股份 | 1,600 | 31,680.00 | 0.00 |
| 501 | 000830 | 鲁西化工 | 1,900 | 31,483.00 | 0.00 |
| 502 | 301305 | 朗坤科技 | 1,400 | 31,458.00 | 0.00 |
| 503 | 601881 | 中国银河 | 2,000 | 31,440.00 | 0.00 |
| 504 | 301052 | 果麦文化 | 800 | 30,552.00 | 0.00 |
| 505 | 002085 | 万丰奥威 | 1,900 | 30,419.00 | 0.00 |
| 506 | 603682 | 锦和商管 | 4,600 | 30,314.00 | 0.00 |
| 507 | 300304 | 云意电气 | 2,600 | 30,264.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-------|-----------|------|
| 508 | 600392 | 盛和资源 | 1,400 | 30,142.00 | 0.00 |
| 509 | 002292 | 奥飞娱乐 | 3,400 | 30,090.00 | 0.00 |
| 510 | 002803 | 吉宏股份 | 1,800 | 29,448.00 | 0.00 |
| 511 | 600027 | 华电国际 | 5,900 | 29,264.00 | 0.00 |
| 512 | 000039 | 中集集团 | 2,900 | 29,261.00 | 0.00 |
| 513 | 600366 | 宁波韵升 | 2,100 | 28,959.00 | 0.00 |
| 514 | 600461 | 洪城环境 | 3,100 | 28,737.00 | 0.00 |
| 515 | 300541 | 先进数通 | 1,900 | 28,614.00 | 0.00 |
| 516 | 300697 | 电工合金 | 1,700 | 28,526.00 | 0.00 |
| 517 | 002419 | 天虹股份 | 5,100 | 28,203.00 | 0.00 |
| 518 | 000651 | 格力电器 | 700 | 28,154.00 | 0.00 |
| 519 | 688720 | 艾森股份 | 400 | 28,152.00 | 0.00 |
| 520 | 300184 | 力源信息 | 2,800 | 27,972.00 | 0.00 |
| 521 | 300102 | 乾照光电 | 1,000 | 27,560.00 | 0.00 |
| 522 | 600097 | 开创国际 | 2,400 | 27,264.00 | 0.00 |
| 523 | 601699 | 潞安环能 | 2,300 | 27,140.00 | 0.00 |
| 524 | 300732 | 设研院 | 3,600 | 27,000.00 | 0.00 |
| 525 | 300473 | 德尔股份 | 900 | 26,802.00 | 0.00 |
| 526 | 000425 | 徐工机械 | 2,300 | 26,634.00 | 0.00 |
| 527 | 688819 | 天能股份 | 800 | 26,576.00 | 0.00 |
| 528 | 600115 | 中国东航 | 4,400 | 26,400.00 | 0.00 |
| 529 | 002399 | 海普瑞 | 2,200 | 25,938.00 | 0.00 |
| 530 | 600572 | 康恩贝 | 5,800 | 25,868.00 | 0.00 |
| 531 | 688088 | 虹软科技 | 517 | 25,591.50 | 0.00 |
| 532 | 002636 | 金安国纪 | 1,500 | 25,065.00 | 0.00 |
| 533 | 603013 | 亚普股份 | 1,000 | 24,670.00 | 0.00 |
| 534 | 688107 | 安路科技 | 900 | 24,462.00 | 0.00 |
| 535 | 600080 | 金花股份 | 3,200 | 24,128.00 | 0.00 |
| 536 | 301217 | 铜冠铜箔 | 700 | 23,996.00 | 0.00 |
| 537 | 002406 | 远东传动 | 3,000 | 23,820.00 | 0.00 |
| 538 | 002394 | 联发股份 | 1,500 | 23,790.00 | 0.00 |
| 539 | 600710 | 苏美达 | 2,200 | 23,782.00 | 0.00 |
| 540 | 601216 | 君正集团 | 4,900 | 23,618.00 | 0.00 |
| 541 | 603858 | 步长制药 | 1,500 | 23,460.00 | 0.00 |
| 542 | 002824 | 和胜股份 | 1,200 | 23,280.00 | 0.00 |
| 543 | 002560 | 通达股份 | 2,300 | 23,184.00 | 0.00 |
| 544 | 000539 | 粤电力 A | 5,200 | 22,984.00 | 0.00 |
| 545 | 603018 | 华设集团 | 3,000 | 22,830.00 | 0.00 |
| 546 | 300682 | 朗新科技 | 1,500 | 22,815.00 | 0.00 |
| 547 | 600478 | 科力远 | 3,300 | 22,737.00 | 0.00 |
| 548 | 603638 | 艾迪精密 | 1,200 | 22,716.00 | 0.00 |
| 549 | 300141 | 和顺电气 | 1,800 | 22,626.00 | 0.00 |
| 550 | 688153 | 唯捷创芯 | 600 | 22,584.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-------|-----------|------|
| 551 | 603987 | 康德莱 | 2,600 | 22,360.00 | 0.00 |
| 552 | 000501 | 武商集团 | 2,200 | 22,264.00 | 0.00 |
| 553 | 002931 | 锋龙股份 | 700 | 22,190.00 | 0.00 |
| 554 | 000725 | 京东方 A | 5,200 | 21,892.00 | 0.00 |
| 555 | 300942 | 易瑞生物 | 2,300 | 21,643.00 | 0.00 |
| 556 | 002246 | 北化股份 | 1,200 | 21,624.00 | 0.00 |
| 557 | 600094 | 大名城 | 5,100 | 21,216.00 | 0.00 |
| 558 | 300223 | 北京君正 | 200 | 21,208.00 | 0.00 |
| 559 | 002397 | 梦洁股份 | 5,200 | 20,956.00 | 0.00 |
| 560 | 601010 | 文峰股份 | 7,600 | 20,748.00 | 0.00 |
| 561 | 688515 | 裕太微 | 200 | 20,510.00 | 0.00 |
| 562 | 300399 | 天利科技 | 800 | 20,280.00 | 0.00 |
| 563 | 002981 | 朝阳科技 | 700 | 19,999.00 | 0.00 |
| 564 | 601187 | 厦门银行 | 2,700 | 19,818.00 | 0.00 |
| 565 | 000090 | 天健集团 | 5,300 | 19,610.00 | 0.00 |
| 566 | 600108 | 亚盛集团 | 6,200 | 19,530.00 | 0.00 |
| 567 | 300040 | 九洲集团 | 3,200 | 19,264.00 | 0.00 |
| 568 | 688183 | 生益电子 | 200 | 19,138.00 | 0.00 |
| 569 | 603681 | 永冠新材 | 1,000 | 18,980.00 | 0.00 |
| 570 | 002489 | 浙江永强 | 4,900 | 18,767.00 | 0.00 |
| 571 | 300269 | 联建光电 | 2,800 | 18,368.00 | 0.00 |
| 572 | 600104 | 上汽集团 | 1,200 | 18,264.00 | 0.00 |
| 573 | 002172 | 澳洋健康 | 4,500 | 17,865.00 | 0.00 |
| 574 | 601018 | 宁波港 | 4,900 | 17,787.00 | 0.00 |
| 575 | 000597 | 东北制药 | 3,400 | 17,748.00 | 0.00 |
| 576 | 600353 | 旭光电子 | 1,100 | 17,732.00 | 0.00 |
| 577 | 002324 | 普利特 | 1,100 | 17,589.00 | 0.00 |
| 578 | 002587 | 奥拓电子 | 2,600 | 17,576.00 | 0.00 |
| 579 | 002508 | 老板电器 | 900 | 17,415.00 | 0.00 |
| 580 | 603680 | 今创集团 | 1,100 | 16,951.00 | 0.00 |
| 581 | 300498 | 温氏股份 | 1,000 | 16,880.00 | 0.00 |
| 582 | 001376 | 百通能源 | 1,000 | 16,840.00 | 0.00 |
| 583 | 002946 | 新乳业 | 900 | 16,677.00 | 0.00 |
| 584 | 600150 | 中国船舶 | 500 | 16,630.00 | 0.00 |
| 585 | 002612 | 朗姿股份 | 800 | 16,352.00 | 0.00 |
| 586 | 002051 | 中工国际 | 1,800 | 16,326.00 | 0.00 |
| 587 | 300913 | 兆龙互连 | 300 | 15,789.00 | 0.00 |
| 588 | 600737 | 中粮糖业 | 900 | 15,489.00 | 0.00 |
| 589 | 002038 | 双鹭药业 | 2,100 | 15,477.00 | 0.00 |
| 590 | 603999 | 读者传媒 | 2,200 | 15,466.00 | 0.00 |
| 591 | 300001 | 特锐德 | 600 | 15,408.00 | 0.00 |
| 592 | 000932 | 华菱钢铁 | 2,700 | 15,174.00 | 0.00 |
| 593 | 000715 | 中兴商业 | 2,400 | 15,096.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 594 | 601956 | 东贝集团 | 2,100 | 14,973.00 | 0.00 |
| 595 | 600619 | 海立股份 | 700 | 14,770.00 | 0.00 |
| 596 | 300251 | 光线传媒 | 900 | 14,742.00 | 0.00 |
| 597 | 603556 | 海兴电力 | 400 | 14,560.00 | 0.00 |
| 598 | 601200 | 上海环境 | 1,800 | 14,490.00 | 0.00 |
| 599 | 300475 | 香农芯创 | 100 | 14,434.00 | 0.00 |
| 600 | 601890 | 亚星锚链 | 1,400 | 14,406.00 | 0.00 |
| 601 | 600416 | 湘电股份 | 900 | 14,202.00 | 0.00 |
| 602 | 002990 | 盛视科技 | 500 | 14,155.00 | 0.00 |
| 603 | 600748 | 上实发展 | 2,600 | 14,092.00 | 0.00 |
| 604 | 002254 | 泰和新材 | 1,400 | 14,028.00 | 0.00 |
| 605 | 601369 | 陕鼓动力 | 1,400 | 14,014.00 | 0.00 |
| 606 | 300224 | 正海磁材 | 900 | 13,914.00 | 0.00 |
| 607 | 002669 | 康达新材 | 900 | 13,680.00 | 0.00 |
| 608 | 002722 | 物产金轮 | 900 | 13,509.00 | 0.00 |
| 609 | 600517 | 国网英大 | 2,200 | 13,222.00 | 0.00 |
| 610 | 002364 | 中恒电气 | 500 | 13,220.00 | 0.00 |
| 611 | 301379 | 天山电子 | 500 | 12,925.00 | 0.00 |
| 612 | 301248 | 杰创智能 | 400 | 12,872.00 | 0.00 |
| 613 | 300346 | 南大光电 | 300 | 12,870.00 | 0.00 |
| 614 | 603181 | 皇马科技 | 900 | 12,861.00 | 0.00 |
| 615 | 002042 | 华孚时尚 | 3,000 | 12,750.00 | 0.00 |
| 616 | 603341 | 龙旗科技 | 300 | 12,678.00 | 0.00 |
| 617 | 002307 | 北新路桥 | 2,500 | 12,625.00 | 0.00 |
| 618 | 600479 | 千金药业 | 1,200 | 12,192.00 | 0.00 |
| 619 | 002912 | 中新赛克 | 400 | 12,056.00 | 0.00 |
| 620 | 688321 | 微芯生物 | 400 | 11,688.00 | 0.00 |
| 621 | 002573 | 清新环境 | 3,100 | 11,594.00 | 0.00 |
| 622 | 688327 | 云从科技 | 800 | 11,496.00 | 0.00 |
| 623 | 300921 | 南凌科技 | 500 | 11,485.00 | 0.00 |
| 624 | 688556 | 高测股份 | 1,000 | 11,420.00 | 0.00 |
| 625 | 002011 | 盾安环境 | 900 | 11,412.00 | 0.00 |
| 626 | 600873 | 梅花生物 | 1,100 | 11,143.00 | 0.00 |
| 627 | 601866 | 中远海发 | 4,400 | 11,088.00 | 0.00 |
| 628 | 300290 | 荣科科技 | 400 | 11,012.00 | 0.00 |
| 629 | 002286 | 保龄宝 | 1,200 | 10,728.00 | 0.00 |
| 630 | 600926 | 杭州银行 | 700 | 10,696.00 | 0.00 |
| 631 | 002090 | 金智科技 | 900 | 10,620.00 | 0.00 |
| 632 | 300602 | 飞荣达 | 300 | 9,948.00 | 0.00 |
| 633 | 301055 | 张小泉 | 500 | 9,805.00 | 0.00 |
| 634 | 002164 | 宁波东力 | 600 | 9,606.00 | 0.00 |
| 635 | 002521 | 齐峰新材 | 1,100 | 9,152.00 | 0.00 |
| 636 | 601800 | 中国交建 | 1,100 | 9,064.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 637 | 600761 | 安徽合力 | 400 | 8,356.00 | 0.00 |
| 638 | 000581 | 威孚高科 | 400 | 8,248.00 | 0.00 |
| 639 | 600968 | 海油发展 | 2,000 | 7,680.00 | 0.00 |
| 640 | 000785 | 居然智家 | 2,600 | 7,592.00 | 0.00 |
| 641 | 002273 | 水晶光电 | 300 | 7,536.00 | 0.00 |
| 642 | 603956 | 威派格 | 1,100 | 7,106.00 | 0.00 |
| 643 | 002675 | 东诚药业 | 500 | 6,870.00 | 0.00 |
| 644 | 600020 | 中原高速 | 1,600 | 6,816.00 | 0.00 |
| 645 | 600071 | 凤凰光学 | 300 | 6,450.00 | 0.00 |
| 646 | 300353 | 东土科技 | 300 | 6,108.00 | 0.00 |
| 647 | 002415 | 海康威视 | 200 | 5,968.00 | 0.00 |
| 648 | 600276 | 恒瑞医药 | 100 | 5,957.00 | 0.00 |
| 649 | 601678 | 滨化股份 | 1,300 | 5,512.00 | 0.00 |
| 650 | 000978 | 桂林旅游 | 700 | 5,068.00 | 0.00 |
| 651 | 002483 | 润邦股份 | 700 | 4,998.00 | 0.00 |
| 652 | 601238 | 广汽集团 | 600 | 4,896.00 | 0.00 |
| 653 | 002590 | 万安科技 | 300 | 4,500.00 | 0.00 |
| 654 | 002027 | 分众传媒 | 600 | 4,422.00 | 0.00 |
| 655 | 603530 | 神马电力 | 100 | 4,108.00 | 0.00 |
| 656 | 688371 | 菲沃泰 | 200 | 3,694.00 | 0.00 |
| 657 | 688549 | 中巨芯 | 400 | 3,648.00 | 0.00 |
| 658 | 002488 | 金固股份 | 400 | 3,516.00 | 0.00 |
| 659 | 300706 | 阿石创 | 100 | 3,393.00 | 0.00 |
| 660 | 603063 | 禾望电气 | 100 | 3,307.00 | 0.00 |
| 661 | 600638 | 新黄浦 | 500 | 3,235.00 | 0.00 |
| 662 | 000902 | 新洋丰 | 200 | 3,124.00 | 0.00 |
| 663 | 000792 | 盐湖股份 | 100 | 2,816.00 | 0.00 |
| 664 | 600023 | 浙能电力 | 500 | 2,475.00 | 0.00 |
| 665 | 688609 | 九联科技 | 26 | 265.46 | 0.00 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 300750 | 宁德时代 | 10,460,484.00 | 0.67 |
| 2 | 300308 | 中际旭创 | 4,091,321.00 | 0.26 |
| 3 | 300394 | 天孚通信 | 3,294,020.00 | 0.21 |
| 4 | 688256 | 寒武纪 | 2,675,122.83 | 0.17 |
| 5 | 300274 | 阳光电源 | 2,660,975.00 | 0.17 |
| 6 | 300502 | 新易盛 | 2,630,988.00 | 0.17 |
| 7 | 300433 | 蓝思科技 | 2,585,914.00 | 0.17 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 8 | 301017 | 漱玉平民 | 2,539,911.00 | 0.16 |
| 9 | 688041 | 海光信息 | 2,450,994.00 | 0.16 |
| 10 | 688981 | 中芯国际 | 2,423,371.22 | 0.16 |
| 11 | 300008 | 天海防务 | 2,274,558.00 | 0.15 |
| 12 | 688158 | 优刻得 | 2,181,518.42 | 0.14 |
| 13 | 688347 | 华虹公司 | 1,873,500.53 | 0.12 |
| 14 | 688249 | 晶合集成 | 1,859,443.32 | 0.12 |
| 15 | 688336 | 三生国健 | 1,829,280.89 | 0.12 |
| 16 | 300619 | 金银河 | 1,823,587.00 | 0.12 |
| 17 | 601398 | 工商银行 | 1,812,652.00 | 0.12 |
| 18 | 300760 | 迈瑞医疗 | 1,767,923.00 | 0.11 |
| 19 | 688183 | 生益电子 | 1,761,367.71 | 0.11 |
| 20 | 301150 | 中一科技 | 1,717,225.00 | 0.11 |

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1 | 301017 | 漱玉平民 | 2,990,067.00 | 0.19 |
| 2 | 688158 | 优刻得 | 2,004,453.51 | 0.13 |
| 3 | 688183 | 生益电子 | 1,862,091.32 | 0.12 |
| 4 | 300619 | 金银河 | 1,810,145.00 | 0.12 |
| 5 | 300442 | 润泽科技 | 1,701,468.00 | 0.11 |
| 6 | 300394 | 天孚通信 | 1,687,027.00 | 0.11 |
| 7 | 300228 | 富瑞特装 | 1,587,247.00 | 0.10 |
| 8 | 688249 | 晶合集成 | 1,526,225.68 | 0.10 |
| 9 | 688609 | 九联科技 | 1,498,996.33 | 0.10 |
| 10 | 301137 | 哈焊华通 | 1,457,427.00 | 0.09 |
| 11 | 688343 | 云天励飞 | 1,403,803.89 | 0.09 |
| 12 | 688699 | 明微电子 | 1,379,705.25 | 0.09 |
| 13 | 300979 | 华利集团 | 1,358,412.00 | 0.09 |
| 14 | 688298 | 东方生物 | 1,336,705.24 | 0.09 |
| 15 | 300045 | 华力创通 | 1,258,378.00 | 0.08 |
| 16 | 300207 | 欣旺达 | 1,254,568.00 | 0.08 |
| 17 | 300095 | 华伍股份 | 1,252,539.00 | 0.08 |
| 18 | 688088 | 虹软科技 | 1,235,529.68 | 0.08 |
| 19 | 688327 | 云从科技 | 1,229,007.79 | 0.08 |
| 20 | 300308 | 中际旭创 | 1,198,548.00 | 0.08 |

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。

8.4.3 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 | 422,710,935.34 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 243,302,232.00 |

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 23,668,045.75 | 1.52 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 517,968,938.90 | 33.19 |
| | 其中：政策性金融债 | 477,600,124.65 | 30.61 |
| 4 | 企业债券 | 87,368,315.62 | 5.60 |
| 5 | 企业短期融资券 | 60,137,468.49 | 3.85 |
| 6 | 中期票据 | 61,070,431.78 | 3.91 |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 750,213,200.54 | 48.07 |

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 230208 | 23 国开 08 | 1,000,000 | 103,575,808.22 | 6.64 |
| 2 | 250218 | 25 国开 18 | 800,000 | 80,230,553.42 | 5.14 |
| 3 | 220210 | 22 国开 10 | 400,000 | 43,397,501.37 | 2.78 |
| 4 | 210208 | 21 国开 08 | 400,000 | 40,706,454.79 | 2.61 |
| 5 | 250211 | 25 国开 11 | 400,000 | 40,191,145.21 | 2.58 |

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可投资国债期货。若本基金投资国债期货，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。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本产品审慎参与国债期货套保交易，旨在控制风险的同时实现收益加持。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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国家开发银行，及其分支行 2025 年 1 月至 2025 年 12 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、国家外汇管理局地方分局罚款、警示等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国农业发展银行，及其分支行 2025 年 1 月至 2025 年 12 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罚款、警示等。

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

8.12.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末无其他各项资产构成。

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 |
| 国泰海通稳健泰裕债券发起 A | 2,822 | 344,161.84 | 116,234,947.13 | 11.97% | 854,989,755.52 | 88.03% |
| 国泰海通稳健泰裕债券发起 C | 2,864 | 205,306.64 | 8,401,962.66 | 1.43% | 579,596,255.20 | 98.57% |
| 合计 | 5,686 | 274,221.41 | 124,636,909.79 | 7.99% | 1,434,586,010.72 | 92.01% |

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）。

9.2 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 | 国泰海通稳健泰裕债券发起 A | 218.77 | 0.0000% |
| | 国泰海通稳健泰裕债券发起 C | 50,200.10 | 0.0085% |
| | 合计 | 50,418.87 | 0.0032% |

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）。

9.3 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 | 国泰海通稳健泰裕债券发起 A | 0 |
| | 国泰海通稳健泰裕债券发起 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 国泰海通稳健泰裕债券发起 A | 0~10 |
| | 国泰海通稳健泰裕债券发起 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |

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。

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,009,389.28 | 0.64% | 10,009,389.28 | 0.64% | 自基金合同生效日起不少于3年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | 299.55 | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | 50,119.32 | - | - | - | - |
| 合计 | 10,059,808.1 | 0.64% | 10,009,389.2 | 0.64% | - |

| | | | | |
|--|---|--|---|--|
| | 5 | | 8 | |
|--|---|--|---|--|

注：其他为公司普通员工持有份额，持有期限为不低于 6 个月。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | 国泰海通稳健泰裕债券发起 A | 国泰海通稳健泰裕债券发起 C |
|------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2025 年 11 月 04 日）基金份额总额 | 971,224,702.65 | 587,998,217.86 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | - | - |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | - | - |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 971,224,702.65 | 587,998,217.86 |

注：本报告期内本基金份额无份额变动情况。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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：

2025 年 4 月 26 日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，陶耿同志担任公司董事长，谢乐斌同志不再担任公司董事长，生效日期为 2025 年 4 月 25 日。

2025 年 9 月 30 日，本基金管理人发布了《关于上海国泰海通证券资产管理有限公司监事变更的公告》，根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、公司章程（2025 年 7 月修订）规定，公司不再设职工监事，原公司第二届第二次职工代表大会选举产生的职工监事王红莲不再任公司职工监事。

2025 年 10 月 14 日，本基金管理人发布了《关于上海国泰海通证券资产管理有限公司监事变更的公告》，根据公司章程规定，经公司股东国泰海通证券股份有限公司研究决定，董博阳同志不再担任公司监事职务。

2025 年 12 月 25 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》，左秀海同志担任公司副总裁，生效日期为 2025 年 12 月 24 日。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

11.5 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。报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为 0.00 元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为自合同生效日至今。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用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 | |
| 国金证券股份有限公司 | 2 | 387,624,446.70 | 58.20% | 52,670.12 | 61.39% | - |
| 国泰海通证券股份有限公司 | 2 | 278,388,720.64 | 41.80% | 33,132.13 | 38.61% | - |

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。

11.7.2 基金租用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 | | 债券回购交易 | | 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 | 占当期债券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 |
| 国金证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国泰海通证券 | 1,328,827,931.52 | 100.00% | 4,809,000,000.00 | 100.00% | - | - | - | - |

| | | | | | | | | |
|----------------|--|--|--|--|--|--|--|--|
| 股份 有限 公司 | | | | | | | | |
|----------------|--|--|--|--|--|--|--|--|

11.8 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 | 国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金托管协议 | 证监会指定网站、公司官网 | 2025-09-30 |
| 2 | 国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金基金合同 | 证监会指定网站、公司官网 | 2025-09-30 |
| 3 | 国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要 | 证监会指定网站、公司官网 | 2025-09-30 |
| 4 | 国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要 | 证监会指定网站、公司官网 | 2025-09-30 |
| 5 | 国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金招募说明书 | 证监会指定网站、公司官网 | 2025-09-30 |
| 6 | 国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金合同及招募说明书提示性公告 | 上海证券报 | 2025-09-30 |
| 7 | 国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金基金份额发售公告 | 上海证券报、证监会指定网站、公司官网 | 2025-09-30 |
| 8 | 关于上海国泰海通证券资产管理有限公司监事变更的公告 | 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、上交所 | 2025-10-14 |
| 9 | 国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告 | 上海证券报、证监会指定网站、公司官网 | 2025-11-05 |
| 10 | 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、证监会指定网站、公司官网、上交所 | 2025-12-25 |
| 11 | 在本报告期内刊登的其他公告 | - | - |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰海通稳健泰裕债券型发起式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。

13.2 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>。

13.3 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
二〇二六年三月三十一日