

国泰海通君得诚混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:上海国泰海通证券资产管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....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.....7

2.4 信息披露方式7

2.5 其他相关资料7

§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....7

3.1 主要会计数据和财务指标.....7

3.2 基金净值表现8

§ 4 管理人报告9

4.1 基金管理人及基金经理情况9

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明10

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....10

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明11

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望11

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....11

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....12

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明12

§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	43
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44

§ 8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 盈利投资者数量占比	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	46
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	47
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	47
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	49
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰海通君得诚混合型证券投资基金
基金简称	国泰海通君得诚混合
基金主代码	952035
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 03 月 25 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	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	114,898,006.21 份
基金合同存续期	不定期

注：2025 年 7 月 25 日，上海国泰君安证券资产管理有限公司变更名称为上海国泰海通证券资产管理有限公司。国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划合同生效日为 2020 年 03 月 25 日。“国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划”于 2022 年 2 月 14 日起正式变更注册为“国泰君安君得诚混合型证券投资基金”。

国泰海通君得诚混合型证券投资基金由国泰君安君得诚混合型证券投资基金变更而来。国泰海通君得诚混合型证券投资基金基金合同生效日为 2025 年 9 月 29 日。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金利用基金管理人的研究优势，主要投资于具备持续增长能力的优秀企业，并通过宏观、 市场和价值分析，捕捉价值型公司（价值公司）的投资机会。 通过科学合理的资产配置和股票组合，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1、 资产配置策略 2、 股票投资策略 （1） 行业配置策略 （2） 公司股票精选策略 3、 组合调整策略 4、 股指期货、 国债期货交易策略 （1） 股指期货投资策略 （2） 国债期货投资策略 5、 债券的投资策略 （1） 利率策略 （2） 信用策略 （3） 债券选择策略 （4） 可转债的投资策略 6、 资产支持证券等品种投资策略

	7、股票期权的投资策略 8、港股投资策略
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×30%+恒生指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海国泰海通证券资产管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	张姗
	联系电话	95521	400-61-95555
	电子邮箱	zgxxpl@gtht.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95521	400-61-95555
传真		021-38871190	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200011	518040
法定代表人		陶耿	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	8,180,878.39
本期利润	1,094,403.75
加权平均基金份额本期利润	0.0085
本期加权平均净值利润率	0.99%
本期基金份额净值增长率	0.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）
期末可供分配利润	-5,146,145.95
期末可供分配基金份额利润	-0.0448
期末基金资产净值	97,033,880.18
期末基金份额净值	0.8445
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	-15.55%

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

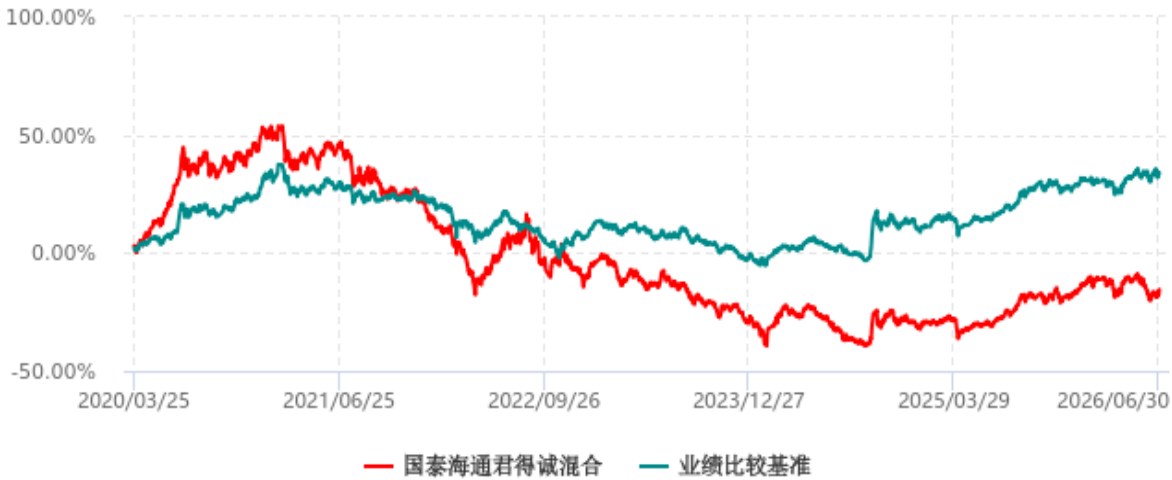
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.93%	1.48%	6.63%	0.83%	-3.70%	0.65%
过去六个月	0.49%	1.41%	4.11%	0.77%	-3.62%	0.64%
过去一年	18.64%	1.21%	15.52%	0.69%	3.12%	0.52%
过去三年	-6.12%	1.29%	25.15%	0.76%	-31.27%	0.53%
过去五年	-42.33%	1.36%	3.43%	0.78%	-45.76%	0.58%
自基金合同生效起至今	-15.55%	1.33%	33.89%	0.79%	-49.44%	0.54%

注：净值增长率、业绩比较基准收益率等相关数据和指标按国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划成立日至报告期末计算。

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

国泰海通君得诚混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年03月25日-2026年06月30日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

				限	
范杨	国泰海通君得鑫 2 年持有混合基金经理，国泰海通消费机遇混合发起基金经理，国泰海通君得诚混合基金经理，国泰海通港股优势精选股票发起（QDII）基金经理。现任权益投资部总经理助理，公募权益投资部基金经理。	2024-06-14	-	14 年	范杨，北京大学西方经济学硕士研究生，曾在上海申银万国证券研究所有限公司、瑞银证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、凯盛融英信息科技（上海）股份有限公司分别担任助理研究员、研究员、首席研究员、院长职务。2020 年 11 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任权益研究部副院长、常务副总经理，现任权益投资部总经理助理，公募权益投资部基金经理。

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 公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所有的投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 0 次。本基金与本公司管理的其他组合在不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)同向交

易的交易价差未出现异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年以极不平凡的局面开场：AI 产业快速发展形成了巨大的单一需求，形成全球范围内最明确的高景气方向；全球地缘环境在 2025 年的基础上变得更加不安，全球协作减少，效率降低，成本上行；传统产业面临需求不足，消费动力持续疲弱的问题。

基本面的 K 型分化对应着行业表现更大级别的 K 型分化。尽管上半年全 A 和沪深 300 均获得了约 7% 的正收益，但全 A 等权指数收益率为-1.2%，沪深所有股票的涨幅中位数约为-14%，港股通股票平均下跌 9%，中位数下跌约 18%。31 个一级行业中，电子行业上涨超过 80%，而表现最差的商贸零售行业则下跌近 30%。

在每一轮牛熊中，估值都是景气度的放大器，本轮科技走强、消费走弱同样适用。长期来看，价值回归的底层逻辑是在基本面景气度的再平衡过程中，估值的也会实现再平衡。本产品力图在变化的市场中通过均衡配置实现稳健成长，避免在单一赛道过度暴露的风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰海通君得诚混合基金份额净值为 0.8445 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 0.49%，同期业绩比较基准收益率为 4.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认同科技引领社会发展的共识，AI 是目前全球稀缺的高确定性成长赛道。因此我们积极配置科技行业，重点放在预期和估值相对合理，基本面可信度、可验证度较高的半导体行业。随着科技板块的预期、估值和交易拥挤度的持续提升至历史偏高水平，我们也非常关注潜在的基本面和交易风险，因此在仓位上选择保持相对均衡的配置。当前时点，我们认为国产算力相关的风险收益比更好，并尝试从更具性价比的半导体设备、端侧、软件等领域发现新的可能性。

尽管市场对消费板块仍处于悲观预期之中，特别是伊朗局势动荡时，市场对大消费的展望更加谨慎。但考虑足够低的估值水平和交易拥挤度，我们仍旧保留了部分消费仓位。好消息是，虽然尚未观察到消费动力的全面好转的信号，但我们自下而上开始能够找到一些基本面编辑好转的细分行业和个股，这是行业供需格局好转的初期信号，我们会持续关注并尝试把握相关的机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰海通君得诚混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	11,328,510.73	9,100,404.71
结算备付金		747,052.43	126,657.32
存出保证金		53,808.10	35,350.01
交易性金融资产	6.4.7.2	87,950,108.45	109,055,506.46
其中：股票投资		87,950,108.45	109,055,506.46
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证 券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.3	-	-
应收清算款		-	44,891.16
应收股利		153,207.31	-
应收申购款		15,013.06	1,822.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.4	-	-
资产总计		100,247,700.08	118,364,631.92
负 债 和 净 资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,578,966.63	2,115.45
应付赎回款		152,121.19	140,827.11
应付管理人报酬		97,157.77	119,550.52
应付托管费		16,192.95	19,925.09
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	369,381.36	217,707.95
负债合计		3,213,819.90	500,126.12
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	88,640,480.60	108,200,932.65
未分配利润	6.4.7.7	8,393,399.58	9,663,573.15
净资产合计		97,033,880.18	117,864,505.80
负债和净资产总计		100,247,700.08	118,364,631.92

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8445 元，基金份额总额 114,898,006.21 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰海通君得诚混合型证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		1,959,938.35	1,490,371.75
1. 利息收入		17,592.81	29,045.80
其中：存款利息收入	6.4.7.8	17,592.19	29,045.80
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		0.62	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,027,165.53	622,948.73
其中：股票投资收益	6.4.7.9	8,609,963.50	-1,007,826.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.10	417,202.03	1,630,774.93
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.11	-7,086,474.64	836,386.83
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	1,654.65	1,990.39
减：二、营业总支出		865,534.60	954,157.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	661,380.65	737,127.48

2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	110, 230. 11	122, 854. 56
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 13	93, 923. 84	94, 175. 45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1, 094, 403. 75	536, 214. 26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1, 094, 403. 75	536, 214. 26
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1, 094, 403. 75	536, 214. 26

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰海通君得诚混合型证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	108, 200, 932. 65	9, 663, 573. 15	117, 864, 505. 80
二、本期期初净资产	108, 200, 932. 65	9, 663, 573. 15	117, 864, 505. 80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-19, 560, 452. 05	-1, 270, 173. 57	-20, 830, 625. 62
（一）、综合收益总额	-	1, 094, 403. 75	1, 094, 403. 75
（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）	-19, 560, 452. 05	-2, 364, 577. 32	-21, 925, 029. 37
其中：1. 基金申购款	1, 299, 208. 57	174, 464. 31	1, 473, 672. 88

2. 基金赎回款	-20,859,660.62	-2,539,041.63	-23,398,702.25
(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	88,640,480.60	8,393,399.58	97,033,880.18
项 目	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	144,844,231.34	-12,028,892.27	132,815,339.07
二、本期期初净资产	144,844,231.34	-12,028,892.27	132,815,339.07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-14,638,637.96	1,956,608.08	-12,682,029.88
(一)、综合收益总额	-	536,214.26	536,214.26
(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）	-14,638,637.96	1,420,393.82	-13,218,244.14
其中：1. 基金申购款	371,640.54	-41,348.26	330,292.28
2. 基金赎回款	-15,010,278.50	1,461,742.08	-13,548,536.42
(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	130,205,593.38	-10,072,284.19	120,133,309.19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

叶明	叶明	王红莲
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰海通君得诚混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）由国泰君安君得诚混合型证券投资基金变更而来。国泰君安君得诚混合型证券投资基金由国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划变更而来。国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划由国泰君安君得稳一号集合资产管理计划变更而来。本基金的基金合同于 2022 年 2 月 14 日正式生效。本基金为契约型开放式。

国泰君安君得稳一号集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，自 2013 年 2 月 19 日开始募集，于 2013 年 2 月 21 日结束募集工作，并于 2013 年 2 月 27 日成立。2013 年 5 月 31 日，国泰君安君得稳一号集合资产管理计划取得《关于上海国泰君安证券资产管理有限公司发起设立国泰君安君得稳一号集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函〔2013〕941 号）。

根据《基金法》、《运作办法》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等法律法规的规定及《国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划资产管理合同》的约定，国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划变更为国泰君安君得诚混合型证券投资基金，即本基金，并相应修改《国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划资产管理合同》等法律文件，2021 年 11 月 8 日，本基金经中国证监会《关于准予国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划变更注册的批复》（证监许可〔2021〕3516 号文）注册。

2025 年 7 月 25 日，上海国泰君安证券资产管理有限公司变更名称为上海国泰海通证券资产管理有限公司。2025 年 9 月 29 日，国泰君安君得诚混合型证券投资基金变更为国泰海通君得诚混合型证券投资基金，《国泰海通君得诚混合型证券投资基金基金合同》自基金管理人公告的生效之日起生效，原《国泰君安君得诚混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、股指期货、国债期货、股票期权、债券（含国债、金融债、可转换债券、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债、可交换债券、可分离交易债券的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产比例为 50%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×30%+恒生指数收益率×10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

基金目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

7.4.6.1 增值税

根据财政部和国家税务总局 2017 年 6 月 30 日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，通知自 2018 年 1 月 1 日起施行。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，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。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

7.4.6.2 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财税 2023 第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，对证券（股票）交易印花税实施减半征收。

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

7.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，股权的股息、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。

7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转

让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	11,328,510.73
等于：本金	11,327,567.92
加：应计利息	942.81
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	11,328,510.73

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	84,529,487.38	-	87,950,108.45	3,420,621.07
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	84,529,487.38	-	87,950,108.45	3,420,621.07

6.4.7.3 买入返售金融资产

6.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.3.2 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。

6.4.7.4 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.17
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	257,193.37
其中：交易所市场	257,193.37
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	43,380.45
预提账户维护费	9,300.00
合计	369,381.36

6.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	140,252,940.76	108,200,932.65
本期申购	1,684,091.17	1,299,208.57
本期赎回（以“-”号填列）	-27,039,025.72	-20,859,660.62
本期末	114,898,006.21	88,640,480.60

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含份额转出份（金）额。

6.4.7.7 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-13,601,211.95	23,264,785.10	9,663,573.15
本期期初	-13,601,211.95	23,264,785.10	9,663,573.15
本期利润	8,180,878.39	-7,086,474.64	1,094,403.75
本期基金份额交易产生的变动数	274,187.61	-2,638,764.93	-2,364,577.32
其中：基金申购款	-12,132.58	186,596.89	174,464.31
基金赎回款	286,320.19	-2,825,361.82	-2,539,041.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,146,145.95	13,539,545.53	8,393,399.58

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	14,998.69
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,517.42
其他	76.08
合计	17,592.19

6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	553,743,132.45
减：卖出股票成本总额	544,168,023.63
减：交易费用	965,145.32
买卖股票差价收入	8,609,963.50

6.4.7.10 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
----	--

股票投资产生的股利收益	417,202.03
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	417,202.03

6.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-7,086,474.64
——股票投资	-7,086,474.64
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——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	-7,086,474.64

6.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	1,650.93
转换费收入	3.72
合计	1,654.65

6.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	14,380.45
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,436.02

账户维护费	18,600.00
合计	93,923.84

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海国泰海通证券资产管理有限公司 (以下简称“国泰海通资管”)	基金管理人
招商银行股份有限公司(以下简称 “招商银行”)	基金托管人、代销机构
国泰海通证券股份有限公司(以下简 称“国泰海通证券”)	基金管理人的股东、代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
国泰海通证券	1,083,892,232.71	100.00%	287,068,488.91	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券	503,091.36	100.00%	257,193.37	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券	133,724.83	100.00%	61,024.69	100.00%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	661,380.65	737,127.48
其中：应支付销售机构的客户维护费	328,957.19	366,799.83
应支付基金管理人的净管理费	332,423.46	370,327.65

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理费=前一日基金资产净值*1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	110,230.11	122,854.56

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值*0.20%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	11,328,510.73	14,998.69	15,329,656.76	28,196.84

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须做说明的其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行股份有限公司，与该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；本基金在场外申赎基金份额均通过具有基金销售资格的金融机构进行，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2025 年 12 月 31 日：本基金未持有信用类债券)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及

《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持证券均在证券交易所交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金、结算备付金。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,328,510.73	-	-	-	11,328,510.73
结算备付金	747,052.43	-	-	-	747,052.43
存出保证金	53,808.10	-	-	-	53,808.10
交易性金融资产	-	-	-	87,950,108.45	87,950,108.45
应收股利	-	-	-	153,207.31	153,207.31
应收申购款	-	-	-	15,013.06	15,013.06
资产总计	12,129,371.26	-	-	88,118,328.82	100,247,700.08
负债					
应付清算款	-	-	-	2,578,966.63	2,578,966.63
应付赎回款	-	-	-	152,121.19	152,121.19
应付管理人报酬	-	-	-	97,157.77	97,157.77
应付托管费	-	-	-	16,192.95	16,192.95
其他负债	-	-	-	369,381.36	369,381.36
负债总计	-	-	-	3,213,819.90	3,213,819.90
利率敏感度缺口	12,129,371.26	-	-	84,904,508.92	97,033,880.18
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	9,100,404.71	-	-	-	9,100,404.71
结算备付金	126,657.32	-	-	-	126,657.32
存出保证金	35,350.01	-	-	-	35,350.01
交易性金融资产	-	-	-	109,055,506.46	109,055,506.46
应收清算款	-	-	-	44,891.16	44,891.16
应收申购款	-	-	-	1,822.26	1,822.26
资产总计	9,262,412.04	-	-	109,102,219.88	118,364,631.92
负债					

应付清算款	-	-	-	2,115.45	2,115.45
应付赎回款	-	-	-	140,827.11	140,827.11
应付管理人 报酬	-	-	-	119,550.52	119,550.52
应付托管费	-	-	-	19,925.09	19,925.09
其他负债	-	-	-	217,707.95	217,707.95
负债总计	-	-	-	500,126.12	500,126.12
利率敏感度 缺口	9,262,412.04	-	-	108,602,093.7 6	117,864,505.8 0

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例 0.00%(2025 年 12 月 31 日:0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	13,521,434.8 7	-	13,521,434.8 7
应收股利	-	153,207.31	-	153,207.31
资产合计	-	13,674,642.1 8	-	13,674,642.1 8
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	13,674,642.1	-	13,674,642.1

		8		8
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	23,741,421.56	-	23,741,421.56
资产合计	-	23,741,421.56	-	23,741,421.56
以外币计价的负债				
负债合计	-	0.00	-	0.00
资产负债表外汇风险敞口净额	-	23,741,421.56	-	23,741,421.56

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	(1) 假设本基金的单一外币汇率变化 1%，其他变量不变；(2) 此项影响未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动；(3) 计算外汇风险敏感性时，包含了远期外汇敞口		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	港币相对人民币贬值 1%	-136,746.42	-237,414.22
	港币相对人民币升值 1%	136,746.42	237,414.22

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净	公允价值	占基金资产净

		值比例(%)		值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	87,950,108.45	90.64	109,055,506.46	92.53
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	87,950,108.45	90.64	109,055,506.46	92.53

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 6.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 （单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注 6.4.1) 上升 5%	6,692,656.63	7,666,746.73
	业绩比较基准(附注 6.4.1) 下降 5%	-6,692,656.63	-7,666,746.73

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	87,950,108.45	109,055,506.46
第二层次	—	—
第三层次	—	—

合计	87,950,108.45	109,055,506.46
----	---------------	----------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	87,950,108.45	87.73
	其中：股票	87,950,108.45	87.73
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,075,563.16	12.05
8	其他各项资产	222,028.47	0.22
9	合计	100,247,700.08	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 13,521,434.87 元，占期末净值的比例为 13.93%；通过转融通证券出借业务的证券公允价值为 0.00 元，占资产净值的比例为 0.00%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,788,408.00	2.87
C	制造业	42,425,067.09	43.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	16,889,459.00	17.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,325,739.49	12.70
J	金融业	-	-
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	74,428,673.58	76.70

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
工业	5,650,938.76	5.82

信息技术	7,870,496.11	8.11
合计	13,521,434.87	13.93

注：以上分类采用全球行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	601058	赛轮轮胎	486,800	5,612,804.00	5.78
2	603061	金海通	10,985	5,516,886.70	5.69
3	00981	中芯国际	58,500	4,542,429.65	4.68
4	600029	南方航空	588,200	3,046,876.00	3.14
4	01055	中国南方航空股份	486,000	1,430,970.87	1.47
5	601111	中国国航	532,600	3,222,230.00	3.32
5	00753	中国国航	294,848	1,085,822.58	1.12
6	688120	华海清科	12,930	4,165,787.40	4.29
7	688018	乐鑫科技	30,290	3,874,696.80	3.99
8	600115	中国东航	578,300	2,203,323.00	2.27
8	00670	中国东方航空股份	432,000	1,185,674.98	1.22
9	00148	建滔集团	32,500	3,328,066.46	3.43
10	002928	华夏航空	461,400	3,225,186.00	3.32
11	688213	思特威	29,509	3,159,528.63	3.26
12	688661	和林微纳	19,186	3,050,190.28	3.14
13	300001	特锐德	78,800	2,981,004.00	3.07
14	688041	海光信息	7,755	2,871,676.50	2.96
15	688692	达梦数据	11,609	2,835,962.61	2.92
16	002683	广东宏大	95,200	2,788,408.00	2.87
17	002468	申通快递	187,400	2,728,544.00	2.81
18	600233	圆通速递	156,400	2,463,300.00	2.54
19	688256	寒武纪	1,539	2,455,551.45	2.53
20	688719	爱科赛博	30,867	2,376,759.00	2.45
21	002832	比音勒芬	97,700	2,016,528.00	2.08
22	03898	时代电气	56,000	1,948,470.33	2.01
23	603049	中策橡胶	42,721	1,914,328.01	1.97
24	603757	大元泵业	25,200	1,909,152.00	1.97
25	605080	浙江自然	91,100	1,754,586.00	1.81
26	688608	恒玄科技	9,618	1,608,033.42	1.66
27	300480	光力科技	34,500	1,472,460.00	1.52
28	688233	神工股份	6,709	1,438,543.78	1.48

29	002805	丰元股份	44,200	1,263,678.00	1.30
30	300327	中颖电子	30,100	964,705.00	0.99
31	688627	精智达	1,335	954,525.00	0.98
32	688596	正帆科技	7,000	553,420.00	0.57

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入 金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002928	华夏航空	12,963,913.00	11.00
2	601111	中国国航	12,312,068.00	10.45
3	688717	艾罗能源	10,914,042.89	9.26
4	688041	海光信息	8,984,092.14	7.62
5	600115	中国东航	8,782,349.00	7.45
6	002384	东山精密	8,750,530.10	7.42
7	600029	南方航空	8,454,704.00	7.17
8	601058	赛轮轮胎	8,393,140.00	7.12
9	000338	潍柴动力	7,944,792.00	6.74
10	600754	锦江酒店	7,663,895.00	6.50
11	688052	纳芯微	7,282,524.66	6.18
12	603061	金海通	7,217,794.00	6.12
13	688213	思特威	7,004,934.19	5.94
14	300480	光力科技	6,822,452.00	5.79
15	600686	金龙汽车	6,616,510.00	5.61
16	09995	荣昌生物	6,386,553.16	5.42
17	01055	中国南方航空 股份	5,979,010.98	5.07
18	002555	三七互娱	5,945,562.00	5.04
19	688416	恒烁股份	5,819,102.52	4.94
20	300373	扬杰科技	5,769,269.00	4.89
21	600233	圆通速递	5,608,793.00	4.76
22	300014	亿纬锂能	5,579,258.00	4.73
23	601021	春秋航空	5,453,124.06	4.63
24	688309	恒誉环保	5,435,322.20	4.61
25	688621	阳光诺和	5,331,826.73	4.52
26	002558	巨人网络	5,203,756.00	4.42
27	688692	达梦数据	5,170,051.32	4.39

28	002984	森麒麟	4,895,917.00	4.15
29	002468	申通快递	4,894,536.00	4.15
30	300433	蓝思科技	4,868,148.00	4.13
31	600584	长电科技	4,746,531.00	4.03
32	002812	恩捷股份	4,690,220.00	3.98
33	603334	丰倍生物	4,652,666.72	3.95
34	600763	通策医疗	4,632,243.60	3.93
35	605117	德业股份	4,616,299.00	3.92
36	300347	泰格医药	4,538,897.00	3.85
37	603606	东方电缆	4,502,411.00	3.82
38	688661	和林微纳	4,490,214.64	3.81
39	300438	鹏辉能源	4,478,744.00	3.80
40	603885	吉祥航空	4,353,843.00	3.69
41	688521	芯原股份	4,349,325.09	3.69
42	688372	伟测科技	4,322,848.55	3.67
43	688169	石头科技	4,234,238.90	3.59
44	00981	中芯国际	4,187,173.57	3.55
45	688519	南亚新材	4,150,012.36	3.52
46	00670	中国东方航空股份	4,133,941.73	3.51
47	01860	汇量科技	4,130,135.52	3.50
48	605116	奥锐特	4,128,242.00	3.50
49	603031	安孚科技	4,088,537.00	3.47
50	300207	欣旺达	4,082,253.00	3.46
51	002870	香山股份	4,078,202.00	3.46
52	300358	楚天科技	4,077,622.00	3.46
53	688726	拉普拉斯	4,029,615.79	3.42
54	09988	阿里巴巴-W	3,957,960.00	3.36
55	00753	中国国航	3,744,689.41	3.18
56	00700	腾讯控股	3,699,742.62	3.14
57	300285	国瓷材料	3,569,846.24	3.03
58	300782	卓胜微	3,541,247.00	3.00
59	300623	捷捷微电	3,524,986.00	2.99
60	688018	乐鑫科技	3,517,861.80	2.98
61	688063	派能科技	3,491,355.27	2.96
62	688556	高测股份	3,487,057.85	2.96
63	601231	环旭电子	3,484,249.00	2.96
64	300671	富满微	3,455,041.00	2.93
65	603986	兆易创新	3,439,874.00	2.92
66	002185	华天科技	3,429,886.00	2.91
67	603092	德力佳	3,353,412.00	2.85
68	03931	中创新航	3,301,793.27	2.80
69	301193	家联科技	3,261,911.00	2.77

70	300737	科顺股份	3,230,636.00	2.74
71	688472	阿特斯	3,199,824.45	2.71
72	688256	寒武纪	3,178,452.00	2.70
73	002683	广东宏大	3,134,880.00	2.66
74	300001	特锐德	3,105,175.00	2.63
75	605499	东鹏饮料	3,056,699.00	2.59
76	002475	立讯精密	3,056,409.00	2.59
77	02128	中国联塑	3,035,255.49	2.58
78	600026	中远海能	2,978,544.00	2.53
79	688120	华海清科	2,967,556.90	2.52
80	688172	燕东微	2,920,824.82	2.48
81	688398	赛特新材	2,920,104.29	2.48
82	01024	快手-W	2,868,691.13	2.43
83	300316	晶盛机电	2,788,395.00	2.37
84	00425	敏实集团	2,753,634.97	2.34
85	000973	佛塑科技	2,731,561.00	2.32
86	688135	利扬芯片	2,688,219.63	2.28
87	300751	迈为股份	2,638,702.00	2.24
88	00268	金蝶国际	2,444,362.55	2.07
89	00148	建滔集团	2,421,500.20	2.05
90	688595	芯海科技	2,404,309.59	2.04
91	603049	中策橡胶	2,391,614.80	2.03
92	600958	东方证券	2,389,595.00	2.03
93	688719	爱科赛博	2,379,517.39	2.02
94	002929	润建股份	2,366,371.00	2.01

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出 金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002984	森麒麟	12,938,098.00	10.98
2	002384	东山精密	12,477,650.56	10.59
3	688717	艾罗能源	11,605,157.19	9.85
4	688416	恒烁股份	10,946,604.80	9.29
5	601231	环旭电子	10,785,493.00	9.15
6	600686	金龙汽车	10,739,874.00	9.11

			0	
7	688052	纳芯微	8,832,764.44	7.49
8	002928	华夏航空	8,729,851.00	7.41
9	601111	中国国航	8,485,540.00	7.20
10	688169	石头科技	8,393,036.78	7.12
11	002714	牧原股份	8,046,891.76	6.83
12	000338	潍柴动力	7,983,620.00	6.77
13	601058	赛轮轮胎	7,522,090.00	6.38
14	600754	锦江酒店	7,008,665.00	5.95
15	603061	金海通	6,792,840.20	5.76
16	300347	泰格医药	6,578,519.00	5.58
17	688041	海光信息	6,456,597.96	5.48
18	603031	安孚科技	6,298,743.00	5.34
19	688726	拉普拉斯	5,905,994.95	5.01
20	09995	荣昌生物	5,617,993.43	4.77
21	688398	赛特新材	5,591,132.91	4.74
22	600309	万华化学	5,586,946.00	4.74
23	300373	扬杰科技	5,530,849.00	4.69
24	002812	恩捷股份	5,494,351.00	4.66
25	300433	蓝思科技	5,468,003.00	4.64
26	600115	中国东航	5,302,801.00	4.50
27	600060	海信视像	5,205,655.75	4.42
28	601021	春秋航空	5,143,066.00	4.36
29	603334	丰倍生物	5,091,495.67	4.32
30	00700	腾讯控股	5,064,536.55	4.30
31	605117	德业股份	5,059,809.00	4.29
32	300014	亿纬锂能	4,933,612.00	4.19
33	688372	伟测科技	4,924,123.04	4.18
34	300480	光力科技	4,912,664.00	4.17
35	600029	南方航空	4,698,537.00	3.99
36	002558	巨人网络	4,687,560.00	3.98
37	688309	恒誉环保	4,678,733.96	3.97
38	002555	三七互娱	4,585,785.00	3.89
39	688621	阳光诺和	4,559,412.29	3.87
40	688521	芯原股份	4,531,568.79	3.84
41	02333	长城汽车	4,504,309.21	3.82
42	603606	东方电缆	4,459,103.00	3.78
43	600026	中远海能	4,449,212.00	3.77
44	688519	南亚新材	4,424,754.80	3.75
45	603885	吉祥航空	4,334,630.00	3.68
46	300438	鹏辉能源	4,331,502.00	3.67
47	600584	长电科技	4,313,055.00	3.66
48	003006	百亚股份	4,279,456.00	3.63

49	09858	优然牧业	4,236,927.68	3.59
50	600426	华鲁恒升	4,205,008.00	3.57
51	688213	思特威	4,180,640.19	3.55
52	600763	通策医疗	4,051,736.99	3.44
53	002100	天康生物	3,968,934.00	3.37
54	002870	香山股份	3,954,032.00	3.35
55	300207	欣旺达	3,839,490.00	3.26
56	605116	奥锐特	3,827,702.00	3.25
57	01860	汇量科技	3,813,845.84	3.24
58	002185	华天科技	3,737,165.00	3.17
59	300737	科顺股份	3,728,662.00	3.16
60	01378	中国宏桥	3,715,429.97	3.15
61	688063	派能科技	3,700,528.05	3.14
62	603986	兆易创新	3,524,056.00	2.99
63	300358	楚天科技	3,490,614.00	2.96
64	688172	燕东微	3,429,409.42	2.91
65	300285	国瓷材料	3,387,317.00	2.87
66	603092	德力佳	3,355,226.30	2.85
67	300782	卓胜微	3,319,765.00	2.82
68	688556	高测股份	3,237,075.46	2.75
69	300001	特锐德	3,147,412.00	2.67
70	09988	阿里巴巴-W	3,077,788.01	2.61
71	688472	阿特斯	3,077,787.59	2.61
72	601600	中国铝业	3,076,018.50	2.61
73	000973	佛塑科技	3,047,137.00	2.59
74	300316	晶盛机电	2,993,793.00	2.54
75	03931	中创新航	2,983,748.31	2.53
76	300623	捷捷微电	2,947,990.00	2.50
77	688123	聚辰股份	2,905,886.09	2.47
78	02145	上美股份	2,808,666.63	2.38
79	300671	富满微	2,779,086.00	2.36
80	02899	紫金矿业	2,767,047.56	2.35
81	002475	立讯精密	2,755,161.00	2.34
82	00425	敏实集团	2,701,605.15	2.29
83	301193	家联科技	2,631,711.75	2.23
84	603049	中策橡胶	2,628,005.00	2.23
85	605499	东鹏饮料	2,617,790.90	2.22
86	00670	中国东方航空股份	2,599,388.92	2.21
87	01055	中国南方航空股份	2,585,867.68	2.19
88	01024	快手-W	2,507,265.62	2.13
89	300138	晨光生物	2,493,463.00	2.12

90	688135	利扬芯片	2,469,429.70	2.10
91	00175	吉利汽车	2,460,910.93	2.09
92	688595	芯海科技	2,455,911.90	2.08
93	002156	通富微电	2,412,758.00	2.05
94	300751	迈为股份	2,404,512.00	2.04
95	600141	兴发集团	2,399,329.00	2.04
96	300861	美畅股份	2,392,267.00	2.03

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	530,149,100.26
卖出股票收入（成交）总额	553,743,132.45

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

在股指期货投资上，本基金以套期保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率，并利用股指期货流动性较好的特点对冲基金的流动性风险，如大额申购赎回等。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

在风险可控的前提下，本基金将本着谨慎原则适度参与国债期货投资。本基金参与国债期货交易以套期保值为主要目的，运用国债期货对冲风险。本基金将根据对债券现货市场和期货市场的分析，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，发挥国债期货杠杆效应和流动性较好的特点，灵活运用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲收益率曲线平坦、陡峭等形态变化的风险、对冲关键期限利率波动的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金持有的前十名证券发行主体乐鑫信息科技(上海)股份有限公司，2026 年 6 月因信息披露被上海证券交易所、证监会分局警示。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	53,808.10

2	应收清算款	-
3	应收股利	153,207.31
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,013.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	222,028.47

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
2,648	43,390.49	3,990,724.71	3.47%	110,907,281.50	96.53%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	98.63%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,040,594.01	0.9057%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 03 月 25 日）基金份额总额	33,122,666.91
本报告期期初基金份额总额	140,252,940.76
本报告期基金总申购份额	1,684,091.17
减：本报告期基金总赎回份额	27,039,025.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	114,898,006.21

注：基金总申购份额含红利再投资及转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

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

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

2、本报告期内本基金托管人专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人受稽查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人相关从业人员受稽查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰海通证券	2	1,083,892,232.71	100.00%	503,091.36	100.00%	-

注：本基金为原券商资管大集合产品参公改造而成，因政策原因，仅能与本基金管理人（上海

国泰海通证券资产管理有限公司）之母公司（国泰海通证券股份有限公司）签订交易单元租用协议，租用其交易单元进行证券交易。后续如果相关政策放开，本基金将按照监管要求，租用多个证券公司交易单元进行证券交易。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰海通君得诚混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-01-22
2	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年 4 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2026-01-22
3	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于旗下公募基金在直销柜台开通基金转换业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2026-02-09
4	国泰海通君得诚混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2026-02-13
5	国泰海通君得诚混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2026 年第 1 号）	证监会指定网站、公司官网	2026-02-13
6	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	证监会指定网站、公司官网	2026-03-28
7	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	2026-03-24
8	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2026-03-31
9	国泰海通君得诚混合型证券投资基金 2025 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-03-31
10	国泰海通君得诚混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-04-22
11	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2026-04-22
12	关于上海国泰海通证券资产管理有限公司吸收合并上海海通证券资产管理有限公司重要事项的公告	证监会指定网站、公司官网	2026-04-30
13	关于上海国泰海通证券资产管理有限公司吸	上海证券报、中国	2026-05-06

	收合并上海海通证券资产管理有限公司重要事项的公告	证券报、证券时报、证券日报	
14	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于旗下公募基金产品在直销平台实施认购及申购费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2026-05-22
15	在本报告期内刊登的其他公告	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划变更注册的批复；
- 2、《国泰海通君得诚混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰海通君得诚混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰海通君得诚混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、法律意见书；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站
<https://www.gthtzg.com>。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

上海国泰海通证券资产管理有限公司

二〇二六年八月三十一日