

国泰海通君得盈债券型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:上海国泰海通证券资产管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....1

1.1 重要提示.....1

1.2 目录.....2

§ 2 基金简介6

2.1 基金基本情况6

2.2 基金产品说明6

2.3 基金管理人和基金托管人.....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.....8

3.2 基金净值表现8

§ 4 管理人报告.....11

4.1 基金管理人及基金经理情况11

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明12

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....12

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明13

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望14

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....14

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....14

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明15

§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	69
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	70
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	70
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	70
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
7.12 投资组合报告附注	70

§ 8 基金份额持有人信息	72
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
8.3 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 开放式基金份额变动	73
§ 10 重大事件揭示	74
10.1 基金份额持有人大会决议	74
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	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
10.4 基金投资策略的改变	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	74
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	75
10.8 其他重大事件	75
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	76
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	77
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§ 12 备查文件目录	77
12.1 备查文件目录	77
12.2 存放地点	78
12.3 查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰海通君得盈债券型证券投资基金		
基金简称	国泰海通君得盈债券		
基金主代码	952020		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021 年 01 月 28 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	3,060,879,312.79 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	国泰海通君得盈债券 A	国泰海通君得盈债券 C	国泰海通君得盈债券 D
下属分级基金的交易代码	952020	952320	023210
报告期末下属分级基金的份额总额	2,123,725,391.74 份	304,848,120.73 份	632,305,800.32 份

注：2025 年 7 月 25 日，上海国泰君安证券资产管理有限公司变更名称为上海国泰海通证券资产管理有限公司。国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划合同生效日为 2021 年 1 月 28 日。“国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划”于 2022 年 1 月 17 日起正式变更为“国泰君安君得盈债券型证券投资基金”。国泰海通君得盈债券型证券投资基金由国泰君安君得盈债券型证券投资基金变更而来。国泰海通君得盈债券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	本基金以固定收益品种为主要投资对象，在以资产安全性为优先考虑的前提下，力争获取风险控制下更高的稳健收益。
投资策略	本基金将在资产配置策略的基础上，通过固定收益类品种投资策略构筑债券组合的平稳收益。 1、资产配置策略 本基金将研究与跟踪中国宏观经济运行状况和资本市场变动特征，依据定量分析和定性分析相结合的方法，考虑经济环境、政策取向、类别资产收益风险预期等因素，采取“自上而下”的方法将基金资产在债券与股票等资产类别之间进行动态资产配置。 本基金将在稳健的资产配置策略基础上，根据股票的运行状况和收益预期，在严格控制风险的基础上，积极并适时适度地参与权益类资产配置，把握市场时机力争为基金资产获取增强型回报。

	2、固定收益品种投资策略 本基金将采取利率策略、信用策略、债券选择策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，以实现组合增值的目标。 本基金投资策略还包括：杠杆投资策略、国债期货投资策略、股票投资策略。
业绩比较基准	中债综合财富指数收益率×70%+一年定期存款税后利率×20%+沪深 300 指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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）		
	国泰海通君得盈债券 A	国泰海通君得盈债券 C	国泰海通君得盈债券 D
本期已实现收益	120,481,385.01	5,939,910.74	13,819,689.90
本期利润	207,330,017.96	12,027,787.68	19,927,894.78
加权平均基金份额本期利润	0.1036	0.1123	0.0820
本期加权平均净值利润率	9.36%	10.24%	7.26%
本期基金份额净值增长率	9.68%	9.47%	9.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）		
	国泰海通君得盈债券 A	国泰海通君得盈债券 C	国泰海通君得盈债券 D
期末可供分配利润	153,037,607.91	20,372,149.35	70,983,599.64
期末可供分配基金份额利润	0.0721	0.0668	0.1123
期末基金资产净值	2,387,663,728.44	340,817,353.89	736,810,837.63
期末基金份额净值	1.1243	1.1180	1.1653
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）		
	国泰海通君得盈债券 A	国泰海通君得盈债券 C	国泰海通君得盈债券 D
基金份额累计净值增长率	16.97%	14.56%	15.99%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰海通君得盈债券 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	7.96%	0.59%	2.09%	0.13%	5.87%	0.46%
过去六个月	9.68%	0.57%	2.37%	0.12%	7.31%	0.45%
过去一年	14.76%	0.45%	3.97%	0.11%	10.79%	0.34%
过去三年	15.33%	0.31%	13.15%	0.11%	2.18%	0.20%

过去五年	14.77%	0.29%	17.65%	0.11%	-2.88%	0.18%
自基金合同生效起至今	16.97%	0.28%	18.69%	0.11%	-1.72%	0.17%

国泰海通君得盈债券 C 净值表现

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	7.87%	0.59%	2.09%	0.13%	5.78%	0.46%
过去六个月	9.47%	0.57%	2.37%	0.12%	7.10%	0.45%
过去一年	14.31%	0.45%	3.97%	0.11%	10.34%	0.34%
过去三年	13.96%	0.31%	13.15%	0.11%	0.81%	0.20%
过去五年	12.49%	0.29%	17.65%	0.11%	-5.16%	0.18%
自基金合同生效起至今	14.56%	0.28%	19.49%	0.11%	-4.93%	0.17%

注：国泰海通君得盈债券 C 类份额首次确认日为 2021 年 3 月 9 日。

国泰海通君得盈债券 D 净值表现

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	7.95%	0.59%	2.09%	0.13%	5.86%	0.46%
过去六个月	9.63%	0.57%	2.37%	0.12%	7.26%	0.45%
过去一年	14.33%	0.45%	3.97%	0.11%	10.36%	0.34%
自基金合同生效起至今	15.99%	0.38%	5.12%	0.10%	10.87%	0.28%

注：国泰海通君得盈债券 D 类份额首次确认日为 2025 年 1 月 24 日。

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

国泰海通君得盈债券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
(2021年01月28日-2026年06月30日)



国泰海通君得盈债券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
(2021年03月09日-2026年06月30日)



注：国泰海通君得盈债券C类份额首次确认日为2021年3月9日。

国泰海通君得盈债券D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01月24日-2026年06月30日)



注：国泰海通君得盈债券 D 类份额首次确认日为 2025 年 1 月 24 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	说明
		任职日期	离任		

			日期	业 年 限	
刘晟	国泰海通中证 1000 指数增强基金经理，国泰海通君得盈债券基金经理，国泰海通新锐量化选股混合基金经理，国泰海通中证全指指数增强基金经理。现任量化投资部（公募）基金经理。	2025-09-09	-	4 年	刘晟，北京大学金融学硕士研究生。2021 年 7 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任权益与衍生品部量化研究员助理，量化投资部研究员助理、投资助理，现任量化投资部（公募）基金经理，主要从事领域 Alpha 因子和模型的研究工作。
朱莹	国泰海通 1 年定开债券发起式基金经理，国泰海通安弘六个月定开债券基金经理，国泰海通安平一年定开债券发起基金经理，国泰海通君得盛债券基金经理，国泰海通安睿纯债债券基金经理，国泰海通稳债增利债券发起基金经理，国泰海通稳健添利债券基金经理，国泰海通君得盈债券基金经理。现任多资产策略投资部（公募组）基金经理。	2025-09-09	-	5 年	朱莹，上海财经大学经济学学士、国际商务硕士、北卡罗莱纳大学夏洛特分校数理金融硕士、FRM。历任上海东证期货衍生品研究院高级金融工程分析师；2020 年 9 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任固定收益部研究员、投资经理助理、固定收益投资部（公募）基金经理，现任本公司多资产策略投资部（公募组）基金经理，主要从事债券投资研究工作。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规、相关规定以及基金合同、招募说明书约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法违规行为及违反基金合同、招募说明书约定的行为，无侵害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，中国经济延续了“新旧动能转换”的格局，整体呈现“外需强于内需、新动能强于旧动能”的 K 型分化特征。一季度经济实现“开门红”，主要指标回暖，工业增加值稳步抬升，出口保持强劲，PMI 在 3 月回到荣枯线以上，二季度经济动能边际放缓，主要受房地产投资持续低迷、居民消费意愿修复缓慢以及外部贸易环境不确定性上升的影响。通胀方面受国际原油价格上行影响，PPI 同比明显走高。货币政策“适度宽松”基调未变，但二季度更加重视“精准调控”，财政支出则有所放缓。整体而言，经济复苏动能仍不均衡，内需修复依赖政策持续发力，外部地缘政治风险与大宗商品价格波动为宏观环境增添了不确定性。

在市场方面，2026 年上半年 A 股整体震荡上行，但月度节奏与结构明显分化。一季度初受益于春季躁动、政策偏暖和科技成长主线，风险偏好较高；2 月受海外利率偏紧、美债收益率走高和获利回吐影响，市场震荡整固，节后在宏观数据偏强和政策预期修复下，科技成长、资源品与部分顺周期方向轮动活跃。3 月受中东地缘冲突升级、能源价格攀升和美联储降息预期后移冲击，风险偏好快速下降，贵金属、煤炭、公用事业等防御方向阶段性占优。二季度市场逐步修复，稳定资本市场、支持新质生产力和科技创新的政策取向，叠加业绩验证，带动风险偏好回升。5 月结构性分化加剧，机会向 AI 算力、半导体、通信、电子、先进制造等产业趋势明确的方向集中。6 月转为高位波动，受海外流动性预期和半年末资金压力影响，资金面维持紧平衡。总体而言，上半年科技成长、硬科技和部分先进制造表现突出，传统消费、金融及红利类资产相对承压，市场机会主要由产业趋势、盈利预期和资金偏好共同驱动。债券市场方面，一季度资金面总体偏宽松，中短端收益率下行，收益率曲线趋于陡峭，信用利差有所压缩，超长债经历先强后弱的波动；二季度 4 月资金面极度宽松推动收益率下行，5 月至 6 月资金利率逐步向政策利率回归，债券市场出现短期调整，但由于信贷需求和内需偏弱，收益率整体仍呈震荡下行。

报告期内，本基金权益投资坚持采用量化投资策略，以中证 A500 指数为基准目标，主要配置中证 A500 指数增强策略，并针对 A 股市场的结构性分化，辅助配置红利增强与双创增强的哑铃型量化策略。在运作层面，坚持基本面与量价信号相结合的多因子量化框架，严格控制行业与风格暴露，在降低跟踪误差的同时力求获取稳定的超额收益。量化策略在市场轮动和震荡环境中保持运作纪律，避免受到短期市场情绪干扰，致力于通过长期积累增强收益。报告期内，本基金在债券投资方面以银行二级资本债配置为主，组合久期中性。

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盈债券 A 基金份额净值为 1.1243 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 9.68%，同期业绩比较基准收益率为 2.37%；截至报告期末国泰海通君得盈债券 C 基金份额净值为 1.1180 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 9.47%，同期业绩比较基准收益率为 2.37%；截至报告期末国泰海通君得盈债券 D 基金份额净值为 1.1653 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 9.63%，同期业绩比较基准收益率为 2.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，预计中国经济将延续新旧动能转换的“K 型分化”格局，总体呈现温和复苏态势。权益市场结构性行情或将延续，中证 A500 覆盖的各细分行业龙头仍具备长期配置价值，科技创新、先进制造、创新药等方向有望受益于产业升级和盈利改善，同时需关注市场拥挤、外部扰动和国内需求修复节奏。权益组合将继续以中证 A500 指数增强为基础，灵活配置红利和双创增强策略，根据不同市场分域的风险收益特征动态调整配置，严格控制行业和风格暴露。债券市场大概率呈现震荡偏强格局，利率中枢低位运行，但波动可能加大。债券组合将继续配置银行二级资本债和利率债，保持中性久期，关注资金面、经济基本面、政府债供求以及权益市场风险偏好变化。

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

本报告期内本基金共进行了 1 次收益分配：

于 2026 年 5 月 15 日对国泰海通君得盈债券 A 每 10 份基金份额派发红利 0.480 元，对国泰海通君得盈债券 C 每 10 份基金份额派发红利 0.300 元，对国泰海通君得盈债券 D 每 10 份基金份额派发红利 0.030 元。

上述分红符合相关法律法规及《基金合同》约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰海通君得盈债券型证券投资基金

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	126,241,306.09	62,502,550.44
结算备付金		7,954,221.02	56,102,617.30
存出保证金		222,489.26	191,265.49
交易性金融资产	6.4.7.2	4,201,062,970.47	2,590,007,711.85
其中：股票投资		1,387,251,090.43	876,531,081.36
基金投资		-	-
债券投资		2,813,811,880.04	1,713,476,630.49
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		6,303,786.98	-
应收股利		-	-
应收申购款		78,035.23	16,530.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.4	-	-
资产总计		4,341,862,809.05	2,708,820,676.00
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		850,260,169.86	630,115,130.85
应付清算款		21,726,486.10	2,662,544.50
应付赎回款		261,042.04	98,047.07
应付管理人报酬		1,611,192.57	1,050,077.45
应付托管费		268,532.10	175,012.90
应付销售服务费		166,643.35	4,220.35
应付投资顾问费		-	-
应交税费		32,394.09	7,512.10
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	2,244,428.98	1,930,917.80
负债合计		876,570,889.09	636,043,463.02
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	3,060,879,312.79	1,937,945,286.27
未分配利润	6.4.7.7	404,412,607.17	134,831,926.71
净资产合计		3,465,291,919.96	2,072,777,212.98
负债和净资产总计		4,341,862,809.05	2,708,820,676.00

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 3,060,879,312.79 份。其中国泰海通君得盈债券 A 基金份额净值 1.1243 元，基金份额总额 2,123,725,391.74 份；国泰海通君得盈债券 C 基金份额净值 1.1180 元，基金份额总额 304,848,120.73 份；国泰海通君得盈债券 D 基金份额净值 1.1653 元，基金份额总额 632,305,800.32 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰海通君得盈债券型证券投资基金

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		254,136,770.60	569,024.40
1. 利息收入		285,524.52	11,171.03
其中：存款利息收入	6.4.7.8	257,471.63	11,171.03
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		28,052.89	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		154,801,414.77	1,143,622.87
其中：股票投资收益	6.4.7.9	121,143,067.98	-619,845.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	24,438,073.15	1,628,638.96
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-109,078.82
股利收益	6.4.7.11	9,220,273.64	243,908.00
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	99,044,714.77	-597,537.61
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	5,116.54	11,768.11

减：二、营业总支出		14,851,070.18	554,735.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,722,623.80	250,618.13
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,287,103.89	41,769.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	357,813.90	78,942.76
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		5,360,929.99	104,475.45
其中：卖出回购金融资产支出		5,360,929.99	104,475.45
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		11,918.06	2,421.33
8. 其他费用	6.4.7.14	110,680.54	76,507.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		239,285,700.42	14,289.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		239,285,700.42	14,289.23
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		239,285,700.42	14,289.23

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰海通君得盈债券型证券投资基金

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	1,937,945,286.27	134,831,926.71	2,072,777,212.98
二、本期期初净资产	1,937,945,286.27	134,831,926.71	2,072,777,212.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,122,934,026.52	269,580,680.46	1,392,514,706.98
（一）、综合收益总额	-	239,285,700.42	239,285,700.42
（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）	1,122,934,026.52	135,533,339.17	1,258,467,365.69

“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	1,604,058,478.04	193,863,133.52	1,797,921,611.56
2. 基金赎回款	-481,124,451.52	-58,329,794.35	-539,454,245.87
(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）	-	-105,238,359.13	-105,238,359.13
四、本期期末净资产	3,060,879,312.79	404,412,607.17	3,465,291,919.96
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	89,007,842.00	1,112,611.44	90,120,453.44
二、本期期初净资产	89,007,842.00	1,112,611.44	90,120,453.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,507,339.38	-49,288.23	-10,556,627.61
(一)、综合收益总额	-	14,289.23	14,289.23
(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）	-10,507,339.38	-63,577.46	-10,570,916.84
其中：1. 基金申购款	2,127,947.37	-7,923.55	2,120,023.82
2. 基金赎回款	-12,635,286.75	-55,653.91	-12,690,940.66
(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	78,500,502.62	1,063,323.21	79,563,825.83

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

国泰海通君得盈债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）由国泰君安君得盈债券型证券投资基金变更而来。国泰君安君得盈债券型证券投资基金由国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划变更而来。国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划由国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划变更而来。本基金为契约型开放式。

国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划，于 2011 年 6 月 14 日经中国证监会证监许可[2011]941 号文核准设立，自 2011 年 8 月 22 日起开始募集，于 2011 年

9 月 16 日结束募集工作，并于 2011 年 9 月 22 日正式成立。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 30 日发布的《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》（证监会公告〔2018〕39 号）的规定，国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更，《国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划资产管理合同》自 2021 年 1 月 28 日起生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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》（证监会公告〔2018〕39 号）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等规定及中国证监会《关于准予国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划变更注册的批复》（证监许可〔2021〕4085 号），国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划于 2022 年 1 月 17 日起正式变更为国泰君安君得盈债券型证券投资基金。

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，国泰君安君得盈债券型证券投资基金变更为国泰海通君得盈债券型证券投资基金，《国泰海通君得盈债券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《国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。

本基金的基金管理人为上海国泰海通证券资产管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《国泰海通君得盈债券型证券投资基金基金合同》，本基金根据申购费、销售服务费收取方式等不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的份额类别，称为 A 类份额；在投资者申购时不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的份额类别，称为 C 类份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰海通君得盈债券型证券投资基金基金合同》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（包含主板、创业板及其他依法发行上市的股票）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可转换债券、可交换债券、可分离交易债券、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、国债期货等，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：债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；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，保留的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。本基金投资的信用债评级 AA+（含 AA+）以上，其中投资于评级 AA+ 的信用债比例不超过基金信用债资产的 50%；投资评级 AAA 的信用债比例不低于基金信用债资产的 50%。若无债项评级或者债项评级为 A-1 的，则以主体评级为准。本产品投资的信用债需有评级满足上述要求。本基金投资于可转换债券、可交换债券、可分离交易债券的比例不超过基金资产的 20%。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：中债综合财富指数收益率 $\times$ 70%+一年定期存款税后利率 $\times$ 20%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 中期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 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 日的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2016]36号《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《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《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。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，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。

(2) 对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。

(3) 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。对基金从上市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。

(4) 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 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，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	126,241,306.09
等于：本金	126,224,893.77
加：应计利息	16,412.32
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	126,241,306.09

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		1,294,559,732.92	-	1,387,251,090.43	92,691,357.51
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	14,926,119.37	86,252.06	15,083,252.06	70,880.63
	银行间市场	2,743,079,203.01	25,069,377.98	2,798,728,627.98	30,580,046.99
	合计	2,758,005,322.38	25,155,630.04	2,813,811,880.04	30,650,927.62
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,052,565,055.30	25,155,630.04	4,201,062,970.47	123,342,285.13

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	0.75
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,154,873.15
其中：交易所市场	2,119,094.40
银行间市场	35,778.75
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	20,747.71
预提账户维护费	9,300.00
合计	2,244,428.98

6.4.7.6 实收基金

国泰海通君得盈债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,925,792,327.72	1,925,792,327.72
本期申购	206,902,482.57	206,902,482.57
本期赎回（以“-”号填列）	-8,969,418.55	-8,969,418.55
本期末	2,123,725,391.74	2,123,725,391.74

国泰海通君得盈债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,099,857.74	12,099,857.74
本期申购	359,007,892.23	359,007,892.23
本期赎回（以“-”号填列）	-66,259,629.24	-66,259,629.24
本期末	304,848,120.73	304,848,120.73

国泰海通君得盈债券 D

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	53,100.81	53,100.81
本期申购	1,038,148,103.24	1,038,148,103.24
本期赎回（以“-”号填列）	-405,895,403.73	-405,895,403.73
本期末	632,305,800.32	632,305,800.32

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.7 未分配利润

国泰海通君得盈债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	115,235,604.52	18,997,436.99	134,233,041.51
本期期初	115,235,604.52	18,997,436.99	134,233,041.51
本期利润	120,481,385.01	86,848,632.95	207,330,017.96
本期基金份额交易产生的变动数	17,172,010.91	5,054,658.85	22,226,669.76
其中：基金申购款	17,942,285.70	5,359,803.58	23,302,089.28
基金赎回款	-770,274.79	-305,144.73	-1,075,419.52
本期已分配利润	-99,851,392.53	-	-99,851,392.53
本期末	153,037,607.91	110,900,728.79	263,938,336.70

国泰海通君得盈债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	479,703.23	115,693.79	595,397.02
本期期初	479,703.23	115,693.79	595,397.02
本期利润	5,939,910.74	6,087,876.94	12,027,787.68
本期基金份额交易产生的变动数	18,419,007.33	9,393,513.08	27,812,520.41
其中：基金申购款	22,560,690.37	12,476,230.06	35,036,920.43
基金赎回款	-4,141,683.04	-3,082,716.98	-7,224,400.02

本期已分配利润	-4,466,471.95	-	-4,466,471.95
本期末	20,372,149.35	15,597,083.81	35,969,233.16

国泰海通君得盈债券 D

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	2,931.29	556.89	3,488.18
本期期初	2,931.29	556.89	3,488.18
本期利润	13,819,689.90	6,108,204.88	19,927,894.78
本期基金份额交易产生的变动数	58,081,473.10	27,412,675.90	85,494,149.00
其中：基金申购款	97,582,135.74	37,941,988.07	135,524,123.81
基金赎回款	-39,500,662.64	-10,529,312.17	-50,029,974.81
本期已分配利润	-920,494.65	-	-920,494.65
本期末	70,983,599.64	33,521,437.67	104,505,037.31

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	142,585.26
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	114,466.46
其他	419.91
合计	257,471.63

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	3,551,732,122.47
减：卖出股票成本总额	3,424,959,870.32
减：交易费用	5,629,184.17
买卖股票差价收入	121,143,067.98

6.4.7.10 债券投资收益

6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

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

债券投资收益——利息收入	21,064,681.25
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,373,391.90
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	24,438,073.15

6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	361,261,896.58
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	353,929,778.65
减：应计利息总额	3,939,028.28
减：交易费用	19,697.75
买卖债券差价收入	3,373,391.90

6.4.7.11 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	9,220,273.64
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	9,220,273.64

6.4.7.12 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	99,044,714.77
——股票投资	77,397,305.61
——债券投资	21,647,409.16
——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	99,044,714.77

6.4.7.13 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	5,108.35
转换费收入	8.19
合计	5,116.54

6.4.7.14 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	20,747.71
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	11,825.46
账户维护费	18,600.00
合计	110,680.54

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	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	7,410,014,696.25	100.00%	175,087,677.84	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

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		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成 交总额的比例	成交金额	占当期债券成 交总额的比例
国泰海通证券	-	-	184,195,790.17	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
-------	--	---

	成交金额	占当期债券回 购成交总额的 比例	成交金额	占当期债券回 购成交总额的 比例
国泰海通证券	-	-	65,500,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	3,378,176.00	100.00%	2,119,094.40	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	87,457.65	100.00%	50,336.25	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	7,722,623.80	250,618.13
其中：应支付销售机构的客户维护费	296,051.76	74,484.61
应支付基金管理人的净管理费	7,426,572.04	176,133.52

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.6\%\div \text{当年天数}$$

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。

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	1,287,103.89	41,769.68

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	国泰海通君得 盈债券 A	国泰海通君得 盈债券 C	国泰海通君得 盈债券 D	合计
国泰海通资管	-	3,934.05	72,130.89	76,064.94
建设银行	-	428.33	-	428.33
国泰海通证券	-	14,575.11	4.43	14,579.54
合计	-	18,937.49	72,135.32	91,072.81
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	国泰海通君得 盈债券 A	国泰海通君得 盈债券 C	国泰海通君得 盈债券 D	合计
国泰海通资管	-	44,325.35	7.86	44,333.21
建设银行	-	186.80	-	186.80
国泰海通证券	-	30,013.76	-	30,013.76
合计	-	74,525.91	7.86	74,533.77

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.40%，销售服务费按前一日 C 类份额的基金资产净值的 0.40%年费率计提，D 类份额的销售服务费年费率为 0.10%，销售服务费按前一日 D 类份额的基金资产净值的 0.10%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{该类基金份额销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为该类份额每日应计提的销售服务费

E 为该类份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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
建设银行	126,241,306.09	142,585.26	4,513,415.60	6,900.29

注：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。

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

国泰海通君得盈债券 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2026-05-15	2026-05-15	0.480	95,143,560.68	4,707,831.85	99,851,392.53	-
合计			0.480	95,143,560.68	4,707,831.85	99,851,392.53	-

国泰海通君得盈债券 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2026-05-15	2026-05-15	0.300	4,057,885.52	408,586.43	4,466,471.95	-
合计			0.300	4,057,885.52	408,586.43	4,466,471.95	-

国泰海通君得盈债券 D

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2026-05-15	2026-05-15	0.030	201,785.05	718,709.60	920,494.65	-
合计			0.030	201,785.05	718,709.60	920,494.65	-

注：报告期内本基金利润分配合计：105,238,359.13 元

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

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
300332	天壕能源	2026-06-26	筹划发行股份及支付现金购买资产	4.30	2026-07-09	4.64	100,400	461,549.54	431,720.00	-
688072	拓荆科技	2026-06-29	筹划发行股份及支付现金购买资产	832.00	2026-07-13	890.99	1,849	1,358,424.68	1,538,368.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金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 850,260,169.86 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
232400034	24 杭州银行 二级资本债 01	2026-07-01	103.26	170,000	17,554,553.97
232400035	24 南京银行 二级资本债 01	2026-07-01	103.59	800,000	82,870,904.11
232480035	24 平安银行 二级资本债 01A	2026-07-01	104.10	300,000	31,228,545.21
232480037	24 交行二级 资本债 02A	2026-07-01	103.57	1,200,000	124,289,457.53
232480039	24 广发银行 二级资本债 01A	2026-07-01	103.38	908,000	93,868,617.10
232580001	25 工行二级 资本债 01BC	2026-07-01	101.83	1,200,000	122,195,013.70
232580009	25 中信银行 二级资本债 01BC	2026-07-01	101.10	1,400,000	141,536,570.96
232580022	25 工行二级 资本债 03BC	2026-07-01	102.28	520,000	53,185,825.10
232580056	25 广发银行 二级资本债 01BC	2026-07-01	102.71	1,200,000	123,247,726.03
242680002	26 招商银行 永续债 01	2026-07-01	101.09	1,300,000	131,417,605.48
合计				8,998,000	921,394,819.19

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中国建设银行股份有限公司，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。

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。

6.4.13.2.1 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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	113,689,195.83	133,119,422.47
合计	113,689,195.83	133,119,422.47

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。

6.4.13.2.2 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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	2,538,570,432.32	1,565,381,302.54
AAA 以下	-	-
未评级	161,552,251.89	14,975,905.48
合计	2,700,122,684.21	1,580,357,208.02

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。

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 日除卖出回购金融资产款余额中有 850,260,169.86 元将在一个月内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约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 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 6 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	126,241,306.09	-	-	-	126,241,306.09
结 算 备 付 金	7,954,221.02	-	-	-	7,954,221.02
存 出	222,489.26	-	-	-	222,489.26

保 证 金					
交 易 性 金 融 资 产	255,093,802.4 2	2,538,570,432. 32	20,147,645.3 0	1,387,251,090. 43	4,201,062,970. 47
应 收 清 算 款	-	-	-	6,303,786.98	6,303,786.98
应 收 申 购 款	-	-	-	78,035.23	78,035.23
资 产 总 计	389,511,818.7 9	2,538,570,432. 32	20,147,645.3 0	1,393,632,912. 64	4,341,862,809. 05
负 债					
卖 出 回 购 金 融 资 产 款	850,260,169.8 6	-	-	-	850,260,169.86
应 付 清 算 款	-	-	-	21,726,486.10	21,726,486.10
应 付 赎 回	-	-	-	261,042.04	261,042.04

款					
应付管理人报酬	-	-	-	1,611,192.57	1,611,192.57
应付托管费	-	-	-	268,532.10	268,532.10
应付销售服务费	-	-	-	166,643.35	166,643.35
应交税费	-	-	-	32,394.09	32,394.09
其他负债	-	-	-	2,244,428.98	2,244,428.98
负债总计	850,260,169.86	-	-	26,310,719.23	876,570,889.09
利率敏感度缺口	- 460,748,351.07	2,538,570,432.32	20,147,645.30	1,367,322,193.41	3,465,291,919.96
上年度末 202	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

5 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	62,502,550.44	-	-	-	62,502,550.44
结算备付金	56,102,617.30	-	-	-	56,102,617.30
存出保证金	191,265.49	-	-	-	191,265.49
交易性金融资产	148,095,327.95	1,565,381,302.54	-	876,531,081.36	2,590,007,711.85
应收申购款	-	-	-	16,530.92	16,530.92
资产总计	266,891,761.18	1,565,381,302.54	-	876,547,612.28	2,708,820,676.00
负债					
卖出回购	630,115,130.85	-	-	-	630,115,130.85

金融 资产 款					
应付 清算 款	-	-	-	2,662,544.50	2,662,544.50
应付 赎回 款	-	-	-	98,047.07	98,047.07
应付 管理 人报 酬	-	-	-	1,050,077.45	1,050,077.45
应付 托管 费	-	-	-	175,012.90	175,012.90
应付 销售 服务 费	-	-	-	4,220.35	4,220.35
应交 税费	-	-	-	7,512.10	7,512.10
其他 负债	-	-	-	1,930,917.80	1,930,917.80
负债	630,115,130.85	-	-	5,928,332.17	636,043,463.02

总计					
利率敏感 度缺口	- 363,223,369.67	1,565,381,302.54	-	870,619,280.11	2,072,777,212.98

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

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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	基准利率点利率增加 0.1%	-9,127,011.57	-5,790,779.55
	基准利率点利率减少 0.1%	9,170,286.05	5,818,503.10

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

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,387,251,090.43	40.03	876,531,081.36	42.29
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	1,387,251,090.43	40.03	876,531,081.36	42.29

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%	620,144,573.99	171,393,791.79
	业绩比较基准(附注 6.4.1) 下降 5%	-620,144,573.99	-171,393,791.79

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	1,385,281,002.43	875,058,393.36
第二层次	2,815,781,968.04	1,714,949,318.49
第三层次	—	—
合计	4,201,062,970.47	2,590,007,711.85

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	1,387,251,090.43	31.95
	其中：股票	1,387,251,090.43	31.95
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	2,813,811,880.04	64.81

	其中：债券	2,813,811,880.04	64.81
	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	134,195,527.11	3.09
8	其他各项资产	6,604,311.47	0.15
9	合计	4,341,862,809.05	100.00

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	6,112,943.00	0.18
B	采矿业	66,862,771.64	1.93
C	制造业	957,374,980.27	27.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,844,440.00	0.86
E	建筑业	7,091,006.72	0.20
F	批发和零售业	27,872,065.00	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	42,864,282.00	1.24
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,746,114.07	2.30
J	金融业	118,638,651.62	3.42
K	房地产业	8,755,848.98	0.25
L	租赁和商务服务业	13,358,619.00	0.39
M	科学研究和技术服务业	24,268,545.40	0.70
N	水利、环境和公共设施管理业	1,846,715.94	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	463,680.00	0.01
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	1,593,077.79	0.05
S	综合	557,349.00	0.02
	合计	1,387,251,090.43	40.03

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	48,000	60,960,000.00	1.76
2	300750	宁德时代	97,100	38,161,271.00	1.10
3	300502	新易盛	53,640	32,559,480.00	0.94
4	688256	寒武纪	17,889	28,542,793.95	0.82
5	603259	药明康德	161,000	20,046,110.00	0.58
6	601398	工商银行	2,691,200	19,026,784.00	0.55
7	688981	中芯国际	117,872	18,720,431.04	0.54
8	300223	北京君正	70,000	17,423,000.00	0.50
9	300475	香农芯创	56,100	16,830,000.00	0.49
10	300408	三环集团	100,689	16,804,994.10	0.48
11	000333	美的集团	198,800	15,015,364.00	0.43
12	688469	芯联集成	1,394,296	14,793,480.56	0.43
13	300661	圣邦股份	101,200	14,520,176.00	0.42
14	603986	兆易创新	17,300	14,099,500.00	0.41
15	600183	生益科技	77,400	13,421,160.00	0.39
16	688396	华润微	137,400	13,403,370.00	0.39
17	600019	宝钢股份	2,451,600	13,312,188.00	0.38

18	601899	紫金矿业	520,400	13,082,856.0 0	0.38
19	601985	中国核电	1,446,600	13,062,798.0 0	0.38
20	600030	中信证券	450,500	12,942,865.0 0	0.37
21	300136	信维通信	107,300	12,795,525.0 0	0.37
22	300033	同花顺	52,360	12,618,760.0 0	0.36
23	600176	中国巨石	167,300	12,192,824.0 0	0.35
24	300438	鹏辉能源	143,100	11,855,835.0 0	0.34
25	688266	泽璟制药	101,570	11,849,156.2 0	0.34
26	600519	贵州茅台	9,752	11,560,898.4 8	0.33
27	000933	神火股份	532,100	11,280,520.0 0	0.33
28	000519	中兵红箭	532,600	11,221,882.0 0	0.32
29	601328	交通银行	1,731,100	11,130,973.0 0	0.32
30	601816	京沪高铁	2,272,800	10,295,784.0 0	0.30
31	301536	星宸科技	78,000	10,039,380.0 0	0.29
32	600460	士兰微	180,800	9,882,528.00	0.29
33	600938	中国海油	331,600	9,002,940.00	0.26
34	688111	金山办公	40,866	8,706,501.30	0.25
35	688110	东芯股份	42,348	8,626,287.60	0.25
36	601225	陕西煤业	420,900	8,565,315.00	0.25
37	600309	万华化学	125,100	8,558,091.00	0.25
38	605117	德业股份	79,800	8,473,164.00	0.24
39	600989	宝丰能源	414,700	8,430,851.00	0.24
40	688041	海光信息	22,726	8,415,437.80	0.24
41	601872	招商轮船	475,800	8,359,806.00	0.24
42	600999	招商证券	364,600	7,693,060.00	0.22
43	002281	光迅科技	29,900	7,682,506.00	0.22
44	603799	华友钴业	155,300	7,494,778.00	0.22
45	688456	有研粉材	49,173	6,864,550.80	0.20
46	600887	伊利股份	286,300	6,859,748.00	0.20

47	688521	芯原股份	18,311	6,795,944.54	0.20
48	002851	麦格米特	40,300	6,737,354.00	0.19
49	002821	凯莱英	41,500	6,723,000.00	0.19
50	300857	协创数据	19,500	6,628,050.00	0.19
51	301389	隆扬电子	71,100	6,170,769.00	0.18
52	600415	小商品城	605,300	6,149,848.00	0.18
53	600988	赤峰黄金	232,900	6,129,928.00	0.18
54	601658	邮储银行	1,236,200	6,094,466.00	0.18
55	600026	中远海能	339,200	6,085,248.00	0.18
56	600886	国投电力	455,400	6,061,374.00	0.17
57	601857	中国石油	683,200	5,930,176.00	0.17
58	300476	胜宏科技	17,100	5,923,953.00	0.17
59	600515	海南机场	2,151,677	5,895,594.98	0.17
60	603486	科沃斯	114,100	5,790,575.00	0.17
61	600018	上港集团	1,206,300	5,693,736.00	0.16
62	688008	澜起科技	18,300	5,671,170.00	0.16
63	300283	温州宏丰	275,100	5,653,305.00	0.16
64	601988	中国银行	980,000	5,605,600.00	0.16
65	002558	巨人网络	198,500	5,470,660.00	0.16
66	688301	奕瑞科技	42,860	5,314,640.00	0.15
67	002292	奥飞娱乐	800,000	5,248,000.00	0.15
68	301611	珂玛科技	28,900	5,204,023.00	0.15
69	601318	中国平安	106,200	5,069,988.00	0.15
70	600547	山东黄金	218,436	5,043,687.24	0.15
71	002138	顺络电子	65,600	4,795,360.00	0.14
72	688012	中微公司	10,107	4,735,129.50	0.14
73	600150	中国船舶	139,041	4,698,195.39	0.14
74	688347	华虹宏力	13,913	4,678,941.90	0.14
75	600346	恒力石化	261,300	4,627,623.00	0.13
76	301511	德福科技	32,000	4,603,200.00	0.13
77	000001	平安银行	448,700	4,509,435.00	0.13
78	001389	广合科技	19,000	4,507,750.00	0.13
79	688609	九联科技	402,262	4,428,904.62	0.13
80	002371	北方华创	5,000	4,422,800.00	0.13
81	300620	光库科技	11,300	4,273,660.00	0.12
82	603728	鸣志电器	70,000	4,264,400.00	0.12
83	000048	京基智农	189,000	4,175,010.00	0.12
84	601888	中国中免	76,800	4,124,928.00	0.12
85	688559	海目星	48,696	4,086,568.32	0.12
86	688416	恒烁股份	28,803	4,032,420.00	0.12
87	002885	京泉华	97,800	3,996,108.00	0.12
88	600908	无锡银行	766,100	3,891,788.00	0.11
89	603006	联明股份	272,200	3,878,850.00	0.11

90	600741	华域汽车	247,700	3,844,304.00	0.11
91	300260	新莱应材	38,200	3,837,572.00	0.11
92	688220	翱捷科技	30,470	3,788,030.40	0.11
93	000032	深桑达 A	151,100	3,769,945.00	0.11
94	600426	华鲁恒升	157,400	3,765,008.00	0.11
95	300489	光智科技	12,000	3,743,400.00	0.11
96	300346	南大光电	40,100	3,715,265.00	0.11
97	688107	安路科技	81,452	3,714,211.20	0.11
98	300607	拓斯达	87,700	3,615,871.00	0.10
99	300458	全志科技	91,300	3,602,698.00	0.10
100	000617	中油资本	546,400	3,600,776.00	0.10
101	603288	海天味业	107,580	3,567,352.80	0.10
102	300803	指南针	38,700	3,547,629.00	0.10
103	300715	凯伦股份	215,000	3,538,900.00	0.10
104	301310	鑫宏业	63,960	3,533,150.40	0.10
105	688166	博瑞医药	100,796	3,528,867.96	0.10
106	000807	云铝股份	159,300	3,526,902.00	0.10
107	002625	光启技术	116,000	3,517,120.00	0.10
108	002843	泰嘉股份	161,600	3,469,552.00	0.10
109	600893	航发动力	89,309	3,424,107.06	0.10
110	688090	瑞松科技	32,055	3,412,254.75	0.10
111	688719	爱科赛博	42,773	3,293,521.00	0.10
112	603516	淳中科技	23,700	3,190,257.00	0.09
113	603083	剑桥科技	12,300	3,134,901.00	0.09
114	300779	惠城环保	61,200	3,072,240.00	0.09
115	603659	璞泰来	105,300	3,046,329.00	0.09
116	002001	新和成	106,900	3,038,098.00	0.09
117	600008	首创环保	1,113,900	3,029,808.00	0.09
118	605123	派克新材	30,700	2,978,207.00	0.09
119	002886	沃特股份	105,300	2,957,877.00	0.09
120	603327	福蓉科技	348,600	2,956,128.00	0.09
121	601995	中金公司	81,300	2,938,995.00	0.08
122	601100	恒立液压	26,800	2,882,608.00	0.08
123	301607	富特科技	54,800	2,863,300.00	0.08
124	600031	三一重工	165,500	2,859,840.00	0.08
125	601066	中信建投	98,300	2,857,581.00	0.08
126	301349	信德新材	38,580	2,839,488.00	0.08
127	600601	方正科技	201,700	2,791,528.00	0.08
128	688320	禾川科技	66,611	2,761,025.95	0.08
129	688365	光云科技	174,956	2,759,056.12	0.08
130	600009	上海机场	118,900	2,746,590.00	0.08
131	002245	蔚蓝锂芯	146,120	2,733,905.20	0.08
132	600011	华能国际	360,000	2,732,400.00	0.08

133	601998	中信银行	389,400	2,698,542.00	0.08
134	002273	水晶光电	74,500	2,643,260.00	0.08
135	688498	源杰科技	1,400	2,640,400.00	0.08
136	002169	智光电气	179,900	2,633,736.00	0.08
137	300319	麦捷科技	87,800	2,601,514.00	0.08
138	002484	江海股份	24,400	2,562,000.00	0.07
139	688235	百济神州	9,760	2,484,993.60	0.07
140	000408	藏格矿业	35,700	2,474,724.00	0.07
141	688629	华丰科技	12,900	2,418,879.00	0.07
142	688653	康希通信	136,076	2,365,000.88	0.07
143	688499	利元亨	44,359	2,331,065.45	0.07
144	688620	安凯微	143,146	2,318,965.20	0.07
145	600816	建元信托	946,905	2,310,448.20	0.07
146	002463	沪电股份	15,100	2,307,280.00	0.07
147	300491	通合科技	60,000	2,291,400.00	0.07
148	002812	恩捷股份	34,100	2,281,631.00	0.07
149	300483	首华燃气	129,600	2,278,368.00	0.07
150	002050	三花智控	51,900	2,274,777.00	0.07
151	300672	国科微	7,600	2,242,000.00	0.06
152	688197	首药控股	66,159	2,210,372.19	0.06
153	688538	和辉光电	846,400	2,200,640.00	0.06
154	003043	华亚智能	21,900	2,176,641.00	0.06
155	002792	通宇通讯	60,800	2,162,656.00	0.06
156	002338	奥普光电	37,100	2,122,120.00	0.06
157	300121	阳谷华泰	165,300	2,082,780.00	0.06
158	688115	思林杰	25,300	2,080,925.00	0.06
159	688275	万润新能	16,300	2,079,065.00	0.06
160	600352	浙江龙盛	169,400	2,051,434.00	0.06
161	300604	长川科技	5,971	2,038,618.82	0.06
162	603078	江化微	41,200	2,036,104.00	0.06
163	003022	联泓新科	78,200	2,025,380.00	0.06
164	601766	中国中车	384,200	1,997,840.00	0.06
165	601288	农业银行	323,500	1,963,645.00	0.06
166	002399	海普瑞	217,900	1,956,742.00	0.06
167	301297	富乐德	31,800	1,947,432.00	0.06
168	688005	容百科技	62,202	1,903,381.20	0.05
169	300576	容大感光	36,400	1,864,408.00	0.05
170	601000	唐山港	448,300	1,860,445.00	0.05
171	301218	华是科技	44,800	1,845,760.00	0.05
172	301095	广立微	15,500	1,829,775.00	0.05
173	601600	中国铝业	222,300	1,827,306.00	0.05
174	603068	博通集成	45,100	1,814,373.00	0.05
175	600276	恒瑞医药	34,700	1,805,788.00	0.05

176	300342	天银机电	38,000	1,786,000.00	0.05
177	688213	思特威	16,610	1,778,432.70	0.05
178	600810	神马股份	286,900	1,770,173.00	0.05
179	600585	海螺水泥	102,230	1,732,798.50	0.05
180	688332	中科蓝讯	10,900	1,716,750.00	0.05
181	300820	英杰电气	18,900	1,705,347.00	0.05
182	300274	阳光电源	10,640	1,691,972.80	0.05
183	300488	恒锋工具	36,100	1,690,563.00	0.05
184	600029	南方航空	325,200	1,684,536.00	0.05
185	601699	潞安环能	117,800	1,682,184.00	0.05
186	603530	神马电力	32,600	1,659,340.00	0.05
187	002384	东山精密	6,300	1,652,805.00	0.05
188	301099	雅创电子	17,200	1,642,600.00	0.05
189	002952	亚世光电	73,500	1,619,205.00	0.05
190	603806	福斯特	95,400	1,601,766.00	0.05
191	300748	金力永磁	51,500	1,588,775.00	0.05
192	002016	世荣兆业	396,700	1,586,800.00	0.05
193	688183	生益电子	11,950	1,582,180.00	0.05
194	300315	掌趣科技	403,700	1,574,430.00	0.05
195	001337	四川黄金	42,300	1,550,718.00	0.04
196	688072	拓荆科技	1,849	1,538,368.00	0.04
197	601997	贵阳银行	298,300	1,530,279.00	0.04
198	001266	宏英智能	31,100	1,527,010.00	0.04
199	002057	中钢天源	122,700	1,525,161.00	0.04
200	300401	花园生物	68,100	1,490,709.00	0.04
201	688343	云天励飞	18,246	1,489,968.36	0.04
202	000415	渤海租赁	365,900	1,489,213.00	0.04
203	300069	金利华电	46,300	1,473,729.00	0.04
204	688172	燕东微	17,610	1,473,252.60	0.04
205	688175	高凌信息	58,545	1,472,406.75	0.04
206	002064	华峰化学	155,100	1,471,899.00	0.04
207	600104	上汽集团	150,400	1,467,904.00	0.04
208	002916	深南电路	3,200	1,465,280.00	0.04
209	002391	长青股份	298,600	1,454,182.00	0.04
210	600188	兖矿能源	80,800	1,435,816.00	0.04
211	688062	迈威生物	50,816	1,435,552.00	0.04
212	688108	赛诺医疗	77,189	1,430,312.17	0.04
213	688192	迪哲医药	35,819	1,430,252.67	0.04
214	002641	公元股份	364,900	1,408,514.00	0.04
215	600316	洪都航空	50,400	1,408,176.00	0.04
216	301116	益客食品	162,100	1,387,576.00	0.04
217	688728	格科微	65,900	1,386,536.00	0.04
218	301248	杰创智能	16,400	1,376,452.00	0.04

219	002317	众生药业	56,000	1,375,920.00	0.04
220	002460	赣锋锂业	21,000	1,373,400.00	0.04
221	688690	纳微科技	30,684	1,353,164.40	0.04
222	601677	明泰铝业	81,402	1,351,273.20	0.04
223	600919	江苏银行	125,300	1,350,734.00	0.04
224	688676	金盘科技	15,900	1,345,776.00	0.04
225	000151	中成股份	125,000	1,337,500.00	0.04
226	300031	宝通科技	46,300	1,322,791.00	0.04
227	600395	盘江股份	289,900	1,321,944.00	0.04
228	300579	数字认证	63,500	1,314,450.00	0.04
229	601898	中煤能源	107,700	1,311,786.00	0.04
230	300617	安靠智电	24,500	1,298,255.00	0.04
231	601777	千里科技	158,800	1,295,808.00	0.04
232	600020	中原高速	350,300	1,292,607.00	0.04
233	688373	盟科药业	284,500	1,288,785.00	0.04
234	688323	瑞华泰	22,622	1,278,143.00	0.04
235	003016	欣贺股份	207,800	1,273,814.00	0.04
236	600546	山煤国际	114,600	1,252,578.00	0.04
237	300687	赛意信息	40,400	1,252,400.00	0.04
238	688116	天奈科技	32,500	1,241,500.00	0.04
239	603439	三力制药	97,900	1,234,519.00	0.04
240	301021	英诺激光	10,100	1,231,190.00	0.04
241	300394	天孚通信	4,046	1,224,643.28	0.04
242	601668	中国建筑	278,660	1,209,384.40	0.03
243	003816	中国广核	306,600	1,198,806.00	0.03
244	002756	永兴材料	21,100	1,195,104.00	0.03
245	688202	美迪西	14,800	1,194,508.00	0.03
246	688700	东威科技	13,292	1,188,304.80	0.03
247	601375	中原证券	297,800	1,188,222.00	0.03
248	300575	中旗股份	240,100	1,181,292.00	0.03
249	001212	中旗新材	24,900	1,179,762.00	0.03
250	600971	恒源煤电	169,600	1,170,240.00	0.03
251	003025	思进智能	82,800	1,165,824.00	0.03
252	688309	恒誉环保	19,119	1,163,964.72	0.03
253	001696	宗申动力	55,700	1,159,117.00	0.03
254	300425	中建环能	307,200	1,148,928.00	0.03
255	002850	科达利	6,000	1,135,800.00	0.03
256	688598	金博股份	22,900	1,132,405.00	0.03
257	300863	卡倍亿	14,700	1,126,461.00	0.03
258	688350	富淼科技	32,455	1,120,671.15	0.03
259	600808	马钢股份	447,700	1,119,250.00	0.03
260	000831	中国稀土	20,000	1,109,800.00	0.03
261	688199	久日新材	32,128	1,109,379.84	0.03

262	301489	思泉新材	6,740	1,109,269.20	0.03
263	688231	隆达股份	29,708	1,091,174.84	0.03
264	600028	中国石化	240,100	1,070,846.00	0.03
265	688390	固德威	9,851	1,068,932.01	0.03
266	301369	联动科技	4,345	1,064,525.00	0.03
267	300339	润和软件	27,000	1,039,770.00	0.03
268	002966	苏州银行	146,600	1,020,336.00	0.03
269	300199	翰宇药业	46,100	1,017,888.00	0.03
270	301246	宏源药业	37,700	1,014,130.00	0.03
271	301128	强瑞技术	6,480	1,010,232.00	0.03
272	300124	汇川技术	15,200	1,008,216.00	0.03
273	600369	西南证券	247,100	993,342.00	0.03
274	688257	新锐股份	9,611	979,360.90	0.03
275	601665	齐鲁银行	169,146	975,972.42	0.03
276	300281	金明精机	158,200	953,946.00	0.03
277	601168	西部矿业	34,700	941,758.00	0.03
278	688599	天合光能	65,712	927,853.44	0.03
279	688028	沃尔德	5,900	919,633.00	0.03
280	600482	中国动力	27,900	915,120.00	0.03
281	688678	福立旺	37,580	908,308.60	0.03
282	603826	坤彩科技	35,200	899,712.00	0.03
283	000568	泸州老窖	11,500	891,480.00	0.03
284	688081	兴图新科	21,784	890,529.92	0.03
285	600858	银座股份	200,400	883,764.00	0.03
286	688353	华盛锂电	7,600	882,132.00	0.03
287	688221	前沿生物	39,248	879,155.20	0.03
288	000301	东方盛虹	75,600	865,620.00	0.02
289	301526	国际复材	18,500	863,395.00	0.02
290	600888	新疆众和	54,250	862,032.50	0.02
291	002475	立讯精密	12,200	858,880.00	0.02
292	301206	三元生物	38,500	855,855.00	0.02
293	000690	宝新能源	180,200	846,940.00	0.02
294	688291	金橙子	14,400	842,112.00	0.02
295	601009	南京银行	83,600	826,804.00	0.02
296	688772	珠海冠宇	41,900	822,497.00	0.02
297	000762	西藏矿业	30,200	806,340.00	0.02
298	002405	四维图新	123,700	800,339.00	0.02
299	300623	捷捷微电	17,700	796,323.00	0.02
300	300809	华辰装备	29,300	792,565.00	0.02
301	301571	国科天成	12,100	788,678.00	0.02
302	000090	天健集团	254,700	766,647.00	0.02
303	600638	新黄浦	175,200	765,624.00	0.02
304	600681	百川能源	236,000	762,280.00	0.02

305	002331	皖通科技	102,100	754,519.00	0.02
306	603915	国茂股份	53,000	752,070.00	0.02
307	600738	丽尚国潮	207,100	745,560.00	0.02
308	603010	万盛股份	40,800	739,296.00	0.02
309	301265	华新科技	26,100	719,055.00	0.02
310	601919	中远海控	54,100	717,366.00	0.02
311	601279	英利汽车	234,800	716,140.00	0.02
312	000068	华控赛格	252,500	714,575.00	0.02
313	002458	益生股份	91,800	713,286.00	0.02
314	600269	赣粤高速	178,800	711,624.00	0.02
315	603501	豪威集团	7,500	711,375.00	0.02
316	600628	新世界	125,600	707,128.00	0.02
317	600320	振华重工	166,500	687,645.00	0.02
318	600486	扬农化工	13,500	684,450.00	0.02
319	688168	安博通	9,916	681,725.00	0.02
320	300613	富瀚微	8,500	680,680.00	0.02
321	301238	瑞泰新材	27,800	678,320.00	0.02
322	000421	南京公用	136,500	677,040.00	0.02
323	301150	中一科技	10,720	676,539.20	0.02
324	600727	鲁北化工	100,200	673,344.00	0.02
325	002162	悦心健康	196,500	664,170.00	0.02
326	001314	亿道信息	10,700	661,260.00	0.02
327	600801	华新建材	41,700	650,520.00	0.02
328	688428	诺诚健华	22,760	647,977.20	0.02
329	002979	雷赛智能	11,600	647,048.00	0.02
330	688045	必易微	8,000	646,240.00	0.02
331	601077	渝农商行	104,700	639,717.00	0.02
332	300548	长芯博创	2,300	639,400.00	0.02
333	603876	鼎胜新材	24,500	637,245.00	0.02
334	603980	吉华集团	95,800	636,112.00	0.02
335	000969	安泰科技	25,900	635,586.00	0.02
336	688262	国芯科技	14,600	631,158.00	0.02
337	001339	智微智能	6,060	619,816.80	0.02
338	688378	奥来德	9,900	613,800.00	0.02
339	301391	卡莱特	10,500	599,550.00	0.02
340	603511	爱慕股份	52,100	599,150.00	0.02
341	000792	盐湖股份	19,700	594,743.00	0.02
342	002380	科远智慧	17,000	581,060.00	0.02
343	600690	海尔智家	28,200	575,562.00	0.02
344	000672	上峰材料	24,200	573,056.00	0.02
345	301057	汇隆新材	24,800	570,400.00	0.02
346	600846	同济科技	57,000	570,000.00	0.02
347	688679	通源环境	13,466	566,783.94	0.02

348	688299	长阳科技	33,700	563,127.00	0.02
349	600308	华泰股份	186,500	557,635.00	0.02
350	600805	悦达投资	138,300	557,349.00	0.02
351	688216	气派科技	13,209	554,910.09	0.02
352	300496	中科创达	8,900	549,931.00	0.02
353	002398	垒知集团	146,000	547,500.00	0.02
354	603681	永冠新材	23,800	543,830.00	0.02
355	002976	瑞玛精密	21,410	539,532.00	0.02
356	600623	华谊集团	66,600	537,462.00	0.02
357	603158	腾龙股份	43,900	536,897.00	0.02
358	688680	海优新材	12,752	535,584.00	0.02
359	301305	朗坤科技	18,700	533,324.00	0.02
360	688018	乐鑫科技	4,100	524,472.00	0.02
361	688409	富创精密	1,700	520,625.00	0.02
362	300763	锦浪科技	5,700	514,995.00	0.01
363	603032	德新科技	19,000	511,100.00	0.01
364	688787	海天瑞声	3,800	510,910.00	0.01
365	002491	通鼎互联	15,700	508,680.00	0.01
366	600037	歌华有线	80,800	506,616.00	0.01
367	300568	星源材质	26,900	503,568.00	0.01
368	002364	中恒电气	9,300	500,340.00	0.01
369	603270	金帝股份	14,900	499,299.00	0.01
370	603725	天安新材	43,800	494,940.00	0.01
371	300976	达瑞电子	6,200	493,830.00	0.01
372	300414	中光防雷	44,800	493,696.00	0.01
373	301178	天亿马	9,900	492,525.00	0.01
374	601949	中国出版	105,800	491,970.00	0.01
375	688148	芳源股份	57,200	490,776.00	0.01
376	601086	国芳集团	74,000	490,620.00	0.01
377	603893	瑞芯微	2,600	489,736.00	0.01
378	300400	劲拓股份	13,000	489,450.00	0.01
379	300191	潜能恒信	17,600	486,640.00	0.01
380	688689	银河微电	7,500	485,400.00	0.01
381	600827	百联股份	64,700	479,427.00	0.01
382	301322	绿通科技	8,900	474,815.00	0.01
383	688302	海创药业	13,371	470,258.07	0.01
384	601333	广深铁路	170,700	469,425.00	0.01
385	002607	中公教育	257,600	463,680.00	0.01
386	300582	英飞特	38,000	462,840.00	0.01
387	600859	王府井	50,400	462,672.00	0.01
388	002042	华孚时尚	134,400	458,304.00	0.01
389	600717	天津港	117,700	457,853.00	0.01
390	300726	宏达电子	5,400	456,678.00	0.01

391	601126	四方股份	7,200	455,040.00	0.01
392	688387	信科移动	22,923	454,792.32	0.01
393	600348	华阳股份	57,700	441,405.00	0.01
394	300151	昌红科技	17,600	439,120.00	0.01
395	600223	福瑞达	86,700	436,101.00	0.01
396	600339	中油工程	141,800	435,326.00	0.01
397	300332	天壕能源	100,400	431,720.00	0.01
398	301085	亚康股份	7,100	430,331.00	0.01
399	300418	昆仑万维	10,600	427,816.00	0.01
400	688001	华兴源创	4,975	426,357.50	0.01
401	688605	先锋精科	4,098	426,273.96	0.01
402	688249	晶合集成	7,200	425,016.00	0.01
403	301086	鸿富瀚	2,020	422,745.60	0.01
404	600166	福田汽车	144,300	419,913.00	0.01
405	601858	中国科传	24,200	418,902.00	0.01
406	000937	冀中能源	105,130	418,417.40	0.01
407	301396	宏景科技	1,260	417,816.00	0.01
408	600598	北大荒	38,500	417,340.00	0.01
409	600153	建发股份	51,400	407,602.00	0.01
410	002195	岩山科技	62,200	406,788.00	0.01
411	600641	先导基电	10,100	402,586.00	0.01
412	002443	金洲管道	42,100	401,213.00	0.01
413	002938	鹏鼎控股	3,800	400,444.00	0.01
414	600232	金鹰股份	62,900	396,270.00	0.01
415	688063	派能科技	7,300	388,871.00	0.01
416	301487	盟固利	20,300	388,745.00	0.01
417	603507	振江股份	11,800	388,102.00	0.01
418	600257	大湖股份	89,000	385,370.00	0.01
419	000061	农产品	68,500	383,600.00	0.01
420	300236	上海新阳	2,900	381,350.00	0.01
421	600335	国机汽车	81,400	380,952.00	0.01
422	600955	维远股份	25,800	379,776.00	0.01
423	301071	力量钻石	4,100	379,250.00	0.01
424	002187	广百股份	80,200	375,336.00	0.01
425	688779	五矿新能	46,200	374,682.00	0.01
426	301281	科源制药	7,600	374,680.00	0.01
427	600629	华建集团	30,900	374,199.00	0.01
428	000796	凯撒旅业	97,300	372,659.00	0.01
429	600814	杭州解百	60,900	371,490.00	0.01
430	600006	东风股份	71,500	366,795.00	0.01
431	600872	中炬高新	21,000	364,560.00	0.01
432	300953	震裕科技	2,700	360,990.00	0.01
433	601138	工业富联	5,000	360,750.00	0.01

434	605299	舒华体育	26,900	359,115.00	0.01
435	301251	威尔高	6,700	356,976.00	0.01
436	600619	海立股份	22,500	356,625.00	0.01
437	600549	厦门钨业	4,100	349,320.00	0.01
438	002468	申通快递	23,900	347,984.00	0.01
439	000837	秦川机床	31,200	346,632.00	0.01
440	002419	天虹股份	81,500	344,745.00	0.01
441	300843	胜蓝股份	2,200	343,750.00	0.01
442	300751	迈为股份	1,200	338,952.00	0.01
443	688682	霍莱沃	8,600	334,540.00	0.01
444	301587	中瑞股份	15,200	333,640.00	0.01
445	300512	中亚股份	48,300	329,406.00	0.01
446	688352	硕中科技	13,600	328,848.00	0.01
447	300464	星徽股份	46,000	327,980.00	0.01
448	300381	溢多利	58,300	327,646.00	0.01
449	002004	华邦健康	83,200	326,976.00	0.01
450	600626	申达股份	101,400	323,466.00	0.01
451	601918	新集能源	37,300	320,407.00	0.01
452	601916	浙商银行	119,100	313,233.00	0.01
453	600050	中国联通	77,200	308,800.00	0.01
454	600299	安迪苏	39,100	306,935.00	0.01
455	601366	利群股份	94,800	306,204.00	0.01
456	688255	凯尔达	10,866	302,074.80	0.01
457	300854	中兰环保	15,800	301,464.00	0.01
458	600125	铁龙物流	59,200	300,144.00	0.01
459	688400	凌云光	4,500	297,900.00	0.01
460	688577	浙海德曼	6,497	297,757.51	0.01
461	300327	中颖电子	9,200	294,860.00	0.01
462	600905	三峡能源	79,300	294,203.00	0.01
463	601088	中国神华	7,500	292,800.00	0.01
464	002918	蒙娜丽莎	29,000	291,450.00	0.01
465	002128	电投能源	12,400	286,688.00	0.01
466	688503	聚和材料	2,146	284,774.20	0.01
467	688716	中研股份	9,056	284,630.08	0.01
468	300219	鸿利智汇	27,200	283,696.00	0.01
469	300602	飞荣达	5,500	281,600.00	0.01
470	688002	睿创微纳	1,792	277,204.48	0.01
471	688158	优刻得	7,500	275,700.00	0.01
472	600787	中储股份	65,700	274,626.00	0.01
473	300840	酷特智能	13,300	274,379.00	0.01
474	000026	飞亚达	12,700	273,558.00	0.01
475	688135	利扬芯片	6,500	273,520.00	0.01
476	300905	宝丽迪	5,400	273,240.00	0.01

477	300856	科思股份	25,100	267,566.00	0.01
478	603638	艾迪精密	11,400	267,330.00	0.01
479	600386	北巴传媒	85,600	267,072.00	0.01
480	600259	中稀有有色	2,600	264,186.00	0.01
481	600267	海正药业	25,900	261,849.00	0.01
482	002521	齐峰新材	36,100	261,364.00	0.01
483	603086	先达股份	49,900	258,981.00	0.01
484	601500	通用股份	70,900	258,785.00	0.01
485	688218	江苏北人	4,700	258,312.00	0.01
486	002228	合兴包装	87,000	255,780.00	0.01
487	002111	威海广泰	28,300	254,700.00	0.01
488	600487	亨通光电	2,300	251,482.00	0.01
489	600572	康恩贝	63,800	250,096.00	0.01
490	300939	秋田微	3,600	249,120.00	0.01
491	601666	平煤股份	34,700	248,105.00	0.01
492	600298	安琪酵母	6,800	246,160.00	0.01
493	603686	福龙马	18,800	242,896.00	0.01
494	600015	华夏银行	37,800	241,542.00	0.01
495	601818	光大银行	82,800	239,292.00	0.01
496	000975	山金国际	14,000	238,000.00	0.01
497	688246	嘉和美康	11,500	236,325.00	0.01
498	603565	中谷物流	23,800	233,478.00	0.01
499	600865	百大集团	28,500	233,415.00	0.01
500	000505	京粮控股	46,100	231,883.00	0.01
501	300201	海伦哲	10,800	227,556.00	0.01
502	688379	华光新材	2,700	226,881.00	0.01
503	300284	苏交科	45,200	226,000.00	0.01
504	000100	TCL 科技	38,600	224,652.00	0.01
505	300473	德尔股份	7,300	221,920.00	0.01
506	600548	深高速	27,100	220,323.00	0.01
507	300322	硕贝德	8,700	219,240.00	0.01
508	601229	上海银行	25,200	218,736.00	0.01
509	600875	东方电气	7,600	218,652.00	0.01
510	300127	银河磁体	7,700	215,215.00	0.01
511	301260	格力博	15,800	213,458.00	0.01
512	603848	好太太	15,500	211,730.00	0.01
513	600196	复星医药	9,400	211,218.00	0.01
514	600256	广汇能源	42,500	209,950.00	0.01
515	300691	联合光电	13,200	208,692.00	0.01
516	688225	亚信安全	16,700	207,414.00	0.01
517	688385	复旦微电	2,900	206,741.00	0.01
518	002948	青岛银行	40,100	203,708.00	0.01
519	300153	科泰电源	9,000	203,580.00	0.01

520	603392	万泰生物	7,500	202,275.00	0.01
521	300587	天铁科技	52,500	202,125.00	0.01
522	688181	八亿时空	3,200	200,320.00	0.01
523	300872	天阳科技	12,500	197,500.00	0.01
524	300034	钢研高纳	11,500	197,110.00	0.01
525	300756	金马游乐	5,960	196,978.00	0.01
526	601801	皖新传媒	38,903	191,791.79	0.01
527	601107	四川成渝	38,900	189,832.00	0.01
528	002772	众兴菌业	16,700	189,712.00	0.01
529	601139	深圳燃气	33,500	189,610.00	0.01
530	301025	读客文化	24,300	188,568.00	0.01
531	300814	中富电路	900	184,050.00	0.01
532	002204	大连重工	34,400	181,632.00	0.01
533	300511	雪榕生物	35,900	180,577.00	0.01
534	601238	广汽集团	35,400	179,832.00	0.01
535	600740	山西焦化	56,300	179,597.00	0.01
536	000425	徐工机械	21,900	177,171.00	0.01
537	601298	青岛港	21,800	175,490.00	0.01
538	600655	豫园股份	42,600	175,086.00	0.01
539	688382	益方生物	9,673	174,114.00	0.01
540	000886	海南高速	42,600	173,808.00	0.01
541	688165	埃夫特	8,406	171,482.40	0.00
542	300486	东杰智能	7,900	168,665.00	0.00
543	603132	金徽股份	10,800	168,264.00	0.00
544	688619	罗普特	10,363	168,191.49	0.00
545	603605	珀莱雅	2,800	167,776.00	0.00
546	688600	皖仪科技	4,995	166,233.60	0.00
547	300442	润泽科技	2,000	166,140.00	0.00
548	601069	西部黄金	7,500	165,000.00	0.00
549	002648	卫星化学	7,000	164,430.00	0.00
550	001286	陕西能源	16,200	164,268.00	0.00
551	002432	九安医疗	2,300	162,564.00	0.00
552	002846	英联股份	15,300	162,027.00	0.00
553	600498	烽火通信	2,200	161,920.00	0.00
554	000685	中山公用	14,500	161,820.00	0.00
555	002738	中矿资源	2,700	159,273.00	0.00
556	300390	天华新能	1,700	158,967.00	0.00
557	000990	诚志股份	19,400	158,692.00	0.00
558	600724	宁波富达	30,300	153,621.00	0.00
559	688660	电气风电	17,700	152,574.00	0.00
560	600502	安徽建工	34,400	149,640.00	0.00
561	688668	鼎通科技	400	149,320.00	0.00
562	301517	陕西华达	3,000	148,890.00	0.00

563	600928	西安银行	45,500	148,785.00	0.00
564	002067	景兴纸业	40,300	148,304.00	0.00
565	000628	高新发展	3,100	146,940.00	0.00
566	688500	慧辰股份	3,217	145,826.61	0.00
567	300055	万邦达	22,400	144,032.00	0.00
568	000708	中信特钢	11,400	143,868.00	0.00
569	301230	泓博医药	3,900	143,676.00	0.00
570	301393	昊帆生物	2,200	142,494.00	0.00
571	688010	福光股份	2,928	142,388.64	0.00
572	601326	秦港股份	44,800	141,568.00	0.00
573	601101	昊华能源	13,400	141,504.00	0.00
574	002136	安纳达	10,600	138,648.00	0.00
575	688628	优利德	1,400	138,516.00	0.00
576	601800	中国交建	24,200	138,182.00	0.00
577	002054	德美化工	20,500	136,325.00	0.00
578	605188	国光连锁	11,600	135,604.00	0.00
579	601127	赛力斯	2,200	134,750.00	0.00
580	300213	佳讯飞鸿	22,100	133,926.00	0.00
581	000338	潍柴动力	4,900	133,525.00	0.00
582	300049	福瑞医科	3,400	132,192.00	0.00
583	000895	双汇发展	5,900	132,160.00	0.00
584	688717	艾罗能源	1,600	132,112.00	0.00
585	301216	万凯新材	5,700	131,043.00	0.00
586	601117	中国化学	17,800	130,830.00	0.00
587	603587	地素时尚	11,700	129,987.00	0.00
588	600985	淮北矿业	9,100	127,855.00	0.00
589	301160	翔楼新材	2,705	126,188.25	0.00
590	000055	方大集团	37,300	125,701.00	0.00
591	002271	东方雨虹	10,500	124,635.00	0.00
592	002746	仙坛股份	24,400	124,440.00	0.00
593	605577	龙版传媒	13,900	122,459.00	0.00
594	600105	永鼎股份	1,800	121,464.00	0.00
595	688578	艾力斯	1,100	120,120.00	0.00
596	000676	智度股份	23,500	120,085.00	0.00
597	603018	华设集团	23,160	119,042.40	0.00
598	002293	罗莱生活	11,900	117,691.00	0.00
599	001391	国货航	28,800	117,216.00	0.00
600	688117	圣诺生物	4,300	116,229.00	0.00
601	300830	金现代	14,600	115,924.00	0.00
602	002049	紫光国微	1,300	115,375.00	0.00
603	688031	星环科技	1,000	115,180.00	0.00
604	300681	英搏尔	4,000	114,480.00	0.00
605	002811	郑中设计	10,200	114,138.00	0.00

606	300026	红日药业	38,900	112,810.00	0.00
607	600057	厦门象屿	20,800	112,736.00	0.00
608	300509	新美星	13,400	112,292.00	0.00
609	600025	华能水电	12,600	112,014.00	0.00
610	603071	物产环能	10,000	110,600.00	0.00
611	601963	重庆银行	10,800	108,864.00	0.00
612	000810	创维数字	8,200	108,650.00	0.00
613	601186	中国铁建	18,096	107,671.20	0.00
614	603496	恒为科技	4,600	105,708.00	0.00
615	301500	飞南资源	4,000	104,200.00	0.00
616	301219	腾远钴业	1,830	100,284.00	0.00
617	600704	物产中大	21,100	99,592.00	0.00
618	688525	佰维存储	200	98,946.00	0.00
619	300107	建新股份	17,600	98,560.00	0.00
620	300741	华宝股份	7,800	97,656.00	0.00
621	603758	秦安股份	10,900	97,446.00	0.00
622	600061	国投资本	14,600	95,630.00	0.00
623	301055	张小泉	2,200	93,434.00	0.00
624	300933	中辰股份	14,934	90,798.72	0.00
625	002034	旺能环境	5,900	89,385.00	0.00
626	605138	盛泰集团	15,800	87,216.00	0.00
627	301392	汇成真空	300	86,592.00	0.00
628	300731	科创新源	1,480	86,372.80	0.00
629	002737	葵花药业	7,700	86,317.00	0.00
630	300921	南凌科技	4,200	85,302.00	0.00
631	002758	浙农股份	10,700	84,530.00	0.00
632	301382	蜂助手	1,800	82,800.00	0.00
633	002266	浙富控股	16,300	82,478.00	0.00
634	603185	弘元绿能	4,900	81,781.00	0.00
635	300760	迈瑞医疗	600	81,498.00	0.00
636	603216	梦天家居	3,900	80,223.00	0.00
637	603345	安井食品	1,000	80,190.00	0.00
638	603886	元祖股份	6,100	77,958.00	0.00
639	001965	招商公路	8,500	77,860.00	0.00
640	301181	标榜股份	3,330	77,056.20	0.00
641	688006	杭可科技	2,100	76,755.00	0.00
642	600088	中视传媒	7,000	76,230.00	0.00
643	300590	移为通信	5,300	76,055.00	0.00
644	600663	陆家嘴	12,100	75,988.00	0.00
645	300909	汇创达	1,300	75,686.00	0.00
646	300358	楚天科技	9,455	75,640.00	0.00
647	688345	博力威	1,300	75,504.00	0.00
648	300817	双飞集团	4,800	74,880.00	0.00

649	300054	鼎龙股份	700	74,179.00	0.00
650	002344	海宁皮城	20,900	73,150.00	0.00
651	300826	测绘股份	5,200	72,800.00	0.00
652	000589	贵州轮胎	17,900	72,674.00	0.00
653	002250	联化科技	5,300	72,451.00	0.00
654	688360	德马科技	4,000	71,600.00	0.00
655	002818	富森美	6,800	70,652.00	0.00
656	300788	中信出版	3,100	69,657.00	0.00
657	688180	君实生物	2,037	68,891.34	0.00
658	601218	吉鑫科技	16,000	68,800.00	0.00
659	688683	莱尔科技	1,800	68,256.00	0.00
660	688615	合合信息	600	67,860.00	0.00
661	300801	泰和科技	2,100	67,830.00	0.00
662	002132	恒星科技	12,300	66,543.00	0.00
663	301299	卓创资讯	1,500	66,090.00	0.00
664	600809	山西汾酒	600	65,622.00	0.00
665	688035	德邦科技	700	64,260.00	0.00
666	601111	中国国航	10,600	64,130.00	0.00
667	601018	宁波港	20,200	63,630.00	0.00
668	002990	盛视科技	800	63,200.00	0.00
669	688230	芯导科技	800	63,048.00	0.00
670	600189	泉阳泉	8,300	62,499.00	0.00
671	301045	天禄科技	700	62,356.00	0.00
672	002881	美格智能	1,700	61,948.00	0.00
673	300447	全信股份	4,100	61,213.00	0.00
674	000825	太钢不锈	17,800	60,698.00	0.00
675	300508	维宏股份	1,000	57,430.00	0.00
676	688472	阿特斯	5,200	56,264.00	0.00
677	300233	金城医药	4,500	55,800.00	0.00
678	688618	三旺通信	1,800	55,386.00	0.00
679	688758	赛分科技	2,500	55,025.00	0.00
680	301183	东田微	200	52,974.00	0.00
681	301069	凯盛新材	2,600	52,104.00	0.00
682	002863	今飞凯达	12,200	51,728.00	0.00
683	300087	ST 荃银	9,600	51,648.00	0.00
684	688226	威腾电气	1,200	51,396.00	0.00
685	688567	孚能科技	4,800	50,400.00	0.00
686	301213	观想科技	1,000	49,140.00	0.00
687	688209	英集芯	1,670	48,563.60	0.00
688	600429	三元股份	12,000	48,480.00	0.00
689	600177	雅戈尔	6,363	47,913.39	0.00
690	600362	江西铜业	1,100	47,630.00	0.00
691	605009	豪悦护理	2,000	46,620.00	0.00

692	002487	大金重工	800	46,376.00	0.00
693	301193	家联科技	2,500	46,350.00	0.00
694	002752	昇兴股份	8,300	45,816.00	0.00
695	601827	三峰环境	6,000	43,620.00	0.00
696	688356	键凯科技	555	42,779.40	0.00
697	688658	悦康药业	3,300	42,438.00	0.00
698	002563	森马服饰	8,400	42,336.00	0.00
699	603538	美诺华	1,300	42,315.00	0.00
700	000776	广发证券	1,800	42,120.00	0.00
701	600475	华光环能	2,700	41,175.00	0.00
702	688327	云从科技	3,300	41,118.00	0.00
703	301017	漱玉平民	3,000	39,120.00	0.00
704	300481	濮阳惠成	2,000	38,040.00	0.00
705	300735	光弘科技	1,600	36,384.00	0.00
706	688399	硕世生物	800	36,312.00	0.00
707	688799	华纳药厂	800	35,896.00	0.00
708	002761	浙江建投	5,400	35,802.00	0.00
709	601156	东航物流	2,200	35,464.00	0.00
710	600686	金龙汽车	3,100	34,999.00	0.00
711	601068	中铝国际	8,000	34,560.00	0.00
712	603396	金辰股份	1,300	34,450.00	0.00
713	603999	读者传媒	6,700	33,500.00	0.00
714	603305	旭升集团	2,700	32,724.00	0.00
715	600433	冠豪高新	9,800	31,458.00	0.00
716	600039	四川路桥	4,016	31,405.12	0.00
717	300871	回盛生物	1,400	30,884.00	0.00
718	688237	超卓航科	573	30,609.66	0.00
719	301662	宏工科技	300	30,396.00	0.00
720	002493	荣盛石化	2,800	30,100.00	0.00
721	600496	精工钢构	9,700	30,070.00	0.00
722	603393	新天然气	1,400	29,974.00	0.00
723	300917	特发服务	1,200	29,256.00	0.00
724	688318	财富趋势	400	28,524.00	0.00
725	002923	润都股份	3,000	28,380.00	0.00
726	688586	江航装备	2,400	28,056.00	0.00
727	002027	分众传媒	5,700	27,588.00	0.00
728	301041	金百泽	800	27,000.00	0.00
729	000501	武商集团	4,000	26,760.00	0.00
730	000557	西部创业	7,700	26,642.00	0.00
731	600755	厦门国贸	4,900	26,558.00	0.00
732	000426	兴业银锡	800	26,368.00	0.00
733	300187	永清环保	5,200	26,260.00	0.00
734	000089	深圳机场	4,100	24,723.00	0.00

735	603878	武进不锈	4,700	24,158.00	0.00
736	688036	传音控股	400	23,580.00	0.00
737	000935	四川双马	900	23,481.00	0.00
738	688261	东微半导	200	20,986.00	0.00
739	603013	亚普股份	1,300	20,527.00	0.00
740	603992	松霖科技	600	19,440.00	0.00
741	301365	矩阵股份	500	18,955.00	0.00
742	300154	瑞凌股份	2,500	18,800.00	0.00
743	600295	鄂尔多斯	1,600	17,152.00	0.00
744	603897	长城科技	500	16,230.00	0.00
745	301165	锐捷网络	200	16,090.00	0.00
746	688321	微芯生物	600	15,798.00	0.00
747	002107	沃华医药	2,680	15,249.20	0.00
748	002365	永安药业	1,500	15,180.00	0.00
749	300737	科顺股份	2,300	15,111.00	0.00
750	301665	泰禾股份	700	14,672.00	0.00
751	000968	蓝焰控股	2,400	14,376.00	0.00
752	300822	贝仕达克	1,200	14,040.00	0.00
753	300998	宁波方正	500	13,915.00	0.00
754	301177	迪阿股份	500	13,785.00	0.00
755	000828	东莞控股	1,400	13,104.00	0.00
756	300592	华凯易佰	700	12,390.00	0.00
757	300997	欢乐家	900	12,195.00	0.00
758	000779	甘咨询	1,500	11,685.00	0.00
759	301031	中熔电气	92	10,989.40	0.00
760	601518	吉林高速	3,300	9,240.00	0.00
761	003027	同兴科技	500	8,715.00	0.00
762	603889	新澳股份	1,700	8,687.00	0.00
763	688182	灿勤科技	200	8,614.00	0.00
764	300563	神宇股份	300	8,517.00	0.00
765	002677	浙江美大	1,500	8,295.00	0.00
766	301360	荣旗科技	100	6,849.00	0.00
767	688030	山石网科	400	6,316.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入 金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	42,336,960.40	2.04

2	300750	宁德时代	35,350,795.0 0	1.71
3	688256	寒武纪	31,727,000.1 5	1.53
4	300502	新易盛	29,129,620.6 0	1.41
5	300394	天孚通信	26,203,489.8 0	1.26
6	300136	信维通信	26,182,662.0 0	1.26
7	603259	药明康德	23,841,197.0 0	1.15
8	300476	胜宏科技	23,528,776.0 0	1.14
9	300223	北京君正	20,744,037.0 0	1.00
10	002466	天齐锂业	19,817,527.8 4	0.96
11	600989	宝丰能源	19,685,922.2 8	0.95
12	600150	中国船舶	19,604,684.5 9	0.95
13	300408	三环集团	19,242,352.2 1	0.93
14	000933	神火股份	18,739,773.6 9	0.90
15	600030	中信证券	18,494,398.0 0	0.89
16	002001	新和成	17,994,247.0 0	0.87
17	688981	中芯国际	17,856,599.9 4	0.86
18	688111	金山办公	17,794,362.9 7	0.86
19	601816	京沪高铁	17,680,610.0 0	0.85
20	600938	中国海油	17,671,596.0 0	0.85

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	300394	天孚通信	33,741,677.84	1.63
2	300750	宁德时代	29,597,445.00	1.43
3	300502	新易盛	24,522,695.60	1.18
4	002916	深南电路	24,129,913.10	1.16
5	300308	中际旭创	23,831,695.00	1.15
6	300274	阳光电源	22,463,423.60	1.08
7	601318	中国平安	22,089,605.00	1.07
8	688008	澜起科技	21,858,068.13	1.05
9	300604	长川科技	21,083,428.00	1.02
10	600150	中国船舶	20,443,243.00	0.99
11	300476	胜宏科技	20,158,530.46	0.97
12	002466	天齐锂业	19,976,233.00	0.96
13	600887	伊利股份	19,415,863.00	0.94
14	002384	东山精密	19,384,310.00	0.94
15	603259	药明康德	19,382,610.00	0.94
16	688336	三生国健	17,476,230.54	0.84
17	300017	网宿科技	16,755,134.00	0.81
18	600276	恒瑞医药	16,475,152.80	0.79
19	688981	中芯国际	16,314,529.90	0.79
20	688111	金山办公	15,918,990.46	0.77

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	3,858,282,573.78
卖出股票收入（成交）总额	3,551,732,122.47

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

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	35,230,897.36	1.02
2	央行票据	—	—
3	金融债券	2,778,580,982.68	80.18
	其中：政策性金融债	240,010,550.36	6.93
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债(可交换债)	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	2,813,811,880.04	81.20

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

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	232480035	24 平安银行 二级资本债 01A	1,500,000	156,142,726.03	4.51
2	232580009	25 中信银行 二级资本债 01BC	1,400,000	141,536,570.96	4.08
3	242680002	26 招商银行 永续债 01	1,300,000	131,417,605.48	3.79

4	232480037	24 交行二级 资本债 02A	1,200,000	124,289,457.5 3	3.59
5	232400037	24 宁波银行 二级资本债 02	1,200,000	123,727,778.6 3	3.57

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

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

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

在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，并积极采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对国债市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求合理的估值水平，通过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，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合整体风险的目的。

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广发银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局地方分局、中国银行间市场交易商协会调查、罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体交通银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行及分支行、国家外汇管理局地方分局罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体宁波银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行罚款。

本基金持有的前十名证券发行主体平安银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行分支行、证监会分局罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体兴业银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局地方分局、地方财政局、中国银行间市场交易商协会罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体招商银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局地方分局、地方财政局罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国工商银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行及分支行、国家外汇管理局地方分局、地方财政局罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局地方分局、地方财政局、证监会分局、深圳证券交易所罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体中信银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行及分支行、国家外汇管理局地方分局罚款、警告等。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	222,489.26
2	应收清算款	6,303,786.98
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	78,035.23

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,604,311.47

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

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
国泰海通君得盈债券 A	517	4,107,786.06	2,110,536,378.33	99.38%	13,189,013.41	0.62%
国泰海通君得盈债券 C	1,559	195,540.81	288,704,610.36	94.70%	16,143,510.37	5.30%
国泰海通君得盈债券 D	203	3,114,806.90	631,851,328.80	99.93%	454,471.52	0.07%
合计	2,279	1,343,080.00	3,031,092,317.49	99.03%	29,786,995.30	0.97%

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

8.2 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	国泰海通君得盈债券 A	96,458.51	0.0045%
	国泰海通君得盈债券 C	70,501.30	0.0231%
	国泰海通君得盈债券 D	56,498.69	0.0089%
	合计	223,458.50	0.0073%

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

8.3 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	国泰海通君得盈债券 A	0~10
	国泰海通君得盈债券 C	0
	国泰海通君得盈债券 D	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰海通君得盈债券 A	0
	国泰海通君得盈债券 C	0
	国泰海通君得盈债券 D	0
	合计	0

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰海通君得盈 债券 A	国泰海通君得 盈债券 C	国泰海通君得盈 债券 D
基金合同生效日（2021 年 01 月 28 日）基金份额总额	52,495,722.43	—	—
本报告期期初基金份额总额	1,925,792,327.72	12,099,857.74	53,100.81
本报告期基金总申购份额	206,902,482.57	359,007,892.23	1,038,148,103.24
减：本报告期基金总赎回份额	8,969,418.55	66,259,629.24	405,895,403.73
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	2,123,725,391.7	304,848,120.7	632,305,800.32

	4	3	
--	---	---	--

注：基金总申购份额含红利再投资及转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

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

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

2、本报告期内本基金托管人专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人受稽查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人相关从业人员受稽查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰海通证券股份有限公司	2	7,410,014,696.25	100.00%	3,378,176.00	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	国泰海通君得盈债券型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2026-01-16
2	国泰海通君得盈债券型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2026-01-16
3	国泰海通君得盈债券型证券投资基金（D类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2026-01-16
4	国泰海通君得盈债券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	2026-01-16
5	国泰海通君得盈债券型证券投资基金 2025 年	证监会指定网站、	2026-01-22

	第 4 季度报告	公司官网	
6	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
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
9	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
10	国泰海通君得盈债券型证券投资基金 2025 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-03-31
11	国泰海通君得盈债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-04-22
12	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
13	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
14	关于上海国泰海通证券资产管理有限公司吸收合并上海海通证券资产管理有限公司重要事项的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2026-05-06
15	国泰海通君得盈债券型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资）的公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2026-05-13
16	国泰海通君得盈债券型证券投资基金分红公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2026-05-14
17	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
18	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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260101-20260630	1,896,452,683.48	-	-	1,896,452,683.48	61.96%
产品特有风险							
本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%,则面临大额赎回的情况,可能导致: (1)基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险;如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延缓赎回,如果连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响; (2)基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平; (3)因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动; (4)基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略; (5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。							

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盈债券型集合资产管理计划变更注册的批复;
- 2、《国泰海通君得盈债券型证券投资基金基金合同》;
- 3、《国泰海通君得盈债券型证券投资基金托管协议》;
- 4、《国泰海通君得盈债券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