

国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金

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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	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	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13

§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	64
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	64
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	65
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	65
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	65
7.12 投资组合报告附注	65

§ 8 基金份额持有人信息	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
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	67
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	67
§ 9 开放式基金份额变动	68
§ 10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议	68
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	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
10.4 基金投资策略的改变	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	69
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	69
10.8 其他重大事件	70
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金	
基金简称	国泰海通稳健泰裕债券发起	
基金主代码	025000	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 11 月 04 日	
基金管理人	上海国泰海通证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	546,069,392.85 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰海通稳健泰裕债券发起 A	国泰海通稳健泰裕债券发起 C
下属分级基金的交易代码	025000	025001
报告期末下属分级基金的份 额总额	354,226,045.99 份	191,843,346.86 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海国泰海通证券资产管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负 责人	姓名	吕巍	王小飞
	联系电话	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	《上海证券报》
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	上海国泰海通证券资产管理有限公司	上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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）	
	国泰海通稳健泰裕债券发起 A	国泰海通稳健泰裕债券发起 C
本期已实现收益	17,889,008.15	9,788,530.25
本期利润	21,372,865.02	11,978,936.90
加权平均基金份额本期利润	0.0401	0.0382
本期加权平均净值利润率	3.95%	3.77%
本期基金份额净值增长率	3.79%	3.58%
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	12,016,009.89	5,986,784.10
期末可供分配基金份额利润	0.0339	0.0312
期末基金资产净值	368,029,313.45	198,795,433.63
期末基金份额净值	1.0390	1.0362
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	3.90%	3.62%

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

国泰海通稳健泰裕债券发起 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	3.49%	0.26%	3.24%	0.25%	0.25%	0.01%
过去六个月	3.79%	0.26%	3.90%	0.25%	-0.11%	0.01%
自基金合同生效起至今	3.90%	0.23%	3.82%	0.23%	0.08%	0.00%

国泰海通稳健泰裕债券发起 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	3.38%	0.26%	3.24%	0.25%	0.14%	0.01%
过去六个月	3.58%	0.26%	3.90%	0.25%	-0.32%	0.01%
自基金合同生效起至今	3.62%	0.23%	3.82%	0.23%	-0.20%	0.00%

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

国泰海通稳健泰裕债券发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年11月04日-2026年06月30日)



注：1、本基金于 2025 年 11 月 04 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

国泰海通稳健泰裕债券发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年11月04日-2026年06月30日)



注：1、本基金于 2025 年 11 月 04 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§ 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡崇海	国泰海通中证 500 指数增强基金经理，国泰海通中证 1000 指数增强基金经理，国泰海通量化选股混合发起基金经理，国泰海通沪深 300 指数增强发起基金经理，国泰海通中证 1000 优选股票发起基金经理，国泰海通科创板量化选股股票发起基金经理，国泰海通红利量化选股混合基金经理，国泰海通中证 A500 指数增强基金经理，国泰海通上证科创板综合价格指数增强基金经理，国泰海通稳健泰裕债券发起基金经理，国泰海通中	2025-11-04	-	15 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士。曾任香港科技大学人工智能实验室访问学者，其后加盟方正证券研究所、国泰君安证券咨询部及研究所从事量化对冲模型的研发工作，2014 年加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，先后在量化投资部、权益与衍生品部担任高级投资经理，从事量化投资和策略研发工作，在 Alpha 量化策略以及基于机器学习的投资方面有独到且深入的研究。现任本公司量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。

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

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

今年上半年，资金面宽松主导债市，信贷需求偏弱，加之政府债券发行节奏偏慢，“资产荒”逻辑再度强化，驱动收益率呈阶梯式下行，曲线整体呈现牛陡走势。相较于 2025 年末，1 年国债收益率下行 22BP 至 1.12%，10 年国债收益率下行 11BP 至 1.73%，30 年国债收益率下行 3BP 至 2.24%。具体来看：年初受风险偏好回升及供给压力预期扰动，10 年国债收益率一度上行至 1.9% 附近；随后 1 至 3 月，银行等配置盘力量主导市场，债市超跌反弹，收益率曲线呈陡峭化走势；进入 4 至 5 月，资金面进入“超宽松”状态，资管机构资金充裕，叠加政府债供给持续低于预期，10 年国债收益率最低下行至约 1.7%；6 月以来，央行出手纠偏资金面，债市出现小幅回调。权益方面，上半年 A 股整体震荡上行，结构型特征显著，成长风格明显占优。尤其二季度，资金高度集中于少数科技主线，分化剧烈。本组合高度关注市场变化，充分研判资产轮动和风格切换，在股债平衡和哑铃配比中追求稳健收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰海通稳健泰裕债券发起 A 基金份额净值为 1.0390 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 3.79%，同期业绩比较基准收益率为 3.90%；截至报告期末国泰海通稳健泰裕债券发起 C 基金份额净值为 1.0362 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 3.58%，同期业绩比较基准收益率为 3.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

往后看，经济 K 型分化之下，关注增量政策出台的可能，央行有望继续呵护资金面，债市供给压力阶段性走强。整体判断债市仍维持区间震荡格局，但外部扰动（如海外政策溢出）、国内政策博弈以及金融监管趋严等因素可能放大波动幅度。策略上，利率下行过程中需及时兑现存量收益，同时在调整中积极把握布局机会，在曲线可能的平坦化中，利差挖掘策略依然具备有效性和操作空间。权益方面，近期市场拥挤度从高位回落，热门股开始回调，行情出现扩散迹象。国内政策对于资本市场的支持方向较为明确，科技仍然是重要主线，但从单纯主题转向业绩验证，市场宽度有所回升，量化策略持股分散，有利于争取超额收益。本产品定位中高波固收+二级债基，力求打造成具有长期生命力的量化固收+代表性产品。

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规定，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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本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：国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金

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	6,065,350.92	51,019,857.79
结算备付金		2,044,781.39	70,104,000.41
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	605,152,403.00	931,557,528.35
其中：股票投资		97,979,189.07	181,344,327.81
基金投资		-	-
债券投资		507,173,213.93	750,213,200.54
资产支持证 券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.3	-	510,061,691.51
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		6,527,256.71	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.4	-	-

资产总计		619,789,792.02	1,562,743,078.06
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		49,999,100.00	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,402,867.06	-
应付管理人报酬		289,668.76	1,459,161.33
应付托管费		72,417.20	364,790.36
应付销售服务费		68,925.42	366,772.53
应付投资顾问费		-	-
应交税费		26,858.07	13,169.29
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	105,208.43	21,388.50
负债合计		52,965,044.94	2,225,282.01
净资产:			
实收基金	6.4.7.6	546,069,392.85	1,559,222,920.51
未分配利润	6.4.7.7	20,755,354.23	1,294,875.54
净资产合计		566,824,747.08	1,560,517,796.05
负债和净资产总计		619,789,792.02	1,562,743,078.06

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 546,069,392.85 份。其中国泰海通稳健泰裕债券发起 A 基金份额净值 1.0390 元，基金份额总额 354,226,045.99 份；国泰海通稳健泰裕债券发起 C 基金份额净值 1.0362 元，基金份额总额 191,843,346.86 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金

本报告期：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
一、营业总收入		37,468,735.46
1. 利息收入		996,728.92
其中：存款利息收入	6.4.7.8	77,589.17
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		919,091.62
其他利息收入		48.13
2. 投资收益（损失以“-”填列）		30,794,936.28
其中：股票投资收益	6.4.7.9	24,741,153.32
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.10	5,474,824.22
资产支持证券投资收益		—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	6.4.7.11	-115,620.55
股利收益	6.4.7.12	694,579.29
其他投资收益		—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	5,674,263.52
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. 14	2, 806. 74
减：二、营业总支出		4, 116, 933. 54
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	2, 575, 479. 81
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	643, 869. 97
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	636, 344. 25
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		125, 288. 16
其中：卖出回购金融资产支出		125, 288. 16
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		13, 805. 44
8. 其他费用	6. 4. 7. 15	122, 145. 91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		33, 351, 801. 92
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		33, 351, 801. 92
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		33, 351, 801. 92

注：本基金于 2025 年 11 月 04 日成立，无上年度同期可比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金

本报告期：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, 559, 222, 920. 51	1, 294, 875. 54	1, 560, 517, 796. 05
二、本期期初净资产	1, 559, 222, 920. 51	1, 294, 875. 54	1, 560, 517, 796. 05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	- 1, 013, 153, 527. 66	19, 460, 478. 69	-993, 693, 048. 97
（一）、综合收益总额	-	33, 351, 801. 92	33, 351, 801. 92

(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, 013, 153, 527. 66	-13, 891, 323. 23	- 1, 027, 044, 850. 89
其中：1. 基金申购款	317, 665, 417. 31	7, 746, 633. 77	325, 412, 051. 08
2. 基金赎回款	- 1, 330, 818, 944. 97	-21, 637, 957. 00	- 1, 352, 456, 901. 97
(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	546, 069, 392. 85	20, 755, 354. 23	566, 824, 747. 08

注：本基金于 2025 年 11 月 04 日成立，无上年度同期可比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 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

国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”或“基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予国泰君安稳健泰裕债券型发起式证券投资基金》(证监许可[2025]1428 号)批准，由上海国泰海通证券资产管理有限公司(以下简称“国泰海通资管”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金》(以下简称“基金合同”)发售，基金合同于 2025 年 11 月 4 日生效。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定期，首次设立募集规模为 1, 559, 222, 920. 51 份基金份额，业经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）毕马威华振验字第 2500109 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2025 年 11 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1, 559, 222, 920. 51 份基金份额，其中认购资金利息折合 628, 018. 32 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰海通资管，托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10, 009, 389. 28 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金基金合同》，本基金根据认购费用、申购费用、销售服务费等收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购基金时收取认购费、申购费，而不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购、申购基金时不收取认购费、申购费，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于国内依法发行上市的股票（包括主板、科创板、创业板以及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、国债期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，本基金投资于股票和存托凭证、可交换债券、可转换债券的投资比例为基金资产的 5%-20%，其中投资于境内股票资产的比例不低于基金资产的 5%。每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、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。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

d)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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	3,468,797.52
等于：本金	3,467,940.12
加：应计利息	857.40
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	2,596,553.40
等于：本金	2,596,481.34
加：应计利息	72.06
减：坏账准备	-
合计	6,065,350.92

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

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		93,781,774.28	-	97,979,189.07	4,197,414.79
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	211,512,898.76	1,492,381.37	212,740,381.37	-264,898.76
	银行间市场	291,720,563.75	1,899,832.56	294,432,832.56	812,436.25
	合计	503,233,462.51	3,392,213.93	507,173,213.93	547,537.49
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		597,015,236.79	3,392,213.93	605,152,403.00	4,744,952.28

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	0.50
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	12,154.75
其中：交易所市场	-
银行间市场	12,154.75
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费	23,803.31

预提账户维护费	9,300.00
其他应付	442.50
合计	105,208.43

6.4.7.6 实收基金

国泰海通稳健泰裕债券发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	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	971,224,702.65	971,224,702.65
本期申购	146,274,409.52	146,274,409.52
本期赎回（以“-”号填列）	-763,273,066.18	-763,273,066.18
本期末	354,226,045.99	354,226,045.99

国泰海通稳健泰裕债券发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	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	587,998,217.86	587,998,217.86
本期申购	171,391,007.79	171,391,007.79
本期赎回（以“-”号填列）	-567,545,878.79	-567,545,878.79
本期末	191,843,346.86	191,843,346.86

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

国泰海通稳健泰裕债券发起 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,614,123.40	-578,602.60	1,035,520.80
本期期初	1,614,123.40	-578,602.60	1,035,520.80
本期利润	17,889,008.15	3,483,856.87	21,372,865.02
本期基金份额交易产生的变动数	-7,487,121.66	-1,117,996.70	-8,605,118.36
其中：基金申购款	3,145,709.80	899,503.65	4,045,213.45
基金赎回款	-10,632,831.46	-2,017,500.35	-12,650,331.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,016,009.89	1,787,257.57	13,803,267.46

国泰海通稳健泰裕债券发起 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	610,063.38	-350,708.64	259,354.74
本期期初	610,063.38	-350,708.64	259,354.74
本期利润	9,788,530.25	2,190,406.65	11,978,936.90
本期基金份额交易产生的变动数	-4,411,809.53	-874,395.34	-5,286,204.87
其中：基金申购款	2,728,257.75	973,162.57	3,701,420.32
基金赎回款	-7,140,067.28	-1,847,557.91	-8,987,625.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,986,784.10	965,302.67	6,952,086.77

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	19,595.47
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,038.78
结算备付金利息收入	53,954.92
其他	-
合计	77,589.17

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	635,107,162.74
减：卖出股票成本总额	609,845,053.33
减：交易费用	520,956.09
买卖股票差价收入	24,741,153.32

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	6,065,619.24
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-590,795.02

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	5,474,824.22

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	875,386,175.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	868,231,154.79
减：应计利息总额	7,725,977.98
减：交易费用	19,837.47
买卖债券差价收入	-590,795.02

6.4.7.11 衍生工具收益

6.4.7.11.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
国债期货投资收益	-112,500.00
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	2,446.61
减：交易费用	673.94
合计	-115,620.55

6.4.7.12 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	694,579.29
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	694,579.29

6.4.7.13 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	5,674,263.52
——股票投资	3,902,106.29
——债券投资	1,772,157.23
——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	5,674,263.52

6.4.7.14 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	2,782.31
投资其他基金认购款利息收入	24.42
转换费收入	0.01
合计	2,806.74

6.4.7.15 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	23,803.31
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行汇划费	20,235.23
账户维护费	18,600.00
合计	122,145.91

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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰海通证券	436,222,136.04	37.68%

注：本基金于 2025 年 11 月 04 日成立，无上年度同期可比数据。

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰海通证券	146,245,641.24	100.00%

注：本基金于 2025 年 11 月 04 日成立，无上年度同期可比数据。

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	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰海通证券	5,781,286,000.00	100.00%

注：本基金于 2025 年 11 月 04 日成立，无上年度同期可比数据。

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	51,306.79	34.35%	0.00	0.00%

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
当期发生的基金应支付的管理费	2,575,479.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,210,030.07
应支付基金管理人的净管理费	1,365,449.74

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

$$H=E\times 0.60\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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
当期发生的基金应支付的托管费	643,869.97

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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		
	国泰海通稳健泰裕债券 发起 A	国泰海通稳健泰裕债券 发起 C	合计
建设银行	-	437,304.12	437,304.12
国泰海通资管	-	4,114.30	4,114.30
国泰海通证券	-	110,753.91	110,753.91
合计	-	552,172.33	552,172.33

注：销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，其中，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

本基金 C 类基金份额的基金销售服务费计提的计算公式如下：

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

H 为每日应计提 C 类基金份额的基金销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率从事证券出借业务。

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率从事证券出借业务。

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

国泰海通稳健泰裕债券发起 A

份额单位：份

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	8,009,311.50
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	8,009,311.50
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.26%

国泰海通稳健泰裕债券发起 C

份额单位：份

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	2,000,077.78
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	2,000,077.78
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.04%

注：1. 基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。2. 报告期末持有的本基金份额占基金分类份额比例，比例的分母采用各自类别的份额计算。

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
-------	--

	期末余额	当期利息收入
国泰海通证券	1,059,945.76	1,673.84
建设银行	3,468,797.52	19,595.47

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金的其他存款由基金结算机构国泰海通证券保管，按协议约定利率计息。

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

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	关于筹划发行股份及	4.30	2026-07-09	4.64	21,700	103,854.31	93,310.00	-

			支付现金购买资产并募集配套资金暨关联交易事项							
--	--	--	------------------------	--	--	--	--	--	--	--

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 2026 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 49,999,100.00 元，于 2026 年 7 月 1 日、2026 年 7 月 3 日（先后）到期。该类交易要求本基金在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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。本基金的活期存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，其他银行存款为国泰海通证券股份有限公司保证金、国金证券股份有限公司保证金，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

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	30,204,811.51	100,328,613.70
合计	30,204,811.51	100,328,613.70

- 注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
- 2、本基金持有的未评级债券包括政策性金融债、超短期融资券、公司债。

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	121,746,742.46	87,090,729.32
AAA 以下	-	-
未评级	355,221,659.96	562,793,857.52
合计	476,968,402.42	649,884,586.84

- 注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
- 2、本基金持有的未评级债券包括国债、政策性金融债、公司债、中期票据。

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 49,999,100.00 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%。

本基金所持证券一部分在证券交易所交易，其余亦可在银行间市场交易，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	6,065,350.92	-	-	-	6,065,350.92
结 算 备 付 金	2,044,781.39	-	-	-	2,044,781.39
交 易 性	182,251,690.41	283,847,863.56	41,073,659.96	97,979,189.07	605,152,403.00

金融资产					
应收申购款	-	-	-	6,527,256.71	6,527,256.71
资产总计	190,361,822.72	283,847,863.56	41,073,659.96	104,506,445.78	619,789,792.02
负债					
卖出回购金融资产款	49,999,100.00	-	-	-	49,999,100.00
应付赎回款	-	-	-	2,402,867.06	2,402,867.06
应付管理人报酬	-	-	-	289,668.76	289,668.76
应付托管费	-	-	-	72,417.20	72,417.20
应付销	-	-	-	68,925.42	68,925.42

售 服 务 费					
应 交 税 费	-	-	-	26,858.07	26,858.07
其 他 负 债	-	-	-	105,208.43	105,208.43
负 债 总 计	49,999,100.00	-	-	2,965,944.94	52,965,044.94
利 率 敏 感 度 缺 口	140,362,722.72	283,847,863.56	41,073,659.96	101,540,500.84	566,824,747.08
上 年 度 末 202 5 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	51,019,857.79	-	-	-	51,019,857.79
结 算 备 付	70,104,000.41	-	-	-	70,104,000.41

金					
交易性金融资产	161,359,948.49	426,354,615.89	162,498,636.16	181,344,327.81	931,557,528.35
买入返售金融资产	510,061,691.51	—	—	—	510,061,691.51
资产总计	792,545,498.20	426,354,615.89	162,498,636.16	181,344,327.81	1,562,743,078.06
负债					
应付管理人报酬	—	—	—	1,459,161.33	1,459,161.33
应付托管费	—	—	—	364,790.36	364,790.36
应付销售服务费	—	—	—	366,772.53	366,772.53
应交税	—	—	—	13,169.29	13,169.29

费					
其他负债	-	-	-	21,388.50	21,388.50
负债总计	-	-	-	2,225,282.01	2,225,282.01
利率敏感度缺口	792,545,498.20	426,354,615.89	162,498,636.16	179,119,045.80	1,560,517,796.05

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

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%	-1,402,719.04	-2,620,706.29
	基准利率点利率减少 0.1%	1,424,169.74	2,638,747.88

注：上表反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响

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

响。

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，因此无重大其他价格风险。

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	97,979,189.07	17.29	181,344,327.81	11.62
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	97,979,189.07	17.29	181,344,327.81	11.62

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 17.29%(2025 年 12 月 31 日:11.62%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

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	97,885,879.07	181,180,695.81
第二层次	507,266,523.93	750,376,832.54
第三层次	-	-
合计	605,152,403.00	931,557,528.35

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	97,979,189.07	15.81
	其中：股票	97,979,189.07	15.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	507,173,213.93	81.83

	其中：债券	507,173,213.93	81.83
	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	8,110,132.31	1.31
8	其他各项资产	6,527,256.71	1.05
9	合计	619,789,792.02	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 0.00 元，占期末净值的比例为 0.00%；通过转融通证券出借业务的证券公允价值为 0.00 元，占资产净值的比例为 0.00%。

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	888,340.00	0.16
B	采矿业	5,968,371.80	1.05
C	制造业	69,593,252.42	12.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,695,978.00	0.30
E	建筑业	762,761.00	0.13
F	批发和零售业	2,383,159.00	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	2,971,195.00	0.52
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,241,680.85	0.92
J	金融业	6,240,510.00	1.10
K	房地产业	325,215.00	0.06
L	租赁和商务服务业	303,173.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	1,174,979.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	193,959.00	0.03
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	123,775.00	0.02
S	综合	112,840.00	0.02
	合计	97,979,189.07	17.29

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	300750	宁德时代	11,100	4,362,411.00	0.77
2	300308	中际旭创	2,600	3,302,000.00	0.58
3	300502	新易盛	2,280	1,383,960.00	0.24
4	688256	寒武纪	792	1,263,675.60	0.22
5	300223	北京君正	4,200	1,045,380.00	0.18
6	300408	三环集团	5,850	976,365.00	0.17
7	300475	香农芯创	3,100	930,000.00	0.16
8	300260	新莱应材	7,700	773,542.00	0.14
9	300489	光智科技	2,400	748,680.00	0.13
10	601398	工商银行	91,900	649,733.00	0.11
11	300661	圣邦股份	4,500	645,660.00	0.11
12	300607	拓斯达	15,500	639,065.00	0.11
13	688041	海光信息	1,700	629,510.00	0.11
14	601857	中国石油	70,800	614,544.00	0.11
15	688110	东芯股份	3,000	611,100.00	0.11
16	601899	紫金矿业	24,000	603,360.00	0.11
17	301536	星辰科技	4,600	592,066.00	0.10
18	300857	协创数据	1,700	577,830.00	0.10
19	600019	宝钢股份	104,100	565,263.00	0.10
20	000048	京基智农	25,300	558,877.00	0.10
21	688456	有研粉材	4,000	558,400.00	0.10
22	300274	阳光电源	3,400	540,668.00	0.10
23	300620	光库科技	1,400	529,480.00	0.09
24	688981	中芯国际	3,300	524,106.00	0.09
25	300438	鹏辉能源	6,300	521,955.00	0.09
26	301310	鑫宏业	9,300	513,732.00	0.09
27	601225	陕西煤业	24,200	492,470.00	0.09
28	688559	海目星	5,800	486,736.00	0.09
29	603259	药明康德	3,900	485,589.00	0.09
30	601872	招商轮船	27,600	484,932.00	0.09
31	300715	凯伦股份	29,000	477,340.00	0.08
32	300319	麦捷科技	15,900	471,117.00	0.08

33	688012	中微公司	996	466,626.00	0.08
34	000933	神火股份	22,000	466,400.00	0.08
35	688396	华润微	4,700	458,485.00	0.08
36	601988	中国银行	79,000	451,880.00	0.08
37	301511	德福科技	3,100	445,935.00	0.08
38	300672	国科微	1,500	442,500.00	0.08
39	688469	芯联集成	40,700	431,827.00	0.08
40	601985	中国核电	45,400	409,962.00	0.07
41	688301	奕瑞科技	3,280	406,720.00	0.07
42	688719	爱科赛博	5,200	400,400.00	0.07
43	300033	同花顺	1,640	395,240.00	0.07
44	600176	中国巨石	5,400	393,552.00	0.07
45	601816	京沪高铁	84,300	381,879.00	0.07
46	300136	信维通信	3,200	381,600.00	0.07
47	688090	瑞松科技	3,520	374,704.00	0.07
48	000519	中兵红箭	17,700	372,939.00	0.07
49	300863	卡倍亿	4,820	369,356.60	0.07
50	301021	英诺激光	3,000	365,700.00	0.06
51	601066	中信建投	12,500	363,375.00	0.06
52	601998	中信银行	52,400	363,132.00	0.06
53	300483	首华燃气	19,900	349,842.00	0.06
54	600999	招商证券	16,500	348,150.00	0.06
55	300476	胜宏科技	1,000	346,430.00	0.06
56	601328	交通银行	53,800	345,934.00	0.06
57	688266	泽璟制药	2,900	338,314.00	0.06
58	600309	万华化学	4,900	335,209.00	0.06
59	300820	英杰电气	3,700	333,851.00	0.06
60	600150	中国船舶	9,700	327,763.00	0.06
61	688499	利元亨	6,200	325,810.00	0.06
62	688416	恒烁股份	2,320	324,800.00	0.06
63	600810	神马股份	51,600	318,372.00	0.06
64	002851	麦格米特	1,900	317,642.00	0.06
65	600601	方正科技	22,700	314,168.00	0.06
66	301218	华是科技	7,600	313,120.00	0.06
67	300121	阳谷华泰	24,700	311,220.00	0.05
68	688320	禾川科技	7,500	310,875.00	0.05
69	600547	山东黄金	13,300	307,097.00	0.05
70	300401	花园生物	14,000	306,460.00	0.05
71	688275	万润新能	2,400	306,120.00	0.05
72	002399	海普瑞	33,100	297,238.00	0.05
73	601699	潞安环能	20,500	292,740.00	0.05
74	600919	江苏银行	26,900	289,982.00	0.05
75	601995	中金公司	8,000	289,200.00	0.05

76	300491	通合科技	7,500	286,425.00	0.05
77	001696	宗申动力	13,700	285,097.00	0.05
78	301526	国际复材	6,100	284,687.00	0.05
79	300031	宝通科技	9,900	282,843.00	0.05
80	600188	兖矿能源	15,900	282,543.00	0.05
81	600008	首创环保	103,500	281,520.00	0.05
82	601288	农业银行	45,200	274,364.00	0.05
83	600938	中国海油	10,100	274,215.00	0.05
84	300283	温州宏丰	13,300	273,315.00	0.05
85	600460	士兰微	5,000	273,300.00	0.05
86	600030	中信证券	9,500	272,935.00	0.05
87	601898	中煤能源	22,300	271,614.00	0.05
88	002338	奥普光电	4,700	268,840.00	0.05
89	300346	南大光电	2,900	268,685.00	0.05
90	600546	山煤国际	24,500	267,785.00	0.05
91	600104	上汽集团	27,400	267,424.00	0.05
92	600020	中原高速	71,800	264,942.00	0.05
93	001389	广合科技	1,100	260,975.00	0.05
94	688107	安路科技	5,700	259,920.00	0.05
95	300579	数字认证	12,300	254,610.00	0.04
96	301099	雅创电子	2,600	248,300.00	0.04
97	603986	兆易创新	300	244,500.00	0.04
98	002966	苏州银行	35,000	243,600.00	0.04
99	301389	隆扬电子	2,800	243,012.00	0.04
100	605123	派克新材	2,500	242,525.00	0.04
101	300199	翰宇药业	10,900	240,672.00	0.04
102	300604	长川科技	700	238,994.00	0.04
103	300488	恒锋工具	5,100	238,833.00	0.04
104	601997	贵阳银行	46,500	238,545.00	0.04
105	601009	南京银行	23,800	235,382.00	0.04
106	301248	杰创智能	2,800	235,004.00	0.04
107	002843	泰嘉股份	10,900	234,023.00	0.04
108	600018	上港集团	48,800	230,336.00	0.04
109	002885	京泉华	5,600	228,816.00	0.04
110	688609	九联科技	20,600	226,806.00	0.04
111	688231	隆达股份	6,018	221,041.14	0.04
112	300617	安靠智电	4,100	217,259.00	0.04
113	002391	长青股份	44,600	217,202.00	0.04
114	601777	千里科技	26,600	217,056.00	0.04
115	301116	益客食品	25,342	216,927.52	0.04
116	603516	淳中科技	1,600	215,376.00	0.04
117	300281	金明精机	35,700	215,271.00	0.04
118	300779	惠城环保	4,280	214,856.00	0.04

119	002641	公元股份	55,600	214,616.00	0.04
120	300315	掌趣科技	55,000	214,500.00	0.04
121	600320	振华重工	51,800	213,934.00	0.04
122	688115	思林杰	2,600	213,850.00	0.04
123	600028	中国石化	47,900	213,634.00	0.04
124	688365	光云科技	13,400	211,318.00	0.04
125	002169	智光电气	14,200	207,888.00	0.04
126	601919	中远海控	15,500	205,530.00	0.04
127	603083	剑桥科技	800	203,896.00	0.04
128	601077	渝农商行	33,200	202,852.00	0.04
129	300687	赛意信息	6,500	201,500.00	0.04
130	301178	天亿马	4,000	199,000.00	0.04
131	300425	中建环能	53,200	198,968.00	0.04
132	003016	欣贺股份	32,200	197,386.00	0.03
133	300575	中旗股份	40,000	196,800.00	0.03
134	600887	伊利股份	8,100	194,076.00	0.03
135	600681	百川能源	59,500	192,185.00	0.03
136	600029	南方航空	37,100	192,178.00	0.03
137	601665	齐鲁银行	33,300	192,141.00	0.03
138	600893	航发动力	5,000	191,700.00	0.03
139	600183	生益科技	1,100	190,740.00	0.03
140	688199	久日新材	5,493	189,673.29	0.03
141	002484	江海股份	1,800	189,000.00	0.03
142	002057	中钢天源	15,200	188,936.00	0.03
143	301095	广立微	1,600	188,880.00	0.03
144	301607	富特科技	3,580	187,055.00	0.03
145	300124	汇川技术	2,800	185,724.00	0.03
146	301246	宏源药业	6,900	185,610.00	0.03
147	300613	富瀚微	2,300	184,184.00	0.03
148	301297	富乐德	3,000	183,720.00	0.03
149	001337	四川黄金	5,000	183,300.00	0.03
150	688598	金博股份	3,700	182,965.00	0.03
151	601279	英利汽车	59,900	182,695.00	0.03
152	000032	深桑达 A	7,300	182,135.00	0.03
153	300400	劲拓股份	4,800	180,720.00	0.03
154	300191	潜能恒信	6,500	179,725.00	0.03
155	300568	星源材质	9,600	179,712.00	0.03
156	603530	神马电力	3,500	178,150.00	0.03
157	301571	国科天成	2,700	175,986.00	0.03
158	603439	三力制药	13,900	175,279.00	0.03
159	300756	金马游乐	5,280	174,504.00	0.03
160	000338	潍柴动力	6,400	174,400.00	0.03
161	301392	汇成真空	600	173,184.00	0.03

162	688183	生益电子	1,300	172,120.00	0.03
163	301085	亚康股份	2,800	169,708.00	0.03
164	688653	康希通信	9,700	168,586.00	0.03
165	688108	赛诺医疗	8,850	163,990.50	0.03
166	300394	天孚通信	540	163,447.20	0.03
167	600808	马钢股份	65,100	162,750.00	0.03
168	603876	鼎胜新材	6,200	161,262.00	0.03
169	688378	奥来德	2,600	161,200.00	0.03
170	002245	蔚蓝锂芯	8,600	160,906.00	0.03
171	601375	中原证券	40,200	160,398.00	0.03
172	688175	高凌信息	6,370	160,205.50	0.03
173	600741	华域汽车	10,300	159,856.00	0.03
174	002317	众生药业	6,500	159,705.00	0.03
175	000969	安泰科技	6,500	159,510.00	0.03
176	688172	燕东微	1,900	158,954.00	0.03
177	300582	英飞特	12,900	157,122.00	0.03
178	688343	云天励飞	1,900	155,154.00	0.03
179	002016	世荣兆业	38,700	154,800.00	0.03
180	600395	盘江股份	33,900	154,584.00	0.03
181	301391	卡莱特	2,700	154,170.00	0.03
182	301587	中瑞股份	7,000	153,650.00	0.03
183	000090	天健集团	51,000	153,510.00	0.03
184	601333	广深铁路	55,700	153,175.00	0.03
185	300623	捷捷微电	3,400	152,966.00	0.03
186	301281	科源制药	3,100	152,830.00	0.03
187	688235	百济神州	600	152,766.00	0.03
188	603980	吉华集团	22,800	151,392.00	0.03
189	688373	盟科药业	33,400	151,302.00	0.03
190	300059	东方财富	7,400	150,812.00	0.03
191	603010	万盛股份	8,300	150,396.00	0.03
192	600011	华能国际	19,800	150,282.00	0.03
193	000001	平安银行	14,900	149,745.00	0.03
194	600816	建元信托	61,200	149,328.00	0.03
195	600727	鲁北化工	22,200	149,184.00	0.03
196	688728	格科微	7,000	147,280.00	0.03
197	600269	赣粤高速	37,000	147,260.00	0.03
198	603511	爱慕股份	12,800	147,200.00	0.03
199	688323	瑞华泰	2,600	146,900.00	0.03
200	688690	纳微科技	3,300	145,530.00	0.03
201	301611	珂玛科技	800	144,056.00	0.03
202	301128	强瑞技术	920	143,428.00	0.03
203	688257	新锐股份	1,400	142,660.00	0.03
204	603507	振江股份	4,300	141,427.00	0.02

205	601000	唐山港	33,800	140,270.00	0.02
206	300390	天华新能	1,500	140,265.00	0.02
207	600858	银座股份	31,600	139,356.00	0.02
208	600888	新疆众和	8,600	136,654.00	0.02
209	300905	宝丽迪	2,700	136,620.00	0.02
210	600598	北大荒	12,600	136,584.00	0.02
211	000333	美的集团	1,800	135,954.00	0.02
212	603826	坤彩科技	5,300	135,468.00	0.02
213	300726	宏达电子	1,600	135,312.00	0.02
214	301489	思泉新材	820	134,955.60	0.02
215	000937	冀中能源	33,660	133,966.80	0.02
216	600259	中稀有色	1,300	132,093.00	0.02
217	601766	中国中车	25,400	132,080.00	0.02
218	688350	富淼科技	3,800	131,214.00	0.02
219	603725	天安新材	11,600	131,080.00	0.02
220	002460	赣锋锂业	2,000	130,800.00	0.02
221	000837	秦川机床	11,700	129,987.00	0.02
222	301238	瑞泰新材	5,300	129,320.00	0.02
223	000421	南京公用	26,000	128,960.00	0.02
224	300486	东杰智能	6,000	128,100.00	0.02
225	603158	腾龙股份	10,400	127,192.00	0.02
226	300414	中光防雷	11,500	126,730.00	0.02
227	301349	信德新材	1,700	125,120.00	0.02
228	688028	沃尔德	800	124,696.00	0.02
229	688599	天合光能	8,800	124,256.00	0.02
230	002952	亚世光电	5,600	123,368.00	0.02
231	300953	震裕科技	920	123,004.00	0.02
232	300760	迈瑞医疗	900	122,247.00	0.02
233	603799	华友钴业	2,500	120,650.00	0.02
234	600348	华阳股份	15,700	120,105.00	0.02
235	601658	邮储银行	24,300	119,799.00	0.02
236	603681	永冠新材	5,200	118,820.00	0.02
237	600519	贵州茅台	100	118,549.00	0.02
238	601600	中国铝业	14,400	118,368.00	0.02
239	600037	歌华有线	18,700	117,249.00	0.02
240	688353	华盛锂电	1,000	116,070.00	0.02
241	301057	汇隆新材	5,000	115,000.00	0.02
242	300691	联合光电	7,200	113,832.00	0.02
243	002162	悦心健康	33,600	113,568.00	0.02
244	600827	百联股份	15,300	113,373.00	0.02
245	603283	赛腾股份	1,400	113,372.00	0.02
246	300751	迈为股份	400	112,984.00	0.02
247	600805	悦达投资	28,000	112,840.00	0.02

248	300342	天银机电	2,400	112,800.00	0.02
249	688629	华丰科技	600	112,506.00	0.02
250	301150	中一科技	1,780	112,335.80	0.02
251	301251	威尔高	2,100	111,888.00	0.02
252	688220	翱捷科技	900	111,888.00	0.02
253	300548	长芯博创	400	111,200.00	0.02
254	600549	厦门钨业	1,300	110,760.00	0.02
255	300034	钢研高纳	6,400	109,696.00	0.02
256	000151	中成股份	10,200	109,140.00	0.02
257	301045	天禄科技	1,200	106,896.00	0.02
258	600717	天津港	27,400	106,586.00	0.02
259	002128	电投能源	4,600	106,352.00	0.02
260	301396	宏景科技	320	106,112.00	0.02
261	601168	西部矿业	3,900	105,846.00	0.02
262	002594	比亚迪	1,300	103,610.00	0.02
263	301265	华新科技	3,700	101,935.00	0.02
264	688347	华虹宏力	300	100,890.00	0.02
265	688197	首药控股	3,010	100,564.10	0.02
266	688428	诺诚健华	3,520	100,214.40	0.02
267	000796	凯撒旅业	26,100	99,963.00	0.02
268	600801	华新建材	6,400	99,840.00	0.02
269	600050	中国联通	24,600	98,400.00	0.02
270	301369	联动科技	400	98,000.00	0.02
271	002292	奥飞娱乐	14,900	97,744.00	0.02
272	300014	亿纬锂能	1,500	97,545.00	0.02
273	600339	中油工程	31,700	97,319.00	0.02
274	600026	中远海能	5,400	96,876.00	0.02
275	000690	宝新能源	20,600	96,820.00	0.02
276	300826	测绘股份	6,900	96,600.00	0.02
277	605117	德业股份	900	95,562.00	0.02
278	002886	沃特股份	3,400	95,506.00	0.02
279	601918	新集能源	11,100	95,349.00	0.02
280	600125	铁龙物流	18,800	95,316.00	0.02
281	601069	西部黄金	4,300	94,600.00	0.02
282	002419	天虹股份	22,300	94,329.00	0.02
283	688081	兴图新科	2,300	94,024.00	0.02
284	600623	华谊集团	11,600	93,612.00	0.02
285	300332	天壕能源	21,700	93,310.00	0.02
286	688168	安博通	1,347	92,606.25	0.02
287	600369	西南证券	22,800	91,656.00	0.02
288	600308	华泰股份	30,600	91,494.00	0.02
289	300442	润泽科技	1,100	91,377.00	0.02
290	300433	蓝思科技	1,700	91,222.00	0.02

291	301393	昊帆生物	1,400	90,678.00	0.02
292	301160	翔楼新材	1,935	90,267.75	0.02
293	688202	美迪西	1,100	88,781.00	0.02
294	601126	四方股份	1,400	88,480.00	0.02
295	600585	海螺水泥	5,200	88,140.00	0.02
296	002398	垒知集团	23,500	88,125.00	0.02
297	600971	恒源煤电	12,700	87,630.00	0.02
298	600153	建发股份	11,000	87,230.00	0.02
299	605299	舒华体育	6,500	86,775.00	0.02
300	301206	三元生物	3,900	86,697.00	0.02
301	002364	中恒电气	1,600	86,080.00	0.02
302	300381	溢多利	15,300	85,986.00	0.02
303	601700	风范股份	19,700	85,892.00	0.02
304	603728	鸣志电器	1,400	85,288.00	0.02
305	688309	恒誉环保	1,400	85,232.00	0.02
306	300511	雪榕生物	16,900	85,007.00	0.01
307	603659	璞泰来	2,900	83,897.00	0.01
308	600814	杭州解百	13,600	82,960.00	0.01
309	600638	新黄浦	18,900	82,593.00	0.01
310	002708	光洋股份	6,200	81,778.00	0.01
311	601677	明泰铝业	4,900	81,340.00	0.01
312	600426	华鲁恒升	3,400	81,328.00	0.01
313	600989	宝丰能源	4,000	81,320.00	0.01
314	002487	大金重工	1,400	81,158.00	0.01
315	300512	中亚股份	11,900	81,158.00	0.01
316	001212	中旗新材	1,700	80,546.00	0.01
317	000672	上峰材料	3,400	80,512.00	0.01
318	002521	齐峰新材	11,000	79,640.00	0.01
319	601800	中国交建	13,900	79,369.00	0.01
320	300236	上海新阳	600	78,900.00	0.01
321	301487	盟固利	4,100	78,515.00	0.01
322	300284	苏交科	15,700	78,500.00	0.01
323	002228	合兴包装	26,600	78,204.00	0.01
324	002079	苏州固锝	5,200	78,156.00	0.01
325	600955	维远股份	5,300	78,016.00	0.01
326	600875	东方电气	2,700	77,679.00	0.01
327	300327	中颖电子	2,400	76,920.00	0.01
328	300576	容大感光	1,500	76,830.00	0.01
329	300856	科思股份	7,200	76,752.00	0.01
330	002353	杰瑞股份	500	76,250.00	0.01
331	002218	拓日新能	19,800	76,032.00	0.01
332	688291	金橙子	1,300	76,024.00	0.01
333	002625	光启技术	2,500	75,800.00	0.01

334	000792	盐湖股份	2,500	75,475.00	0.01
335	300410	正业科技	6,800	75,276.00	0.01
336	688192	迪哲医药	1,883	75,188.19	0.01
337	300587	天铁科技	19,300	74,305.00	0.01
338	000988	华工科技	400	73,844.00	0.01
339	688148	芳源股份	8,600	73,788.00	0.01
340	001266	宏英智能	1,500	73,650.00	0.01
341	601127	赛力斯	1,200	73,500.00	0.01
342	300464	星徽股份	10,200	72,726.00	0.01
343	600346	恒力石化	4,100	72,611.00	0.01
344	002443	金洲管道	7,600	72,428.00	0.01
345	600386	北巴传媒	23,100	72,072.00	0.01
346	601186	中国铁建	12,100	71,995.00	0.01
347	300976	达瑞电子	900	71,685.00	0.01
348	600375	汉马科技	19,400	71,586.00	0.01
349	600299	安迪苏	9,100	71,435.00	0.01
350	688596	正帆科技	900	71,154.00	0.01
351	601668	中国建筑	16,300	70,742.00	0.01
352	300481	濮阳惠成	3,700	70,374.00	0.01
353	002111	威海广泰	7,800	70,200.00	0.01
354	688299	长阳科技	4,200	70,182.00	0.01
355	002204	大连重工	13,200	69,696.00	0.01
356	300201	海伦哲	3,300	69,531.00	0.01
357	300450	先导智能	1,700	69,224.00	0.01
358	002028	思源电气	400	69,200.00	0.01
359	000026	飞亚达	3,200	68,928.00	0.01
360	301360	荣旗科技	1,000	68,490.00	0.01
361	688001	华兴源创	795	68,131.50	0.01
362	002136	安纳达	5,200	68,016.00	0.01
363	300496	中科创达	1,100	67,969.00	0.01
364	603950	长源东谷	800	67,544.00	0.01
365	002064	华峰化学	7,100	67,379.00	0.01
366	301568	思泰克	600	66,960.00	0.01
367	300473	德尔股份	2,200	66,880.00	0.01
368	002645	华宏科技	2,420	66,574.20	0.01
369	300602	飞荣达	1,300	66,560.00	0.01
370	603678	火炬电子	800	66,400.00	0.01
371	600884	杉杉股份	4,900	66,395.00	0.01
372	601088	中国神华	1,700	66,368.00	0.01
373	300432	富临精工	3,300	66,297.00	0.01
374	600006	东风股份	12,900	66,177.00	0.01
375	300339	润和软件	1,700	65,467.00	0.01
376	000301	东方盛虹	5,700	65,265.00	0.01

377	600362	江西铜业	1,500	64,950.00	0.01
378	603985	恒润股份	2,700	64,854.00	0.01
379	301260	格力博	4,800	64,848.00	0.01
380	688262	国芯科技	1,500	64,845.00	0.01
381	600961	株冶集团	2,000	64,780.00	0.01
382	003022	联泓新科	2,500	64,750.00	0.01
383	301071	力量钻石	700	64,750.00	0.01
384	002004	华邦健康	16,400	64,452.00	0.01
385	301165	锐捷网络	800	64,360.00	0.01
386	601229	上海银行	7,400	64,232.00	0.01
387	600257	大湖股份	14,600	63,218.00	0.01
388	002080	中材科技	700	63,000.00	0.01
389	300854	中兰环保	3,300	62,964.00	0.01
390	301086	鸿富瀚	300	62,784.00	0.01
391	000426	兴业银锡	1,900	62,624.00	0.01
392	688008	澜起科技	200	61,980.00	0.01
393	002042	华孚时尚	18,100	61,721.00	0.01
394	002491	通鼎互联	1,900	61,560.00	0.01
395	688409	富创精密	200	61,250.00	0.01
396	002468	申通快递	4,200	61,152.00	0.01
397	300107	建新股份	10,900	61,040.00	0.01
398	000831	中国稀土	1,100	61,039.00	0.01
399	601949	中国出版	13,000	60,450.00	0.01
400	688678	福立旺	2,460	59,458.20	0.01
401	600738	丽尚国潮	16,400	59,040.00	0.01
402	300127	银河磁体	2,100	58,695.00	0.01
403	600025	华能水电	6,600	58,674.00	0.01
404	600515	海南机场	21,300	58,362.00	0.01
405	300213	佳讯飞鸿	9,600	58,176.00	0.01
406	002380	科远智慧	1,700	58,106.00	0.01
407	600628	新世界	10,300	57,989.00	0.01
408	601218	吉鑫科技	13,400	57,620.00	0.01
409	688387	信科移动	2,900	57,536.00	0.01
410	301603	乔锋智能	400	57,520.00	0.01
411	000657	中钨高新	600	57,432.00	0.01
412	301210	金杨精密	1,900	57,000.00	0.01
413	300733	西菱动力	4,760	56,882.00	0.01
414	603893	瑞芯微	300	56,508.00	0.01
415	600740	山西焦化	17,500	55,825.00	0.01
416	600015	华夏银行	8,700	55,593.00	0.01
417	600872	中炬高新	3,200	55,552.00	0.01
418	300215	电科院	8,400	55,356.00	0.01
419	601326	秦港股份	17,400	54,984.00	0.01

420	300590	移为通信	3,800	54,530.00	0.01
421	603993	洛阳钼业	3,100	54,405.00	0.01
422	301510	固高科技	1,700	54,281.00	0.01
423	600704	物产中大	11,500	54,280.00	0.01
424	603565	中谷物流	5,500	53,955.00	0.01
425	688787	海天瑞声	400	53,780.00	0.01
426	000061	农产品	9,600	53,760.00	0.01
427	000967	盈峰环境	5,100	53,703.00	0.01
428	600232	金鹰股份	8,500	53,550.00	0.01
429	688237	超卓航科	1,000	53,420.00	0.01
430	603767	中马传动	3,700	52,614.00	0.01
431	002265	建设工业	3,000	52,200.00	0.01
432	002331	皖通科技	7,000	51,730.00	0.01
433	002863	今飞凯达	12,200	51,728.00	0.01
434	603686	福龙马	4,000	51,680.00	0.01
435	600626	申达股份	16,100	51,359.00	0.01
436	300725	药石科技	1,400	51,240.00	0.01
437	688018	乐鑫科技	400	51,168.00	0.01
438	000733	振华科技	900	50,976.00	0.01
439	002730	电光科技	1,700	50,847.00	0.01
440	000505	京粮控股	10,100	50,803.00	0.01
441	688679	通源环境	1,200	50,508.00	0.01
442	002249	大洋电机	6,600	49,500.00	0.01
443	601666	平煤股份	6,900	49,335.00	0.01
444	600482	中国动力	1,500	49,200.00	0.01
445	603390	通达电气	4,700	49,068.00	0.01
446	300997	欢乐家	3,600	48,780.00	0.01
447	000807	云铝股份	2,200	48,708.00	0.01
448	688620	安凯微	3,000	48,600.00	0.01
449	688045	必易微	600	48,468.00	0.01
450	300939	秋田微	700	48,440.00	0.01
451	601916	浙商银行	18,400	48,392.00	0.01
452	002518	科士达	900	48,231.00	0.01
453	002187	广百股份	10,300	48,204.00	0.01
454	300153	科泰电源	2,100	47,502.00	0.01
455	688255	凯尔达	1,700	47,260.00	0.01
456	002648	卫星化学	2,000	46,980.00	0.01
457	600690	海尔智家	2,300	46,943.00	0.01
458	300843	胜蓝股份	300	46,875.00	0.01
459	600256	广汇能源	9,300	45,942.00	0.01
460	300803	指南针	500	45,835.00	0.01
461	002916	深南电路	100	45,790.00	0.01
462	002593	日上集团	11,400	45,486.00	0.01

463	688472	阿特斯	4,200	45,444.00	0.01
464	603895	天永智能	1,600	45,424.00	0.01
465	688772	珠海冠宇	2,300	45,149.00	0.01
466	600166	福田汽车	15,500	45,105.00	0.01
467	002008	大族激光	300	45,033.00	0.01
468	603305	旭升集团	3,700	44,844.00	0.01
469	601399	国机重装	12,800	44,800.00	0.01
470	688700	东威科技	500	44,700.00	0.01
471	301517	陕西华达	900	44,667.00	0.01
472	300087	ST 荃银	8,300	44,654.00	0.01
473	300069	金利华电	1,400	44,562.00	0.01
474	600841	动力新科	7,300	44,530.00	0.01
475	300998	宁波方正	1,600	44,528.00	0.01
476	603006	联明股份	3,100	44,175.00	0.01
477	600498	烽火通信	600	44,160.00	0.01
478	300871	回盛生物	2,000	44,120.00	0.01
479	601366	利群股份	13,600	43,928.00	0.01
480	002125	湘潭电化	3,200	43,712.00	0.01
481	600489	中金黄金	2,400	43,320.00	0.01
482	601138	工业富联	600	43,290.00	0.01
483	300776	帝尔激光	200	42,992.00	0.01
484	688111	金山办公	200	42,610.00	0.01
485	002328	新朋股份	5,800	42,572.00	0.01
486	603086	先达股份	8,200	42,558.00	0.01
487	002969	嘉美包装	3,000	42,240.00	0.01
488	003816	中国广核	10,800	42,228.00	0.01
489	688166	博瑞医药	1,200	42,012.00	0.01
490	688680	海优新材	1,000	42,000.00	0.01
491	002810	山东赫达	1,700	41,990.00	0.01
492	601086	国芳集团	6,300	41,769.00	0.01
493	601111	中国国航	6,900	41,745.00	0.01
494	002811	郑中设计	3,700	41,403.00	0.01
495	600787	中储股份	9,800	40,964.00	0.01
496	000975	山金国际	2,400	40,800.00	0.01
497	600985	淮北矿业	2,900	40,745.00	0.01
498	002090	金智科技	4,600	40,664.00	0.01
499	002531	天顺风能	4,800	40,464.00	0.01
500	301613	新铝时代	1,100	40,073.00	0.01
501	688503	聚和材料	300	39,810.00	0.01
502	301357	北方长龙	500	39,545.00	0.01
503	002009	天奇股份	1,900	39,292.00	0.01
504	002918	蒙娜丽莎	3,900	39,195.00	0.01
505	300918	南山智尚	3,600	38,592.00	0.01

506	688226	威腾电气	900	38,547.00	0.01
507	301662	宏工科技	380	38,501.60	0.01
508	300720	海川智能	400	38,480.00	0.01
509	002054	德美化工	5,700	37,905.00	0.01
510	002112	三变科技	2,300	37,697.00	0.01
511	603396	金辰股份	1,400	37,100.00	0.01
512	002001	新和成	1,300	36,946.00	0.01
513	601500	通用股份	10,100	36,865.00	0.01
514	603270	金帝股份	1,100	36,861.00	0.01
515	600988	赤峰黄金	1,400	36,848.00	0.01
516	603308	应流股份	600	36,240.00	0.01
517	301031	中熔电气	300	35,835.00	0.01
518	600392	盛和资源	1,200	35,724.00	0.01
519	002492	恒基达鑫	6,600	35,706.00	0.01
520	600335	国机汽车	7,600	35,568.00	0.01
521	601156	东航物流	2,200	35,464.00	0.01
522	300592	华凯易佰	2,000	35,400.00	0.01
523	002516	旷达科技	6,300	35,154.00	0.01
524	000970	中科三环	2,300	34,937.00	0.01
525	688246	嘉和美康	1,700	34,935.00	0.01
526	300151	昌红科技	1,400	34,930.00	0.01
527	300737	科顺股份	5,300	34,821.00	0.01
528	603698	航天工程	900	34,704.00	0.01
529	000408	藏格矿业	500	34,660.00	0.01
530	002337	赛象科技	7,800	34,554.00	0.01
531	301219	腾远钴业	630	34,524.00	0.01
532	301216	万凯新材	1,500	34,485.00	0.01
533	600416	湘电股份	3,500	34,300.00	0.01
534	002746	仙坛股份	6,700	34,170.00	0.01
535	300563	神宇股份	1,200	34,068.00	0.01
536	301069	凯盛新材	1,700	34,068.00	0.01
537	603758	秦安股份	3,800	33,972.00	0.01
538	688216	气派科技	800	33,608.00	0.01
539	300907	康平科技	600	33,600.00	0.01
540	002979	雷赛智能	600	33,468.00	0.01
541	002812	恩捷股份	500	33,455.00	0.01
542	603076	乐惠国际	1,600	33,152.00	0.01
543	688158	优刻得	900	33,084.00	0.01
544	688717	艾罗能源	400	33,028.00	0.01
545	688006	杭可科技	900	32,895.00	0.01
546	600031	三一重工	1,900	32,832.00	0.01
547	601139	深圳燃气	5,800	32,828.00	0.01
548	301323	新莱福	400	32,636.00	0.01

549	000593	德龙汇能	1,500	32,070.00	0.01
550	300567	精测电子	100	31,760.00	0.01
551	688716	中研股份	1,000	31,430.00	0.01
552	000895	双汇发展	1,400	31,360.00	0.01
553	000055	方大集团	9,300	31,341.00	0.01
554	688682	霍莱沃	800	31,120.00	0.01
555	000905	厦门港务	4,000	31,040.00	0.01
556	688779	五矿新能	3,815	30,939.65	0.01
557	601117	中国化学	4,200	30,870.00	0.01
558	603333	福华尚纬	3,800	30,628.00	0.01
559	688135	利扬芯片	724	30,465.92	0.01
560	603085	天成自控	2,800	30,436.00	0.01
561	301181	标榜股份	1,300	30,082.00	0.01
562	002943	宇晶股份	680	30,076.40	0.01
563	603025	大豪科技	2,200	30,008.00	0.01
564	300447	全信股份	2,000	29,860.00	0.01
565	600572	康恩贝	7,600	29,792.00	0.01
566	603931	格林达	500	29,700.00	0.01
567	002738	中矿资源	500	29,495.00	0.01
568	301230	泓博医药	800	29,472.00	0.01
569	600027	华电国际	6,600	29,370.00	0.01
570	600886	国投电力	2,200	29,282.00	0.01
571	600089	特变电工	1,300	29,250.00	0.01
572	300909	汇创达	500	29,110.00	0.01
573	300222	科大智能	2,100	29,085.00	0.01
574	601137	博威合金	1,300	29,029.00	0.01
575	605289	罗曼股份	200	29,000.00	0.01
576	603663	三祥新材	300	28,890.00	0.01
577	605138	盛泰集团	5,200	28,704.00	0.01
578	688360	德马科技	1,600	28,640.00	0.01
579	000628	高新发展	600	28,440.00	0.01
580	300872	天阳科技	1,800	28,440.00	0.01
581	002975	博杰股份	200	28,400.00	0.01
582	603185	弘元绿能	1,700	28,373.00	0.01
583	600267	海正药业	2,800	28,308.00	0.00
584	003025	思进智能	2,000	28,160.00	0.00
585	300337	银邦股份	2,400	27,984.00	0.00
586	605222	起帆电缆	1,200	27,984.00	0.00
587	002493	荣盛石化	2,600	27,950.00	0.00
588	605376	博迁新材	100	27,130.00	0.00
589	300763	锦浪科技	300	27,105.00	0.00
590	300445	康斯特	1,300	27,066.00	0.00
591	603051	鹿山新材	1,400	26,992.00	0.00

592	300822	贝仕达克	2,300	26,910.00	0.00
593	002452	长高电气	2,100	26,817.00	0.00
594	000949	新乡化纤	4,200	26,628.00	0.00
595	300891	惠云钛业	4,200	26,586.00	0.00
596	603063	禾望电气	500	26,445.00	0.00
597	300696	爱乐达	1,000	26,030.00	0.00
598	601107	四川成渝	5,300	25,864.00	0.00
599	300697	电工合金	1,700	25,755.00	0.00
600	300239	东宝生物	4,800	25,584.00	0.00
601	688071	华依科技	700	25,508.00	0.00
602	300322	硕贝德	1,000	25,200.00	0.00
603	000868	安凯客车	7,700	25,102.00	0.00
604	300758	七彩化学	2,000	25,100.00	0.00
605	000887	中鼎股份	1,400	25,046.00	0.00
606	002375	亚厦股份	7,400	25,012.00	0.00
607	300817	双飞集团	1,600	24,960.00	0.00
608	603618	杭电股份	500	24,940.00	0.00
609	603132	金徽股份	1,600	24,928.00	0.00
610	603179	新泉股份	500	24,825.00	0.00
611	001314	亿道信息	400	24,720.00	0.00
612	688302	海创药业	700	24,619.00	0.00
613	600903	贵州燃气	3,700	24,568.00	0.00
614	300553	集智股份	400	24,556.00	0.00
615	301052	果麦文化	1,100	24,442.00	0.00
616	601106	中国一重	7,400	24,420.00	0.00
617	688567	孚能科技	2,300	24,150.00	0.00
618	600066	宇通客车	900	24,129.00	0.00
619	601789	宁波建工	6,000	24,060.00	0.00
620	603819	神力股份	2,100	24,045.00	0.00
621	300047	天源迪科	2,700	23,976.00	0.00
622	600057	厦门象屿	4,400	23,848.00	0.00
623	002284	亚太股份	2,500	23,725.00	0.00
624	300458	全志科技	600	23,676.00	0.00
625	600595	中孚实业	4,200	23,604.00	0.00
626	000523	红棉股份	9,100	23,478.00	0.00
627	300768	迪普科技	1,700	23,409.00	0.00
628	002643	万润股份	1,100	23,045.00	0.00
629	300166	东方国信	1,300	23,023.00	0.00
630	600846	同济科技	2,300	23,000.00	0.00
631	300508	维宏股份	400	22,972.00	0.00
632	301358	湖南裕能	300	22,761.00	0.00
633	301067	显盈科技	600	22,692.00	0.00
634	002756	永兴材料	400	22,656.00	0.00

635	002446	盛路通信	2,100	22,554.00	0.00
636	688165	埃夫特	1,100	22,440.00	0.00
637	300806	斯迪克	200	22,400.00	0.00
638	300636	同和药业	3,500	22,295.00	0.00
639	002266	浙富控股	4,400	22,264.00	0.00
640	601882	海天精工	1,100	22,253.00	0.00
641	688586	江航装备	1,900	22,211.00	0.00
642	300917	特发服务	900	21,942.00	0.00
643	300404	博济医药	2,500	21,900.00	0.00
644	600366	宁波韵升	1,489	21,858.52	0.00
645	688390	固德威	200	21,702.00	0.00
646	603032	德新科技	800	21,520.00	0.00
647	688385	复旦微电	300	21,387.00	0.00
648	600115	中国东航	5,600	21,336.00	0.00
649	688523	航天环宇	400	20,960.00	0.00
650	605018	长华集团	1,400	20,874.00	0.00
651	002768	国恩股份	400	20,824.00	0.00
652	688605	先锋精科	200	20,804.00	0.00
653	002237	恒邦股份	1,400	20,566.00	0.00
654	603090	宏盛股份	400	20,424.00	0.00
655	600685	中船防务	800	20,352.00	0.00
656	601963	重庆银行	2,000	20,160.00	0.00
657	002094	青岛金王	4,600	20,148.00	0.00
658	000973	佛塑科技	1,400	20,090.00	0.00
659	600930	华电新能	4,200	20,034.00	0.00
660	603119	浙江荣泰	300	19,902.00	0.00
661	688628	优利德	200	19,788.00	0.00
662	603650	彤程新材	200	19,596.00	0.00
663	000425	徐工机械	2,400	19,416.00	0.00
664	603990	麦迪科技	900	19,161.00	0.00
665	002850	科达利	100	18,930.00	0.00
666	600905	三峡能源	5,100	18,921.00	0.00
667	603587	地素时尚	1,700	18,887.00	0.00
668	600282	南钢股份	4,100	18,819.00	0.00
669	601068	中铝国际	4,300	18,576.00	0.00
670	002179	中航光电	400	18,480.00	0.00
671	000886	海南高速	4,500	18,360.00	0.00
672	601228	广州港	6,500	18,330.00	0.00
673	002056	横店东磁	600	18,288.00	0.00
674	300980	祥源新材	600	17,646.00	0.00
675	301299	卓创资讯	400	17,624.00	0.00
676	605577	龙版传媒	2,000	17,620.00	0.00
677	601975	招商南油	4,700	17,531.00	0.00

678	300896	爱美客	200	17,440.00	0.00
679	002824	和胜股份	500	17,290.00	0.00
680	000589	贵州轮胎	4,200	17,052.00	0.00
681	688676	金盘科技	200	16,928.00	0.00
682	603806	福斯特	1,000	16,790.00	0.00
683	002155	湖南黄金	700	16,709.00	0.00
684	002465	海格通信	1,300	16,601.00	0.00
685	688005	容百科技	540	16,524.00	0.00
686	603638	艾迪精密	700	16,415.00	0.00
687	601727	上海电气	2,300	16,100.00	0.00
688	000060	中金岭南	2,100	15,897.00	0.00
689	000420	吉林化纤	3,900	15,795.00	0.00
690	300373	扬杰科技	100	15,723.00	0.00
691	000825	太钢不锈	4,600	15,686.00	0.00
692	600865	百大集团	1,900	15,561.00	0.00
693	300049	福瑞医科	400	15,552.00	0.00
694	603683	晶华新材	500	15,410.00	0.00
695	601518	吉林高速	5,500	15,400.00	0.00
696	002463	沪电股份	100	15,280.00	0.00
697	002025	航天电器	200	15,244.00	0.00
698	603486	科沃斯	300	15,225.00	0.00
699	300509	新美星	1,800	15,084.00	0.00
700	002752	昇兴股份	2,700	14,904.00	0.00
701	603078	江化微	300	14,826.00	0.00
702	601212	白银有色	2,900	14,732.00	0.00
703	603648	畅联股份	1,700	14,586.00	0.00
704	003035	南网能源	2,500	14,550.00	0.00
705	600352	浙江龙盛	1,200	14,532.00	0.00
706	002455	百川股份	2,000	14,400.00	0.00
707	600674	川投能源	1,000	14,170.00	0.00
708	300996	普联软件	1,300	14,157.00	0.00
709	600469	风神股份	2,600	14,144.00	0.00
710	002432	九安医疗	200	14,136.00	0.00
711	300724	捷佳伟创	200	14,120.00	0.00
712	600223	福瑞达	2,800	14,084.00	0.00
713	603630	拉芳家化	1,100	14,058.00	0.00
714	002846	英联股份	1,300	13,767.00	0.00
715	002917	金奥博	1,300	13,702.00	0.00
716	300698	万马科技	500	13,600.00	0.00
717	301041	金百泽	400	13,500.00	0.00
718	600105	永鼎股份	200	13,496.00	0.00
719	600490	鹏欣资源	2,300	13,386.00	0.00
720	301188	力诺药包	200	13,380.00	0.00

721	600391	航发科技	400	13,380.00	0.00
722	002451	摩恩电气	1,900	13,376.00	0.00
723	300395	菲利华	100	13,373.00	0.00
724	000676	智度股份	2,600	13,286.00	0.00
725	000779	甘咨询	1,700	13,243.00	0.00
726	601018	宁波港	4,200	13,230.00	0.00
727	688321	微芯生物	500	13,165.00	0.00
728	600590	泰豪科技	1,300	13,130.00	0.00
729	300919	中伟新材	300	13,125.00	0.00
730	603886	元祖股份	1,000	12,780.00	0.00
731	600619	海立股份	800	12,680.00	0.00
732	002761	浙江建投	1,900	12,597.00	0.00
733	688181	八亿时空	200	12,520.00	0.00
734	002406	远东传动	1,900	12,464.00	0.00
735	002110	三钢闽光	4,300	12,384.00	0.00
736	000533	顺钠股份	1,300	12,363.00	0.00
737	001282	三联锻造	600	12,228.00	0.00
738	300055	万邦达	1,900	12,217.00	0.00
739	002562	兄弟科技	2,800	12,180.00	0.00
740	000883	湖北能源	2,800	12,096.00	0.00
741	000630	铜陵有色	1,900	12,084.00	0.00
742	688522	纳睿雷达	600	12,012.00	0.00
743	603605	珀莱雅	200	11,984.00	0.00
744	600520	三佳科技	300	11,913.00	0.00
745	605133	嵘泰股份	300	11,811.00	0.00
746	688036	传音控股	200	11,790.00	0.00
747	002067	景兴纸业	3,200	11,776.00	0.00
748	600168	武汉控股	2,900	11,716.00	0.00
749	000776	广发证券	500	11,700.00	0.00
750	603496	恒为科技	500	11,490.00	0.00
751	603915	国茂股份	800	11,352.00	0.00
752	300005	探路者	500	11,300.00	0.00
753	600177	雅戈尔	1,500	11,295.00	0.00
754	002574	明牌珠宝	2,700	11,205.00	0.00
755	605208	永茂泰	700	11,165.00	0.00
756	300933	中辰股份	1,800	10,944.00	0.00
757	600809	山西汾酒	100	10,937.00	0.00
758	605228	神通科技	800	10,744.00	0.00
759	002532	天山铝业	1,000	10,730.00	0.00
760	002283	天润工业	1,100	10,615.00	0.00
761	300054	鼎龙股份	100	10,597.00	0.00
762	300731	科创新源	180	10,504.80	0.00
763	002344	海宁皮城	3,000	10,500.00	0.00

764	301062	上海艾录	1,800	10,278.00	0.00
765	001339	智微智能	100	10,228.00	0.00
766	000068	华控赛格	3,600	10,188.00	0.00
767	601238	广汽集团	2,000	10,160.00	0.00
768	301408	华人健康	700	10,066.00	0.00
769	688225	亚信安全	800	9,936.00	0.00
770	603808	歌力思	1,300	9,841.00	0.00
771	688209	英集芯	338	9,829.04	0.00
772	600061	国投资本	1,500	9,825.00	0.00
773	001283	豪鹏科技	200	9,804.00	0.00
774	600088	中视传媒	900	9,801.00	0.00
775	002132	恒星科技	1,800	9,738.00	0.00
776	603897	长城科技	300	9,738.00	0.00
777	000407	胜利股份	2,600	9,620.00	0.00
778	601101	昊华能源	900	9,504.00	0.00
779	688660	电气风电	1,100	9,482.00	0.00
780	603995	甬金股份	400	9,284.00	0.00
781	002414	高德红外	700	9,282.00	0.00
782	688618	三旺通信	300	9,231.00	0.00
783	301382	蜂助手	200	9,200.00	0.00
784	603519	立霸股份	600	9,180.00	0.00
785	601021	春秋航空	200	9,116.00	0.00
786	688658	悦康药业	700	9,002.00	0.00
787	603285	键邦股份	200	8,962.00	0.00
788	603017	中衡设计	900	8,955.00	0.00
789	002221	东华能源	1,700	8,942.00	0.00
790	603926	铁流股份	500	8,845.00	0.00
791	002320	海峡股份	1,400	8,778.00	0.00
792	688182	灿勤科技	200	8,614.00	0.00
793	000565	渝三峡 A	1,500	8,520.00	0.00
794	600609	金杯汽车	2,700	8,424.00	0.00
795	603178	圣龙股份	600	8,310.00	0.00
796	600189	泉阳泉	1,100	8,283.00	0.00
797	300765	石药创新	300	8,169.00	0.00
798	000983	山西焦煤	1,400	8,120.00	0.00
799	688619	罗普特	500	8,115.00	0.00
800	603345	安井食品	100	8,019.00	0.00
801	000762	西藏矿业	300	8,010.00	0.00
802	603999	读者传媒	1,600	8,000.00	0.00
803	002578	闽发铝业	2,500	7,875.00	0.00
804	603379	三美股份	100	7,589.00	0.00
805	000514	渝开发	2,100	7,518.00	0.00
806	002135	东南网架	1,100	7,469.00	0.00

807	601368	绿城水务	1,800	7,362.00	0.00
808	688382	益方生物	400	7,200.00	0.00
809	300154	瑞凌股份	900	6,768.00	0.00
810	688758	赛分科技	300	6,603.00	0.00
811	000617	中油资本	1,000	6,590.00	0.00
812	601827	三峰环境	900	6,543.00	0.00
813	000708	中信特钢	500	6,310.00	0.00
814	600433	冠豪高新	1,900	6,099.00	0.00
815	300921	南凌科技	300	6,093.00	0.00
816	002666	德联集团	1,500	5,925.00	0.00
817	600389	江山股份	300	5,856.00	0.00
818	002297	博云新材	200	5,798.00	0.00
819	603126	中材节能	900	5,670.00	0.00
820	601390	中国中铁	1,300	5,421.00	0.00
821	600295	鄂尔多斯	500	5,360.00	0.00
822	002734	利民股份	300	5,151.00	0.00
823	000707	双环科技	1,200	5,064.00	0.00
824	600409	三友化工	800	4,888.00	0.00
825	600111	北方稀土	100	4,805.00	0.00
826	605287	德才股份	100	4,149.00	0.00
827	003001	中岩大地	300	3,885.00	0.00
828	601858	中国科传	200	3,462.00	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	300750	宁德时代	6,442,479.00	0.41
2	300483	首华燃气	4,053,946.00	0.26
3	300308	中际旭创	3,649,001.00	0.23
4	300476	胜宏科技	3,289,391.00	0.21
5	300189	神农种业	2,874,331.00	0.18
6	300191	潜能恒信	2,639,462.00	0.17
7	300773	拉卡拉	2,600,592.00	0.17
8	300274	阳光电源	2,386,175.00	0.15
9	300502	新易盛	2,066,902.80	0.13
10	300394	天孚通信	2,023,868.00	0.13
11	300442	润泽科技	2,014,212.00	0.13
12	300548	长芯博创	1,879,027.00	0.12
13	300511	雪榕生物	1,835,728.40	0.12

14	300620	光库科技	1, 835, 183. 00	0. 12
15	300170	汉得信息	1, 834, 399. 00	0. 12
16	300395	菲利华	1, 737, 075. 00	0. 11
17	300244	迪安诊断	1, 716, 307. 00	0. 11
18	301246	宏源药业	1, 710, 983. 00	0. 11
19	300136	信维通信	1, 694, 236. 00	0. 11
20	688183	生益电子	1, 685, 677. 91	0. 11

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

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	300750	宁德时代	12, 362, 139. 0 0	0. 79
2	300308	中际旭创	6, 447, 494. 00	0. 41
3	300502	新易盛	4, 391, 567. 00	0. 28
4	300483	首华燃气	4, 386, 193. 00	0. 28
5	300394	天孚通信	4, 334, 649. 00	0. 28
6	300476	胜宏科技	3, 507, 057. 00	0. 22
7	300274	阳光电源	3, 409, 608. 00	0. 22
8	688041	海光信息	3, 123, 181. 58	0. 20
9	300189	神农种业	3, 095, 319. 00	0. 20
10	300433	蓝思科技	2, 860, 947. 00	0. 18
11	300191	潜能恒信	2, 823, 816. 43	0. 18
12	300773	拉卡拉	2, 773, 064. 00	0. 18
13	300604	长川科技	2, 765, 318. 00	0. 18
14	688981	中芯国际	2, 621, 224. 00	0. 17
15	600188	兖矿能源	2, 573, 084. 00	0. 16
16	300760	迈瑞医疗	2, 418, 561. 00	0. 15
17	688336	三生国健	2, 339, 664. 43	0. 15
18	688256	寒武纪	2, 331, 872. 64	0. 15
19	300548	长芯博创	2, 253, 439. 00	0. 14
20	688347	华虹宏力	2, 127, 272. 87	0. 14

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	522, 577, 808. 30
卖出股票收入（成交）总额	635, 107, 162. 74

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	41,073,659.96	7.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	121,522,637.26	21.44
	其中：政策性金融债	91,149,523.29	16.08
4	企业债券	212,740,381.37	37.53
5	企业短期融资券	20,186,157.81	3.56
6	中期票据	111,650,377.53	19.70
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	507,173,213.93	89.48

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	260002	26 付息国债 02	300,000	31,049,386.74	5.48
2	260403	26 农发 03	300,000	30,206,638.36	5.33
3	102483357	24 首都机场 MTN002A	200,000	20,443,785.21	3.61
4	240115	23 山高 K1	200,000	20,440,048.22	3.61
5	102480137	24 四川机场 MTN001(可持续挂钩)	200,000	20,386,047.12	3.60

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

本基金可投资国债期货。若本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，综合考虑流动性、基差水平、与债券组合相关度等因素，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本产品出于套期保值的目的，会参与国债期货交易，力求控制风险的同时为组合提供正贡献。

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中国农业发展银行，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罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体中信建投证券股份有限公司，2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被证监会分局、深圳证券交易所、中国银行间市场交易商协会警示。

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	—
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	6,527,256.71
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,527,256.71

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
国泰海通稳健泰裕债券发起 A	1,456	243,287.12	52,447,289.60	14.81%	301,778,756.39	85.19%
国泰海通稳健泰裕债券发起 C	1,311	146,333.60	19,229,602.13	10.02%	172,613,744.73	89.98%

合计	2,767	197,350.7 0	71,676,891.7 3	13.13%	474,392,501.1 2	86.87%
----	-------	----------------	-------------------	--------	--------------------	--------

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	国泰海通稳健泰裕债券发起 A	44,545.15	0.0126%
	国泰海通稳健泰裕债券发起 C	201.11	0.0001%
	合计	44,746.26	0.0082%

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

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份额 比例	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,009,389.2 8	1.83%	10,009,389.2 8	1.83%	自基金合同 生效日起不 少于 3 年
基金管理人高级	-	-	-	-	-

管理人员					
基金经理等人员	44,625.93	0.01%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	120.33	-	-	-	-
合计	10,054,135.54	1.84%	10,009,389.28	1.83%	-

注：其他为公司普通员工持有份额，持有期限为不低于 6 个月。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰海通稳健泰裕债券 发起 A	国泰海通稳健泰裕债券 发起 C
基金合同生效日（2025 年 11 月 04 日）基金 份额总额	971,224,702.65	587,998,217.86
本报告期期初基金份额总额	971,224,702.65	587,998,217.86
本报告期基金总申购份额	146,274,409.52	171,391,007.79
减：本报告期基金总赎回份额	763,273,066.18	567,545,878.79
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	354,226,045.99	191,843,346.86

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	
国金证券	2	721,462,835.0	62.32%	98,050.8	65.65%	-

股份有限 公司		0		5		
国泰海通 证券股份 有限公司	2	436, 222, 136. 0 4	37. 68%	51, 306. 7 9	34. 35%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成交总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交总额的 比例	成交 金 额	占当 期权 证成 交总 额的 比例	成交 金额	占当 期基 金成 交总 额的 比例
国金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海 通证券 股份有 限公司	146, 245, 641. 2 4	100. 00 %	5, 781, 286, 000. 0 0	100. 00 %	-	-	-	-

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	国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回和定期定额投资业务的公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2026-01-19
2	国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-01-22
3	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
4	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
5	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下公	证监会指定网站、	2026-03-28

	募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	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
7	国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金 2025 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-03-31
8	国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-04-22
9	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
10	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
11	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
12	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
13	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	证监会指定网站、公司官网	2026-06-27
14	国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金基金合同	证监会指定网站、公司官网	2026-06-27
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

自 2026 年 7 月 27 日起，本基金业绩比较基准由“中债综合全价(总值)指数收益率×85%+中证 500 指数收益率×15%”变更为“中债-新综合全价（1-3 年）指数收益率*85%+中证小盘 500 指数收益率*15%”。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰海通稳健泰裕债券型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、法律意见书；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

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