

国泰海通稳健汇利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03月17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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12

§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	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	48
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	49
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	49
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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	50

§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	53
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	53
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰海通稳健汇利债券型证券投资基金	
基金简称	国泰海通稳健汇利债券	
基金主代码	026590	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 03 月 17 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	791,407,033.25 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰海通稳健汇利债券 A	国泰海通稳健汇利债券 C
下属分级基金的交易代码	026590	026591
报告期末下属分级基金的份 额总额	458,138,491.57 份	333,268,541.68 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%+中证红利指数收益率×10%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%
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 03 月 17 日（基金合同生效日）-2026 年 06 月 30 日）	
	国泰海通稳健汇利债券 A	国泰海通稳健汇利债券 C
本期已实现收益	-424,668.05	-566,401.83
本期利润	-7,412,640.25	-5,369,410.45
加权平均基金份额本期利润	-0.0117	-0.0124
本期加权平均净值利润率	-1.17%	-1.24%
本期基金份额净值增长率	-1.27%	-1.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-5,798,397.54	-4,409,709.81
期末可供分配基金份额利润	-0.0127	-0.0132
期末基金资产净值	452,340,094.03	328,858,831.87
期末基金份额净值	0.9873	0.9868
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	-1.27%	-1.32%

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

平要低于所列数字。

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

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

(4) 本基金于 2026 年 03 月 17 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足半年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰海通稳健汇利债券 A 净值表现

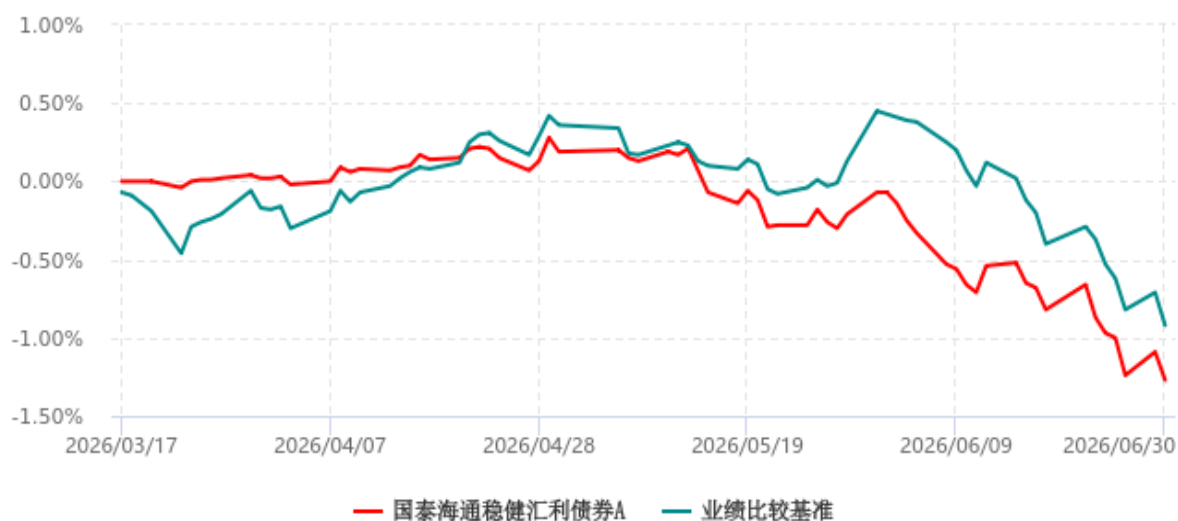
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	-1.29%	0.09%	-0.76%	0.10%	-0.53%	-0.01%
自基金合同生 效起至今	-1.27%	0.09%	-0.92%	0.10%	-0.35%	-0.01%

国泰海通稳健汇利债券 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	-1.33%	0.09%	-0.76%	0.10%	-0.57%	-0.01%
自基金合同生 效起至今	-1.32%	0.09%	-0.92%	0.10%	-0.40%	-0.01%

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

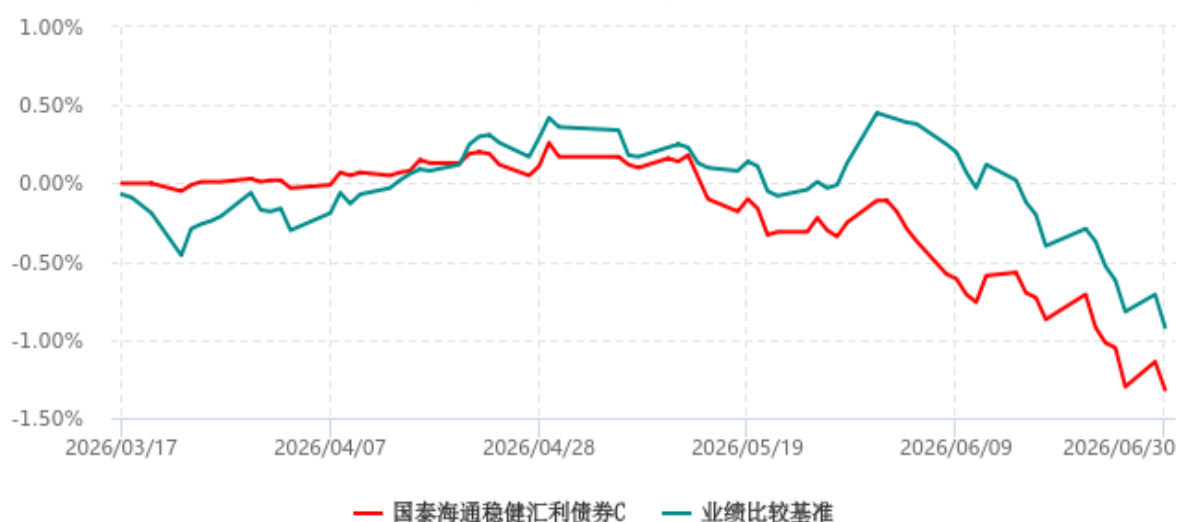
国泰海通稳健汇利债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2026年03月17日-2026年06月30日)



注：1、本基金于 2026 年 03 月 17 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，截止本报告期末基金成立未满六个月。

国泰海通稳健汇利债券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
(2026年03月17日-2026年06月30日)



注：1、本基金于 2026 年 03 月 17 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，截止本报告期末基金成立未满六个月。

§ 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		
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。	2026-03-17	-	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，红利价值板块持续回落，风格分化创近年新高。组合定位低波固收+二级债基，权益部分集中投资红利和价值资产，在上半年承受风格压力，净值有所回撤。

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汇利债券 A 基金份额净值为 0.9873 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.27%，同期业绩比较基准收益率为-0.92%；截至报告期末国泰海通稳健汇利债券 C 基金份额净值为 0.9868 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.32%，同期业绩比较基准收益率为-0.92%。

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，现金流稳定、分红确定性较强、有业绩支撑的高股息资产在深度调整后重新进入配置视野。本组合在定位和风格不漂移下，积极实践红利价值类各细分和侧重的 ETF 轮动策略，在努力控制回撤的同时，追求组合在中长期可实现稳健增长。

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的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰海通稳健汇利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
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	31,239,244.42
结算备付金		3,297,387.15
存出保证金		—
交易性金融资产	6.4.7.2	525,313,537.07
其中：股票投资		15,167,645.00

基金投资		71,328,682.27
债券投资		438,817,209.80
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	250,000,000.00
应收清算款		—
应收股利		—
应收申购款		113,006.00
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.4	—
资产总计		809,963,174.64
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债		—
卖出回购金融资产款		—
应付清算款		—
应付赎回款		28,079,043.54
应付管理人报酬		410,185.91

应付托管费		122,850.34
应付销售服务费		67,893.98
应付投资顾问费		-
应交税费		14,815.81
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.5	69,459.16
负债合计		28,764,248.74
净资产：		
实收基金	6.4.7.6	791,407,033.25
未分配利润	6.4.7.7	-10,208,107.35
净资产合计		781,198,925.90
负债和净资产总计		809,963,174.64

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 791,407,033.25 份。其中国泰海通稳健汇利债券 A 基金份额净值 0.9873 元，基金份额总额 458,138,491.57 份；国泰海通稳健汇利债券 C 基金份额净值 0.9868 元，基金份额总额 333,268,541.68 份。

2、本基金于 2026 年 03 月 17 日成立，本财务报表的实际编制期间为 2026 年 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日止。

6.2 利润表

会计主体：国泰海通稳健汇利债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 03 月 17 日（基金合同 生效日）至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		-10,493,475.38
1. 利息收入		1,804,888.77

其中：存款利息收入	6.4.7.8	118,500.90
债券利息收入		—
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		1,686,385.91
其他利息收入		1.96
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-507,385.80
其中：股票投资收益	6.4.7.9	69,658.66
基金投资收益	6.4.7.10	-3,797,253.44
债券投资收益	6.4.7.11	2,709,895.55
资产支持证券投资收益		—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	6.4.7.12	225,489.63
股利收益	6.4.7.13	284,823.80
其他投资收益		—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-11,790,980.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	2.47
减：二、营业总支出		2,288,575.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,512,801.84
2. 托管费	6.4.10.2.2	453,635.12
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	249,119.46
4. 投资顾问费		—
5. 利息支出		3,636.67
其中：卖出回购金融资产支出		3,636.67
6. 信用减值损失		—
7. 税金及附加		5,099.33
8. 其他费用	6.4.7.16	64,282.90

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-12,782,050.70
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-12,782,050.70
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-12,782,050.70

注：本基金于 2026 年 03 月 17 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：国泰海通稳健汇利债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2026 年 03 月 17 日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	1,086,947,419.85	-	1,086,947,419.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-295,540,386.60	-10,208,107.35	-305,748,493.95
（一）、综合收益总额	-	-12,782,050.70	-12,782,050.70
（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）	-295,540,386.60	2,573,943.35	-292,966,443.25
其中：1. 基金申购款	1,953,164.16	-2,168.39	1,950,995.77
2. 基金赎回款	-297,493,550.76	2,576,111.74	-294,917,439.02
（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	791,407,033.25	-10,208,107.35	781,198,925.90

注：本基金于 2026 年 03 月 17 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

国泰海通稳健汇利债券型证券投资基金（以下简称：“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2025 年 12 月 22 日证监许可【2025】2894 号文注册募集，由上海国泰海通证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰海通稳健汇利债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定期，首次设立募集规模为 1,086,947,419.85 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 2600180 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰海通稳健汇利债券型证券投资基金基金合同》于 2026 年 3 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,086,947,419.85 份基金份额，其中认购资金利息折合 212,101.54 份基金份额。

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《国泰海通稳健汇利债券型证券投资基金基金合同》，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，其中，通过基金管理人认购、申购 A 类基金份额的不收取认购、申购费用；在投资人认购、申购基金时不收取认购费、申购费，而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，其中，通过基金管理人认购、申购 C 类基金份额的不收取销售服务费；通过非直销销售机构认购、申购并持续持有期限超过一年的 C 类基金份额，不再继续收取销售服务费。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰海通稳健汇利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的债券（包括国债、央行票据、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、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板、存托凭证及其他依法发行、上市的股票）、国债期货、信用衍生品、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（不包括 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、其他可投资公募基金的基金、货币市场基金、非本基金管理人管理的基金（股票型 ETF 除外））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的相关规定）。

其中，对于基金投资，本基金可以投资全市场的股票型 ETF（不含 QDII ETF）及基金管理人旗下的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金。其中，计入权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：

- （1）基金合同约定股票及存托凭证资产投资比例不低于基金资产 60%的混合型基金；
- （2）根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票及存托凭证资产占基金资产比

例均不低于 60%的混合型基金。

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：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%。本基金投资组合中股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金等权益类资产及可转换债券（不含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券的比例合计占基金资产的 5%-20%，其中投资于境内股票资产（含境内上市仅投资 A 股的 ETF 及境内股票型基金、混合型基金）的比例不低于基金资产的 8%。本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金投资比例不超过基金资产净值的 10%。每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率 $\times$ 85%+中证红利指数收益率 $\times$ 10%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后） $\times$ 5%。

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 03 月 17 日至 2026 年 06 月 30 日的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的

依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

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

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

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

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

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

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

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

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

(b) 金融负债的分类

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

– 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

– 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

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

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

(b) 金融工具的后续计量

– 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

– 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任

何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

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

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

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

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

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

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

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

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

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

预期信用损失准备的列报

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

核销

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

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购

和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

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

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

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

公允价值变动收益

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

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

(3) 基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 法律、法规或中国证监会另有规定的从其规定。

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	14,629,740.01
等于：本金	14,628,093.72
加：应计利息	1,646.29
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	16,609,504.41
等于：本金	16,609,309.84
加：应计利息	194.57
减：坏账准备	-
合计	31,239,244.42

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		16,387,495.04	-	15,167,645.00	-1,219,850.04
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	41,914,312.36	120,405.48	42,098,205.48	63,487.64
	银行间市场	394,321,304.29	1,777,004.32	396,719,004.32	620,695.71
	合计	436,235,616.65	1,897,409.80	438,817,209.80	684,183.35
资产支持证券		-	-	-	-
基金		82,583,996.40	-	71,328,682.27	-11,255,314.13
其他		-	-	-	-
合计		535,207,108.09	1,897,409.80	525,313,537.07	-11,790,980.82

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	250,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	250,000,000.00	-

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	29.22
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	11,602.50
其中：交易所市场	-
银行间市场	11,602.50
应付利息	-
预提信息披露费	36,551.98
预提审计费	18,275.46
预提账户维护费	3,000.00
合计	69,459.16

6.4.7.6 实收基金

国泰海通稳健汇利债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	646,314,227.10	646,314,227.10
本期申购	988,150.83	988,150.83
本期赎回（以“-”号填列）	-189,163,886.36	-189,163,886.36
本期末	458,138,491.57	458,138,491.57

国泰海通稳健汇利债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	440,633,192.75	440,633,192.75
本期申购	965,013.33	965,013.33
本期赎回（以“-”号填列）	-108,329,664.40	-108,329,664.40
本期末	333,268,541.68	333,268,541.68

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

国泰海通稳健汇利债券 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-424,668.05	-6,987,972.20	-7,412,640.25
本期基金份额交易产生的变动数	-101,823.87	1,716,066.58	1,614,242.71
其中：基金申购款	1,173.47	-1,706.11	-532.64
基金赎回款	-102,997.34	1,717,772.69	1,614,775.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-526,491.92	-5,271,905.62	-5,798,397.54

国泰海通稳健汇利债券 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-566,401.83	-4,803,008.62	-5,369,410.45
本期基金份额交易产生的变动数	-10,049.66	969,750.30	959,700.64
其中：基金申购款	480.36	-2,116.11	-1,635.75
基金赎回款	-10,530.02	971,866.41	961,336.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-576,451.49	-3,833,258.32	-4,409,709.81

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	46,065.26
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,902.20
结算备付金利息收入	68,533.44
其他	-
合计	118,500.90

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 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,595,868.00
减：卖出股票成本总额	1,522,770.26
减：交易费用	3,439.08
买卖股票差价收入	69,658.66

6.4.7.10 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	47,659,472.10
减：卖出/赎回基金成本总额	51,434,061.88
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	230.76
减：交易费用	22,432.90
基金投资收益	-3,797,253.44

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
----	---

债券投资收益——利息收入	2,388,255.26
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	321,640.29
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	2,709,895.55

6.4.7.11.2 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 03 月 17 日（基金合同生效日） 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	1,050,601,777.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,041,892,259.89
减：应计利息总额	8,364,022.49
减：交易费用	23,854.48
买卖债券差价收入	321,640.29

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
国债期货投资收益	229,100.00
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	3,364.08
减：交易费用	246.29
合计	225,489.63

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	107,729.50
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	177,094.30
合计	284,823.80

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-11,790,980.82
——股票投资	-1,219,850.04
——债券投资	684,183.35
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-11,255,314.13
——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	-11,790,980.82

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	2.47
合计	2.47

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	18,275.46
信息披露费	36,551.98
证券出借违约金	-
银行汇划费	6,455.46
账户维护费	3,000.00
合计	64,282.90

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 03 月 17 日（基金合同生效日）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	19,506,133.30	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 03 月 17 日（基金合同生效日）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	1,262,952,533.09	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 03 月 17 日（基金合同生效日）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	7,103,000,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰海通证券	165,678,530.38	100.00%

6.4.10.1.6 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 03 月 17 日（基金合同生效日）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	29,824.95	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 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,512,801.84
其中：应支付销售机构的客户维护费	732,351.42
应支付基金管理人的净管理费	780,450.42

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提，但本基金投资于基金管理人所管理的其他基金的部分不收取管理费。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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中扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他基金部分（若为负数，则取 0）

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 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	453,635.12

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，但本基金投资于基金托管人所托管的其他公开募集证券投资基金的部分不收取托管费。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中扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他公开募集证券投资基金部分（若为负数，则取 0）

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 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰海通稳健汇利债券 A	国泰海通稳健汇利债券 C	合计
国泰海通证券	-	102,416.20	102,416.20
建设银行	-	146,701.20	146,701.20
合计	-	249,117.40	249,117.40

注：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 0.20%。

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：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

C 类基金份额的销售服务费每日计提。

投资者通过基金管理人认购、申购本基金 C 类份额的，不收取销售服务费。对于基金份额持有人持续持有期限超过一年的 C 类份额，不收取销售服务费。

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

本报告期内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 03 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
国泰海通证券	16,609,504.41	3,902.20
建设银行	14,629,740.01	46,065.26

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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的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，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
A-1	—
A-1 以下	—
未评级	10,018,653.70
合计	10,018,653.70

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
AAA	—
AAA 以下	—
未评级	428,798,556.10
合计	428,798,556.10

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。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持证券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 2026 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	31,239,244.42	-	-	-	31,239,244.42
结算备付金	3,297,387.15	-	-	-	3,297,387.15
交易性金融资产	110,894,722.19	211,646,735.89	116,275,751.72	86,496,327.27	525,313,537.07
买入返售金融资产	250,000,000.00	-	-	-	250,000,000.00
应收申购款	-	-	-	113,006.00	113,006.00
资产总计	395,431,353.76	211,646,735.89	116,275,751.72	86,609,333.27	809,963,174.64
负债					
应付赎回款	-	-	-	28,079,043.54	28,079,043.54
应付管理人报	-	-	-	410,185.91	410,185.91

酬					
应付托管费	-	-	-	122,850.34	122,850.34
应付销售服务费	-	-	-	67,893.98	67,893.98
应交税费	-	-	-	14,815.81	14,815.81
其他负债	-	-	-	69,459.16	69,459.16
负债总计	-	-	-	28,764,248.74	28,764,248.74
利率敏感度缺口	395,431,353.76	211,646,735.89	116,275,751.72	57,845,084.53	781,198,925.90

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
	基准利率点利率增加 0.1%	-2,393,503.07
	基准利率点利率减少 0.1%	2,433,345.49

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。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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	15,167,645.00	1.94
交易性金融资产—基金投资	71,328,682.27	9.13
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	86,496,327.27	11.07

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 11.07%，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。

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
第一层次	86,496,327.27
第二层次	438,817,209.80
第三层次	—
合计	525,313,537.07

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	15,167,645.00	1.87
	其中：股票	15,167,645.00	1.87
2	基金投资	71,328,682.27	8.81
3	固定收益投资	438,817,209.80	54.18
	其中：债券	438,817,209.80	54.18
	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	250,000,000.00	30.87
	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	34,536,631.57	4.26
8	其他各项资产	113,006.00	0.01
9	合计	809,963,174.64	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，占期末净资产的比例为 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	—	—
B	采矿业	1,899,820.00	0.24
C	制造业	6,569,635.00	0.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	192,510.00	0.02
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	751,210.00	0.10
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	5,754,470.00	0.74
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	15,167,645.00	1.94

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	600036	招商银行	37,000	1,313,500.00	0.17
2	600482	中国动力	37,000	1,213,600.00	0.16
3	600875	东方电气	37,000	1,064,490.00	0.14
4	601838	成都银行	56,000	991,200.00	0.13
5	601899	紫金矿业	37,000	930,180.00	0.12
6	300059	东方财富	45,000	917,100.00	0.12
7	002353	杰瑞股份	4,700	716,750.00	0.09
8	601166	兴业银行	35,000	579,600.00	0.07
9	600362	江西铜业	12,000	519,600.00	0.07
10	601088	中国神华	13,000	507,520.00	0.06
11	300750	宁德时代	1,000	393,010.00	0.05
12	600926	杭州银行	27,000	390,150.00	0.05
13	601398	工商银行	50,000	353,500.00	0.05
14	601628	中国人寿	10,000	353,500.00	0.05
15	688008	澜起科技	1,000	309,900.00	0.04
16	002142	宁波银行	10,000	296,900.00	0.04
17	600487	亨通光电	2,700	295,218.00	0.04
18	601600	中国铝业	35,000	287,700.00	0.04
19	600938	中国海油	10,000	271,500.00	0.03
20	600026	中远海能	15,000	269,100.00	0.03
21	300124	汇川技术	4,000	265,320.00	0.03
22	300502	新易盛	420	254,940.00	0.03
23	601318	中国平安	5,000	238,700.00	0.03
24	601919	中远海控	17,000	225,420.00	0.03
25	300394	天孚通信	700	211,876.00	0.03
26	002837	英维克	2,600	206,856.00	0.03
27	000001	平安银行	20,000	201,000.00	0.03
28	600970	中材国际	27,000	192,510.00	0.02
29	601872	招商轮船	10,000	175,700.00	0.02
30	000960	锡业股份	4,000	170,760.00	0.02
31	300274	阳光电源	1,000	159,020.00	0.02
32	688981	中芯国际	1,000	158,820.00	0.02
33	002384	东山精密	500	131,175.00	0.02
34	601808	中海油服	12,000	129,720.00	0.02
35	601336	新华保险	2,000	119,320.00	0.02
36	000725	京东方 A	10,000	86,800.00	0.01

37	600377	宁沪高速	7,000	80,990.00	0.01
38	000858	五粮液	1,000	74,000.00	0.01
39	601898	中煤能源	5,000	60,900.00	0.01
40	002126	银轮股份	1,000	49,800.00	0.01

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入 金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600875	东方电气	1,487,171.00	0.19
2	600036	招商银行	1,463,200.00	0.19
3	600482	中国动力	1,328,362.00	0.17
4	601899	紫金矿业	1,266,170.00	0.16
5	601838	成都银行	955,460.00	0.12
6	300059	东方财富	890,550.00	0.11
7	601166	兴业银行	651,050.00	0.08
8	601088	中国神华	597,480.00	0.08
9	600362	江西铜业	558,370.00	0.07
10	002353	杰瑞股份	540,540.00	0.07
11	600926	杭州银行	447,830.00	0.06
12	601600	中国铝业	420,500.00	0.05
13	300750	宁德时代	395,707.00	0.05
14	601628	中国人寿	381,000.00	0.05
15	601398	工商银行	372,200.00	0.05
16	600938	中国海油	369,300.00	0.05
17	601872	招商轮船	364,990.00	0.05
18	600026	中远海能	353,880.00	0.05
19	002142	宁波银行	318,800.00	0.04
20	300124	汇川技术	300,123.00	0.04

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出 金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601872	招商轮船	190,000.00	0.02
2	300308	中际旭创	168,052.00	0.02
3	000708	中信特钢	166,711.00	0.02
4	688009	中国通号	145,260.00	0.02

5	600887	伊利股份	128,150.00	0.02
6	600875	东方电气	127,380.00	0.02
7	000039	中集集团	120,700.00	0.02
8	600326	西藏天路	93,800.00	0.01
9	600027	华电国际	91,200.00	0.01
10	601808	中海油服	76,350.00	0.01
11	601319	中国人保	74,900.00	0.01
12	300775	三角防务	74,460.00	0.01
13	688248	南网科技	57,890.00	0.01
14	002353	杰瑞股份	44,715.00	0.01
15	600377	宁沪高速	36,300.00	0.00

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	17,910,265.30
卖出股票收入（成交）总额	1,595,868.00

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

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	62,726,211.99	8.03
2	央行票据	—	—
3	金融债券	345,975,726.03	44.29
	其中：政策性金融债	345,975,726.03	44.29
4	企业债券	30,115,271.78	3.86
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	438,817,209.80	56.17

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	260403	26 农发 03	1,800,000	181,239,830.14	23.20
2	220208	22 国开 08	500,000	50,710,273.97	6.49
3	250202	25 国开 02	500,000	50,165,794.52	6.42
4	240210	24 国开 10	200,000	21,004,109.59	2.69
5	2600001	26 超长特别国债 01	200,000	20,048,546.45	2.57

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

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，在有效控制风险和回撤的同时，努力实现对组合净值的正贡献。

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国家开发银行，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警告、罚款等。

本基金持有的前十名证券发行主体招商基金管理有限公司，2026 年 3 月因内部制度不完善被证监会分局责令改正。

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	113,006.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	113,006.00

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
国泰海通稳健汇利债券 A	1,367	335,141.54	81,560,195.49	17.80%	376,578,296.08	82.20%
国泰海通稳健汇利债券 C	1,914	174,121.50	32,716,918.47	9.82%	300,551,623.21	90.18%
合计	3,281	241,209.09	114,277,113.96	14.44%	677,129,919.29	85.56%

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	国泰海通稳健汇利债券 A	50,558.15	0.0110%
	国泰海通稳健汇利债券 C	50.01	0.0000%
	合计	50,608.16	0.0064%

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	国泰海通稳健汇利债券 A	0
	国泰海通稳健汇利债券 C	0

开放式基金	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰海通稳健汇利债券 A	0~10
	国泰海通稳健汇利债券 C	0~10
	合计	0~10

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰海通稳健汇利债券 A	国泰海通稳健汇利债券 C
基金合同生效日（2026 年 03 月 17 日）基金份额总额	646,314,227.10	440,633,192.75
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	988,150.83	965,013.33
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	189,163,886.36	108,329,664.40
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	458,138,491.57	333,268,541.68

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	19,506,133.3 0	100.00%	29,824.9 5	100.00%	-
----------------------	---	-------------------	---------	---------------	---------	---

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 泰 海 通 证 券 股 份 有 限 公 司	1,262,952,533.09	100.00 %	7,103,000,000.00	100.00 %	-	-	165,678,530.38	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	国泰海通稳健汇利债券型证券投资基金基金托管协议	证监会指定网站、公司官网	2026-02-13
2	国泰海通稳健汇利债券型证券投资基金基金合同	证监会指定网站、公司官网	2026-02-13
3	国泰海通稳健汇利债券型证券投资基金基金	证监会指定网站、	2026-02-13

	产品资料概要	公司官网	
4	国泰海通稳健汇利债券型证券投资基金招募说明书	证监会指定网站、公司官网	2026-02-13
5	国泰海通稳健汇利债券型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	上海证券报	2026-02-13
6	国泰海通稳健汇利债券型证券投资基金基金份额发售公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2026-02-13
7	国泰海通稳健汇利债券型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2026-03-18
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	国泰海通稳健汇利债券型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	2026-04-10
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	在本报告期内刊登的其他公告	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予国泰海通稳健汇利债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国泰海通稳健汇利债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰海通稳健汇利债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰海通稳健汇利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