

国泰海通鑫逸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:上海银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....1

1.1 重要提示.....1

1.2 目录.....2

§ 2 基金简介6

2.1 基金基本情况6

2.2 基金产品说明6

2.3 基金管理人和基金托管人.....7

2.4 信息披露方式7

2.5 其他相关资料7

§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....7

3.1 主要会计数据和财务指标.....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12

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....12

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明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13

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	14
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	14
§ 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	18
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	44
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	44
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	45
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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45

§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	49
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	49
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰海通鑫逸债券型证券投资基金	
基金简称	国泰海通鑫逸债券	
基金主代码	025625	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 10 月 29 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	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	67,963,651.98 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰海通鑫逸债券 A	国泰海通鑫逸债券 C
下属分级基金的交易代码	025625	025626
报告期末下属分级基金的份 额总额	54,935,788.36 份	13,027,863.62 份

注：2025 年 10 月 29 日，国泰海通鑫逸债券型证券投资基金由海通鑫逸债券型集合资产管理计划变更而来。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取稳健的资产配置策略，主要投资于固定收益类品种，强调资产配置的均衡，分散风险。严格管理权益类品种的投资比例，把握相对确定的股票二级市场投资机会。在风险可控的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征，分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势，自上而下决定类属资产配置及组合久期，并依据内部信用评级系统，深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取的投资策略主要包括类属资产配置策略、利率策略、信用策略等。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。
业绩比较基准	中债-综合全价(总值)指数收益率*85%+中证可转换债券指数收益率*5%+中证 800 指数收益率*5%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金属于债券型基金，预期风险和收益水平低于股票型基金、混合型基金、高于货币市场基金。 本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	周直毅
	联系电话	95521	021-68475608
	电子邮箱	zgxxpl@gtht.com	custody@bosc.cn
客户服务电话		95521	95594
传真		021-38871190	021-68476901
注册地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层	上海市黄浦区中山南路 688 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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 37 层
邮政编码		200011	200120
法定代表人		陶耿	顾建忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	国泰海通鑫逸债券 A	国泰海通鑫逸债券 C
本期已实现收益	1,407,623.21	361,960.78
本期利润	1,619,947.34	390,269.73
加权平均基金份额本期利润	0.0210	0.0195
本期加权平均净值利润率	2.01%	1.90%

本期基金份额净值增长率	1.74%	1.55%
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	716,914.48	156,058.95
期末可供分配基金份额利润	0.0131	0.0120
期末基金资产净值	57,371,825.52	13,349,252.82
期末基金份额净值	1.0443	1.0247
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	1.72%	1.47%

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

国泰海通鑫逸债券 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	0.23%	0.11%	1.40%	0.11%	-1.17%	0.00%
过去六个月	1.74%	0.16%	1.50%	0.11%	0.24%	0.05%
自基金合同生 效起至今	1.72%	0.14%	1.33%	0.10%	0.39%	0.04%

国泰海通鑫逸债券 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	0.14%	0.11%	1.40%	0.11%	-1.26%	0.00%
过去六个月	1.55%	0.16%	1.50%	0.11%	0.05%	0.05%
自基金合同生 效起至今	1.47%	0.14%	1.33%	0.10%	0.14%	0.04%

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

国泰海通鑫逸债券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
(2025年10月29日-2026年06月30日)



注：1、本基金于 2025 年 10 月 29 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。

国泰海通鑫逸债券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
(2025年10月29日-2026年06月30日)



注：1、本基金于 2025 年 10 月 29 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		
李煜	国泰海通鑫逸债券基金经理，国泰海通鑫诚六个月持有期债券基金经理，国泰海通鑫悦债券基金经理，国泰海通鑫选三个月持有期债券基金经理，国泰海通新材料混合发起基金经理，国泰海通低碳经济睿选混合发起基金经理。现任公募权益投资部基金经理。	2025-10-29	-	10 年	李煜，北京大学软件工程硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究所机械行业分析师，长盛基金管理有限公司研究部机械军工行业研究员。2022 年 1 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任权益研究部高级研究员，现任本公司公募权益投资部基金经理。
李佳闻	国泰海通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金经理，国泰海通鑫逸债券基金经理，国泰海通鑫悦债券基金经理，国泰海通鑫选三个月持有期债券基金经理，国泰海	2025-10-29	-	10 年	李佳闻，香港科技大学经济学硕士，历任上海海通证券资产管理有限公司固定收益研究部研究员助理、固定收益三部投资经理助理、公募固收部基金经理助理、基金经理。2025 年 5 月加入上海国泰君安证券

	通安悦债券基金经理，国泰海通鑫诚六个月持有期债券基金经理，国泰海通安裕中短债债券基金经理，国泰海通海升六个月持有期债券基金经理，国泰海通安泰三个月持有债券基金经理，国泰海通安润 90 天持有期中短债债券基金经理。现任固定收益投资部（公募）基金经理。				资产管理有限公司，现任固定收益投资部（公募）基金经理。
钱韬	国泰海通鑫选三个月持有期债券基金经理，国泰海通鑫悦债券基金经理，国泰海通鑫逸债券基金经理，国泰海通稳健欣享债券基金经理。现任固定收益投资部（公募）基金经理。	2025-12-03	-	2 年	钱韬，中央财经大学经济学硕士，曾任平安资产管理有限责任公司交易部交易员、固定收益部投资经理，百年保险资产管理有限公司固定收益部投资经理，上海海通证券资产管理有限公司公募固收部基金经理、副总监。2025 年 11 月加入上海国泰海通证券资产管理有限公司，现任固定收益投资部（公募）基金经理。
田园	国泰海通鑫逸债券基金经理助理，国泰海通鑫选三个月持有期债券基金经理助理，国泰海通鑫悦债券基金经理助理，国泰海通海升六个月持有期债券基金经理助理，国泰海通安泰三个月持有债券基金经理助理，国泰海通鑫诚六个月持有期债券基金经理助理。现任固定收益投资部（上海）基金经理助理。	2026-03-11	-	9 年	田园，美国伊利诺伊大学厄巴纳香槟分校金融专业硕士研究生。历任上海海通证券资产管理有限公司权益研究部研究员助理、研究员，公募固收部基金经理助理；2025 年 11 月加入上海国泰海通证券资产管理有限公司，现任固定收益投资部（上海）基金经理助理。

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

报告期内，产品债券部分以获取票息为主；权益部分配置较为均衡，主要配置于有色、红利等相关板块，成长板块更多以交易的心态参与。产品对贵金属和有色股票的配置中枢较去年有所下降。面对全球地缘政治的不确定性，构建“进可攻、退可守”的投资组合是当前资产配置的第一目标。未来我们可能面对全球货币宽松逐渐退坡的环境，这一环境下权益投资应更多“赚盈利的钱”，选取未来一段时间盈利增长有保证的板块是选股的核心标准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰海通鑫逸债券 A 基金份额净值为 1.0443 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.74%，同期业绩比较基准收益率为 1.50%；截至报告期末国泰海通鑫逸债券 C 基金份额净值为 1.0247 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.55%，同期业绩比较基准收益率为 1.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前内外的宏观经济均存在诸多的不确定性。从国内来看，今年高新技术行业发展较快、但传统行业景气度明显承压，经济的不均衡一直存在；海外来看，地缘冲突始终存在不确定性。这对宏观经济造成两点伤害：第一，全球流动性预计将处于易紧难松的格局；第二，高油价持续压制传统制造业的盈利空间。在这种环境下，我们预计股票指数更可能处于区间震荡的状态，权益的配置结构可能比仓位更加重要。投资那些盈利景气度向上、估值合理的板块，长期看可能是较优的策略。债券市场收益率预计将持续处于低位。在面临诸多不确定性的环境下，债券投资的确定性反而在提升。我们对下半年债券市场的走势相对乐观。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，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，本基金的利润分配情况符合有关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，认为复核内容真实、准确、完整，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：国泰海通鑫逸债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,781,517.35	7,284,611.84
结算备付金		1,122,557.77	1,605,553.12
存出保证金		72,421.23	31,572.65
交易性金融资产	6.4.7.2	67,754,832.61	122,696,929.09
其中：股票投资		3,327,719.28	1,102,438.00
基金投资		14,873.00	-
债券投资		64,412,240.33	121,594,491.09
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	1,000,000.00	-
应收清算款		-	446,335.82
应收股利		9,664.84	-
应收申购款		1,020.00	50,000,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.4	-	-
资产总计		71,742,013.80	182,065,002.52
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		-	2,998,958.90
应付清算款		880,854.27	5,700,882.94
应付赎回款		37,255.69	-
应付管理人报酬		28,784.71	31,937.01
应付托管费		2,878.46	3,193.71
应付销售服务费		3,807.82	2,645.20
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,391.40	2,612.07
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	64,963.11	23,887.50
负债合计		1,020,935.46	8,764,117.33
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	67,963,651.98	170,144,260.98
未分配利润	6.4.7.7	2,757,426.36	3,156,624.21
净资产合计		70,721,078.34	173,300,885.19
负债和净资产总计		71,742,013.80	182,065,002.52

注 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 67,963,651.98 份。其中国泰海通鑫逸债券 A 基金份额净值 1.0443 元，基金份额总额 54,935,788.36 份；国泰海通鑫逸债券 C 基金份额净值 1.0247 元，基金份额总额 13,027,863.62 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰海通鑫逸债券型证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		2,489,799.42
1. 利息收入		19,465.88
其中：存款利息收入	6.4.7.8	14,899.89
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		4,565.99
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,228,737.52
其中：股票投资收益	6.4.7.9	760,828.11
基金投资收益	6.4.7.10	486,702.32

债券投资收益	6.4.7.11	928,371.63
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益	6.4.7.12	52,835.46
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	240,633.08
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	962.94
减：二、营业总支出		479,582.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	253,358.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	25,335.80
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	41,688.13
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		92,094.79
其中：卖出回购金融资产支出		92,094.79
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		3,988.94
8. 其他费用	6.4.7.15	63,116.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,010,217.07
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,010,217.07
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		2,010,217.07

注：本基金于 2025 年 10 月 29 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：国泰海通鑫逸债券型证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	170,144,260.98	3,156,624.21	173,300,885.19
二、本期期初净资产	170,144,260.98	3,156,624.21	173,300,885.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-102,180,609.00	-399,197.85	-102,579,806.85
（一）、综合收益总额	-	2,010,217.07	2,010,217.07
（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）	-102,180,609.00	-2,409,414.92	-104,590,023.92
其中：1. 基金申购款	43,002,483.42	1,067,442.54	44,069,925.96
2. 基金赎回款	-145,183,092.42	-3,476,857.46	-148,659,949.88
（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	67,963,651.98	2,757,426.36	70,721,078.34

注：本基金于 2025 年 10 月 29 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

国泰海通鑫逸债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）由海通鑫逸债券型集合资产管理计划经中国证监会 2025 年 8 月 29 日证监许可[2025]1900 号文准予变更注册而来。海通鑫逸债券型集合资产管理计划变更自原大集合“海通赢家系列一半年鑫集合资产管理计划”，海通赢家系列一半年鑫集合资产管理计划由上海海通证券资产管理有限公司发起设立，自 2013 年 5 月 7 日开始募集并于 2013 年 5 月 7 日结束募集，于 2013 年 5 月 13 日成立。根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用操作指引》的要求，经中国证监会批准，海通赢家系列一半年鑫集合资产管理计划变更为海通鑫逸债券型集合资产管理计划，变更后的《海

通鑫逸债券型集合资产管理计划资产管理合同》自 2021 年 9 月 7 日起生效，《海通赢家系列—半年鑫集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。海通鑫逸债券型集合资产管理计划以通讯方式召开集合计划份额持有人大会，并于 2025 年 10 月 16 日表决通过了《关于海通鑫逸债券型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通鑫逸债券型证券投资基金有关事项的议案》。自 2025 年 10 月 29 日起，《国泰海通鑫逸债券型证券投资基金基金合同》生效，《海通鑫逸债券型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。海通鑫逸债券型集合资产管理计划变更为国泰海通鑫逸债券型证券投资基金，即本基金。本基金为契约型开放式。

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，本基金的基金托管人为上海银行股份有限公司。

根据《国泰海通鑫逸债券型证券投资基金基金合同》，本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。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基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰海通鑫逸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、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券等）、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）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、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 QDIIETF 及商品 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%。本基金投资权益类资产、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券合计占基金资产的比例不超过 20%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的 0%-50%），本基金投资的权益类资产包括股票、存托凭证、股票型基金和计入权益类资产的混合型基金。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。本基金将港股通标的股票投资的比例下限设为零，本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。

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%+中证可转换债券指数收益率*5%+中证 800 指数收益率*5%+银行活期存款利率(税后)*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 中期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	1,781,517.35
等于：本金	1,781,358.47
加：应计利息	158.88
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,781,517.35

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	3,272,783.91	-	3,327,719.28	54,935.37

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	27,063,365.78	369,833.46	27,405,265.16	-27,934.08
	银行间市场	36,555,683.44	463,875.17	37,006,975.17	-12,583.44
	合计	63,619,049.22	833,708.63	64,412,240.33	-40,517.52
资产支持证券		-	-	-	-
基金		12,846.85	-	14,873.00	2,026.15
其他		-	-	-	-
合计		66,904,679.98	833,708.63	67,754,832.61	16,444.00

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	1,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,000,000.00	-

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	11,528.07
其中：交易所市场	10,573.07
银行间市场	955.00
应付利息	-
预提信息披露费	39,671.58
预提审计费	4,463.46

预提账户维护费	9,300.00
合计	64,963.11

6.4.7.6 实收基金

国泰海通鑫逸债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	92,992,023.69	92,992,023.69
本期申购	1,185,632.06	1,185,632.06
本期赎回（以“-”号填列）	-39,241,867.39	-39,241,867.39
本期末	54,935,788.36	54,935,788.36

国泰海通鑫逸债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	77,152,237.29	77,152,237.29
本期申购	41,816,851.36	41,816,851.36
本期赎回（以“-”号填列）	-105,941,225.03	-105,941,225.03
本期末	13,027,863.62	13,027,863.62

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

国泰海通鑫逸债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-234,022.55	2,686,826.69	2,452,804.14
本期期初	-234,022.55	2,686,826.69	2,452,804.14
本期利润	1,407,623.21	212,324.13	1,619,947.34
本期基金份额交易产生的变动数	-456,686.18	-1,180,028.14	-1,636,714.32
其中：基金申购款	6,722.77	56,890.48	63,613.25
基金赎回款	-463,408.95	-1,236,918.62	-1,700,327.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	716,914.48	1,719,122.68	2,436,037.16

国泰海通鑫逸债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-93,085.94	796,906.01	703,820.07
本期期初	-93,085.94	796,906.01	703,820.07
本期利润	361,960.78	28,308.95	390,269.73
本期基金份额交易产生的变动数	-112,815.89	-659,884.71	-772,700.60
其中：基金申购款	372,970.40	630,858.89	1,003,829.29
基金赎回款	-485,786.29	-1,290,743.60	-1,776,529.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	156,058.95	165,330.25	321,389.20

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	12,129.96
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,640.71
其他	129.22
合计	14,899.89

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	35,479,142.88
减：卖出股票成本总额	34,669,303.74
减：交易费用	49,011.03
买卖股票差价收入	760,828.11

6.4.7.10 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	21,093,407.20
减：卖出/赎回基金成本总额	20,587,242.45
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	17,793.46
减：交易费用	1,668.97

基金投资收益	486,702.32
--------	------------

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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	1,230,020.38
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-301,648.75
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	928,371.63

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 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	124,156,566.81
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	123,201,424.80
减：应计利息总额	1,254,645.16
减：交易费用	2,145.60
买卖债券差价收入	-301,648.75

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	35,535.46
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	17,300.00
合计	52,835.46

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	240,633.08
——股票投资	37,441.10
——债券投资	201,165.83
——资产支持证券投资	—
——基金投资	2,026.15
——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	240,633.08

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	962.92
转换费收入	0.02
合计	962.94

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	4,463.46
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	—
银行汇划费	381.47
账户维护费	18,600.00
合计	63,116.51

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
上海银行股份有限公司(以下简称 “上海银行”)	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	72,336,286.80	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰海通证券	113,586,202.92	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰海通证券	1,406,650,000.00	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 01 月 01 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	41,693,496.50	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 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	10,573.07	100.00%	10,573.07	100.00%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	253,358.18
其中：应支付销售机构的客户维护费	74,791.88
应支付基金管理人的净管理费	178,566.30

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 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	25,335.80

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 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：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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 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		
	国泰海通鑫逸债券 A	国泰海通鑫逸债券 C	合计
国泰海通证券	-	5,202.97	5,202.97
国泰海通资管	-	7.32	7.32
上海银行	-	8.40	8.40
合计	-	5,218.69	5,218.69

注：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 0.4%。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.4% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

国泰海通鑫逸债券 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	4,872,319.69
报告期内申购/买入总份额	—
报告期内因拆分变动份额	—
减：报告期内赎回/卖出总份额	—
报告期末持有的基金份额	4,872,319.69
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.87%

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
上海银行	1,781,517.35	12,129.96

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行上海银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；本基金在场外申赎基金份额均通过具有基金销售资格的金融机构进行，违约风险可能性很小。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	3,019,445.75	11,491,293.26
合计	3,019,445.75	11,491,293.26

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。

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	37,006,136.19	73,956,017.55
AAA 以下	16,171,680.42	15,925,953.97
未评级	8,214,977.97	20,221,226.31
合计	61,392,794.58	110,103,197.83

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、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，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 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	1,781,517.35	-	-	-	1,781,517.35
结算备付金	1,122,557.77	-	-	-	1,122,557.77
存出保证金	72,421.23	-	-	-	72,421.23
交易性金融资产	14,726,766.51	40,461,032.63	9,224,441.19	3,342,592.28	67,754,832.61
买入返售金融资产	1,000,000.00	-	-	-	1,000,000.00
应收股利	-	-	-	9,664.84	9,664.84
应收申购款	-	-	-	1,020.00	1,020.00
资产总计	18,703,262.86	40,461,032.63	9,224,441.19	3,353,277.12	71,742,013.80
负债					
应付清算款	-	-	-	880,854.27	880,854.27
应付赎回款	-	-	-	37,255.69	37,255.69
应付管理人报酬	-	-	-	28,784.71	28,784.71
应付托管费	-	-	-	2,878.46	2,878.46
应付销售	-	-	-	3,807.82	3,807.82

服务费					
应交税费	-	-	-	2,391.40	2,391.40
其他负债	-	-	-	64,963.11	64,963.11
负债总计	-	-	-	1,020,935.46	1,020,935.46
利率敏感度缺口	18,703,262.86	40,461,032.63	9,224,441.19	2,332,341.66	70,721,078.34
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,284,611.84	-	-	-	7,284,611.84
结算备付金	1,605,553.12	-	-	-	1,605,553.12
存出保证金	31,572.65	-	-	-	31,572.65
交易性金融资产	16,236,447.46	87,165,341.05	18,192,702.58	1,102,438.00	122,696,929.09
应收清算款	-	-	-	446,335.82	446,335.82
应收申购款	-	-	-	50,000,000.00	50,000,000.00
资产总计	25,158,185.07	87,165,341.05	18,192,702.58	51,548,773.82	182,065,002.52
负债					
卖出回购金融资产款	2,998,958.90	-	-	-	2,998,958.90
应付清算款	-	-	-	5,700,882.94	5,700,882.94
应付管理人报酬	-	-	-	31,937.01	31,937.01
应付托管费	-	-	-	3,193.71	3,193.71
应付销售服务费	-	-	-	2,645.20	2,645.20
应交税费	-	-	-	2,612.07	2,612.07
其他负债	-	-	-	23,887.50	23,887.50
负债总计	2,998,958.90	-	-	5,765,158.43	8,764,117.33
利率敏感度缺口	22,159,226.17	87,165,341.05	18,192,702.58	45,783,615.39	173,300,885.19

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%	-197,737.54	-414,414.16
	基准利率点利率减少 0.1%	199,251.47	417,612.49

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	513,417.28	-	513,417.28
应收股利	-	9,664.84	-	9,664.84
资产合计	-	523,082.12	-	523,082.12
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	523,082.12	-	523,082.12
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	326,029.00	-	326,029.00
资产合计	-	326,029.00	-	326,029.00

以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	326,029.00	-	326,029.00

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	(1) 假设本基金的单一外币汇率变化 1%，其他变量不变；(2) 此项影响未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动；(3) 计算外汇风险敏感性时，包含了远期外汇敞口		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	港币相对人民币贬值 1%	-5,230.82	-3,260.29
	港币相对人民币升值 1%	5,230.82	3,260.29

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		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	3,327,719.28	4.71	1,102,438.00	0.64
交易性金融资产—基金投资	14,873.00	0.02	-	-
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	3,342,592.2	4.73	1,102,438.0	0.64

	8		0	
--	---	--	---	--

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 4.73%(2025 年 12 月 31 日:0.64%)，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	3,565,588.31	1,102,438.00
第二层次	64,189,244.30	121,594,491.09
第三层次	-	-
合计	67,754,832.61	122,696,929.09

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	3,327,719.28	4.64
	其中：股票	3,327,719.28	4.64
2	基金投资	14,873.00	0.02
3	固定收益投资	64,412,240.33	89.78
	其中：债券	64,412,240.33	89.78
	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	1,000,000.00	1.39
	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	2,904,075.12	4.05
8	其他各项资产	83,106.07	0.12
9	合计	71,742,013.80	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 513,417.28 元，占期末净值的比例为 0.73%；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	349,512.00	0.49
C	制造业	2,077,832.00	2.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
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	386,958.00	0.55
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	2,814,302.00	3.98

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
原材料	142,789.62	0.20
能源	370,627.66	0.52
合计	513,417.28	0.73

注：以上分类采用全球行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601899	紫金矿业	10,000	251,400.00	0.36
1	02899	紫金矿业	6,000	142,789.62	0.20
2	00883	中国海洋石油	21,000	370,627.66	0.52
3	000960	锡业股份	6,700	286,023.00	0.40
4	688008	澜起科技	600	185,940.00	0.26

5	601398	工商银行	23,700	167,559.00	0.24
6	688711	宏微科技	3,400	154,530.00	0.22
7	300763	锦浪科技	1,700	153,595.00	0.22
8	688126	沪硅产业	3,400	135,626.00	0.19
9	300285	国瓷材料	1,300	134,134.00	0.19
10	300567	精测电子	400	127,040.00	0.18
11	688002	睿创微纳	800	123,752.00	0.17
12	601288	农业银行	18,900	114,723.00	0.16
13	001301	尚太科技	1,200	112,212.00	0.16
14	688301	奕瑞科技	900	111,600.00	0.16
15	601988	中国银行	18,300	104,676.00	0.15
16	600301	华锡有色	1,600	98,112.00	0.14
17	300737	科顺股份	12,400	81,468.00	0.12
18	603225	新凤鸣	3,900	76,635.00	0.11
19	688041	海光信息	200	74,060.00	0.10
20	603308	应流股份	1,200	72,480.00	0.10
21	688019	安集科技	200	67,892.00	0.10
22	603890	春秋电子	2,300	63,526.00	0.09
23	002859	洁美科技	500	54,755.00	0.08
24	600549	厦门钨业	500	42,600.00	0.06
25	600111	北方稀土	300	14,415.00	0.02
26	000831	中国稀土	100	5,549.00	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	601899	紫金矿业	1,933,615.00	1.12
2	600988	赤峰黄金	1,572,778.00	0.91
3	03330	灵宝黄金	1,403,835.27	0.81
4	300837	浙矿股份	1,307,084.00	0.75
5	600961	株冶集团	1,281,627.00	0.74
6	000960	锡业股份	1,216,671.00	0.70
7	03939	万国黄金集团	1,211,737.30	0.70
8	02899	紫金矿业	1,044,815.15	0.60
9	000975	山金国际	950,089.00	0.55
10	01818	招金矿业	946,743.36	0.55
11	00883	中国海洋石油	894,786.65	0.52
12	603799	华友钴业	850,652.00	0.49
13	000603	盛达资源	739,526.00	0.43

14	06693	赤峰黄金	702,079.83	0.41
15	00700	腾讯控股	694,750.97	0.40
16	600989	宝丰能源	656,839.00	0.38
17	601088	中国神华	656,563.00	0.38
18	300750	宁德时代	513,531.00	0.30
19	02162	康诺亚-B	484,438.00	0.28
20	002532	天山铝业	424,252.00	0.24

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	600988	赤峰黄金	1,924,294.00	1.11
2	601899	紫金矿业	1,730,335.00	1.00
3	600961	株冶集团	1,663,185.00	0.96
4	03939	万国黄金集团	1,513,628.82	0.87
5	300837	浙矿股份	1,255,935.00	0.72
6	03330	灵宝黄金	1,224,492.96	0.71
7	000975	山金国际	1,169,263.00	0.67
8	000960	锡业股份	976,643.00	0.56
9	02899	紫金矿业	956,309.03	0.55
10	01818	招金矿业	912,980.78	0.53
11	603799	华友钴业	854,460.00	0.49
12	000603	盛达资源	824,997.00	0.48
13	06693	赤峰黄金	774,495.43	0.45
14	601088	中国神华	677,847.00	0.39
15	00700	腾讯控股	639,981.49	0.37
16	600989	宝丰能源	610,506.00	0.35
17	300750	宁德时代	575,705.00	0.33
18	000657	中钨高新	462,760.00	0.27
19	002155	湖南黄金	449,962.55	0.26
20	02162	康诺亚-B	448,594.88	0.26

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	36,857,143.92
卖出股票收入（成交）总额	35,479,142.88

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	8,241,204.38	11.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	22,327,156.45	31.57
	其中: 政策性金融债	-	-
4	企业债券	21,449,554.88	30.33
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	11,153,847.07	15.77
7	可转债(可交换债)	222,996.03	0.32
8	同业存单	-	-
9	其他	1,017,481.52	1.44
10	合计	64,412,240.33	91.08

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	232280012	22 广州银行 二级资本债 01	50,000	5,327,239.73	7.53
2	232380008	23 广州农商 行二级资本债 01	50,000	5,321,886.30	7.53
3	232380082	23 浙商银行 二级资本债 02	50,000	5,321,349.32	7.52
4	232380088	23 苏州银行 二级 01	50,000	5,299,558.36	7.49
5	102280233	22 福州城投 MTN001	40,000	4,097,494.58	5.79

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货的投资，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定适度参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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东方证券股份有限公司，及其分部 2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被证监会分局、北京证券交易所警告。

本基金持有的前十名证券发行主体广州农村商业银行股份有限公司，其分支行 2025 年 12 月因违规经营被国家金融监督管理总局地方监管局罚款。

本基金持有的前十名证券发行主体广州银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局地方监管局罚款。

本基金持有的前十名证券发行主体苏州银行股份有限公司，2026 年 6 月因资金类违规被中国人民银行分支行警告，其分支行 2025 年 7 月、2026 年 4 月因违规经营被国家金融监督管理总局地方监管局罚款。

本基金持有的前十名证券发行主体浙商银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 7 月至 2026

年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行及分支行、国家外汇管理局地方分局罚款、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	72,421.23
2	应收清算款	-
3	应收股利	9,664.84
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,020.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	83,106.07

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128134	鸿路转债	178,086.97	0.25
2	113605	大参转债	44,909.06	0.06

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	持有人	户均持有	持有人结构
-----	-----	------	-------

别	户数 (户)	的基金份 额	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 通鑫逸 债券 A	196	280,284.6 3	38,928,398.9 5	70.86%	16,007,389.4 1	29.14%
国泰海 通鑫逸 债券 C	85	153,268.9 8	11,710,960.2 5	89.89%	1,316,903.37	10.11%
合计	281	241,863.5 3	50,639,359.2 0	74.51%	17,324,292.7 8	25.49%

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	国泰海通鑫逸债券 A	92,504.00	0.1684%
	国泰海通鑫逸债券 C	6,470.27	0.0497%
	合计	98,974.27	0.1456%

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	国泰海通鑫逸债券 A	0~10
	国泰海通鑫逸债券 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式 基金	国泰海通鑫逸债券 A	0
	国泰海通鑫逸债券 C	0
	合计	0

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰海通鑫逸债券 A	国泰海通鑫逸债券 C
基金合同生效日（2025 年 10 月 29 日）基金份额总额	21,104,480.43	3,750,152.54
本报告期期初基金份额总额	92,992,023.69	77,152,237.29
本报告期基金总申购份额	1,185,632.06	41,816,851.36
减：本报告期基金总赎回份额	39,241,867.39	105,941,225.03
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	54,935,788.36	13,027,863.62

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如下：

2026 年 6 月，樊玲同志担任上海银行股份有限公司资产托管部见习总经理助理。上述人事变动已进行备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人受稽查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人相关从业人员受稽查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

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	72,336,286.80	100.00%	10,573.07	100.00%	-

注：本基金为原券商资管大集合产品参公改造而成，因政策原因，仅能与本基金管理人（上海国泰海通证券资产管理有限公司）之母公司（国泰海通证券股份有限公司）签订交易单元租用协议，租用其交易单元进行证券交易。后续如果相关政策放开，本基金将按照监管要求，租用多个证券公司交易单元进行证券交易。

10.7.2 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	113,586,202.92	100.00%	1,406,650,000.00	100.00%	-	-	41,693,496.50	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	国泰海通鑫逸债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-01-22
2	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年 4 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2026-01-22
3	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2026-03-11
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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公	2026-03-24

		司官网、上交所	
5	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
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	国泰海通鑫逸债券型证券投资基金 2025 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-03-31
8	国泰海通鑫逸债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-04-22
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、上交所	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	在本报告期内刊登的其他公告	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260107-20260630	29,190,372.76	-	-	29,190,372.76	42.95%
产品特有风险							
本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%,则面临大额赎回的情况,可能导致: (1)基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对,可能会产生基金仓位调整困难,导致流动性风险;如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延赎回,如果连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响; (2)基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平;							

- | |
|---|
| <p>(3)因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动;</p> <p>(4)基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;</p> <p>(5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p> |
|---|

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、中国证监会准予海通鑫逸债券型集合资产管理计划变更注册的批复;
- 2、《国泰海通鑫逸债券型证券投资基金基金合同》;
- 3、《国泰海通鑫逸债券型证券投资基金托管协议》;
- 4、《国泰海通鑫逸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