

国泰海通君得盈债券型证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 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 03 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年03月20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。

本报告期自2025年01月01日起至2025年12月31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、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	13
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 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	18
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	19
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	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	19
§ 6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§ 7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	25
7.4 报表附注	26
§ 8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
8.3 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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	76
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	92
8.6 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	92
8.7 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	93

8.8 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.....	93
8.9 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	93
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	93
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	93
8.12 投资组合报告附注	93
§ 9 基金份额持有人信息.....	95
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	95
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	96
9.3 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	96
§ 10 开放式基金份额变动.....	96
§ 11 重大事件揭示	97
11.1 基金份额持有人大会决议	97
11.2 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.....	97
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	98
11.4 基金投资策略的改变	98
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	98
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	98
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	98
11.8 其他重大事件.....	99
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	103
12.1 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	103
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	103

§ 13 备查文件目录	104
13.1 备查文件目录	104
13.2 存放地点	104
13.3 查阅方式	104

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰海通君得盈债券型证券投资基金		
基金简称	国泰海通君得盈债券		
基金主代码	952020		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021 年 01 月 28 日		
基金管理人	上海国泰海通证券资产管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,937,945,286.27 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	国泰海通君得盈债券 A	国泰海通君得盈债券 C	国泰海通君得盈债券 D
下属分级基金的交易代码	952020	952320	023210
报告期末下属分级基金的份额总额	1,925,792,327.72 份	12,099,857.74 份	53,100.81 份

注：2025 年 7 月 25 日，上海国泰君安证券资产管理有限公司变更名称为上海国泰海通证券资产管理有限公司。国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划合同生效日为 2021 年 1 月 28 日。“国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划”于 2022 年 1 月 17 日起正式变更为“国泰君安君得盈债券型证券投资基金”。国泰海通君得盈债券型证券投资基金由国泰君安君得盈债券型证券投资基金变更而来。国泰海通君得盈债券型证券投资基金基金合同生效日为 2025 年 9 月 29 日。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以固定收益品种为主要投资对象，在以资产安全性为优先考虑的前提下，力争获取风险控制下更高的稳健收益。
投资策略	<p>本基金将在资产配置策略的基础上，通过固定收益类品种投资策略构筑债券组合的平稳收益。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将研究与跟踪中国宏观经济运行状况和资本市场变动特征，依据定量分析和定性分析相结合的方法，考虑经济环境、政策取向、类别资产收益风险预期等因素，采取“自上而下”的方法将基金资产在债券与股票等资产类别之间进行动态资产配置。</p> <p>本基金将在稳健的资产配置策略基础上，根据股票的运行状况和收益预期，在严格控制风险的基础上，积极并适时适度地参与权益类资产配置，把握市场时机力争为基金资产获取增强型回报。</p>

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海国泰海通证券资产管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	王小飞
	联系电话	021-38676022	021-60637103
	电子邮箱	zgxxpl@gtht.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95521	021-60637228
传真		021-38871190	021-60635778
注册地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200011	100033
法定代表人		陶耿	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gthtzg.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年			2024 年			2023 年		
	国泰海 通君得 盈债券 A	国泰海 通君得 盈债券 C	国泰海 通君得 盈债券 D	国泰海 通君得 盈债券 A	国泰海 通君得 盈债券 C	国泰海 通君得 盈债券 D	国泰海 通君得 盈债券 A	国泰海 通君得 盈债券 C	国泰海 通君得 盈债券 D
本期已 实现收 益	6,842, 039.12	1,418, 816.28	252,81 2.19	46,747 .38	29,280 .34	-	2,482, 102.85	1,781, 477.57	-
本期利 润	30,311 ,839.0 3	1,301, 158.21	201,78 5.20	400,59 8.96	372,00 8.81	-	70,183 .55	115,68 9.41	-
加权平 均基金 份额本 期利润	0.0518	0.0408	0.0047	0.0059	0.0081	-	0.0008	- 0.0019	-
本期加 权平均 净值利 润率	4.90%	4.06%	0.45%	0.60%	0.83%	-	0.08%	-0.19%	-
本期基 金份额 净值增 长率	4.91%	4.49%	5.80%	1.72%	1.30%	-	-0.26%	-0.66%	-
3.1.2 期末数 据和指 标	2025 年末			2024 年末			2023 年末		
期末可 供分配 利润	115,23 5,604. 52	479,70 3.23	2,931. 29	441,48 9.29	- 245,60 9.21	-	59,570 .33	- 542,45 7.41	-
期末可 供分配 基金份 额利润	0.0598	0.0396	0.0552	0.0091	- 0.0060	-	0.0007	- 0.0104	-
期末基 金资产 净值	2,060, 025,36 9.23	12,695 ,254.7 6	56,588 .99	49,314 ,172.2 9	40,806 ,281.1 5	-	85,498 ,514.4 3	51,785 ,543.0 4	-
期末基	1.0697	1.0492	1.0657	1.0196	1.0041	-	1.0024	0.9912	-

金份额净值									
3.1.3 累计期末指标	2025 年末			2024 年末			2023 年末		
基金份额累计净值增长率	6.65%	4.65%	5.80%	1.66%	0.15%	-	-0.06%	-1.14%	-

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰海通君得盈债券 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.29%	0.39%	0.45%	0.10%	0.84%	0.29%
过去六个月	4.64%	0.29%	1.56%	0.09%	3.08%	0.20%
过去一年	4.91%	0.23%	2.52%	0.09%	2.39%	0.14%
过去三年	6.44%	0.22%	12.68%	0.10%	-6.24%	0.12%
自基金合同生效起至今	6.65%	0.23%	15.94%	0.11%	-9.29%	0.12%

国泰海通君得盈债券 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.18%	0.39%	0.45%	0.10%	0.73%	0.29%
过去六个月	4.42%	0.29%	1.56%	0.09%	2.86%	0.20%
过去一年	4.49%	0.23%	2.52%	0.09%	1.97%	0.14%
过去三年	5.15%	0.22%	12.68%	0.10%	-7.53%	0.12%
自基金合同生效起至今	4.65%	0.23%	16.72%	0.11%	-12.07%	0.12%

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

国泰海通君得盈债券 D 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.32%	0.39%	0.45%	0.10%	0.87%	0.29%
过去六个月	4.29%	0.30%	1.56%	0.09%	2.73%	0.21%
自基金合同生效起至今	5.80%	0.24%	2.68%	0.09%	3.12%	0.15%

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

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

国泰海通君得盈债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年01月28日-2025年12月31日)



国泰海通君得盈债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年03月09日-2025年12月31日)



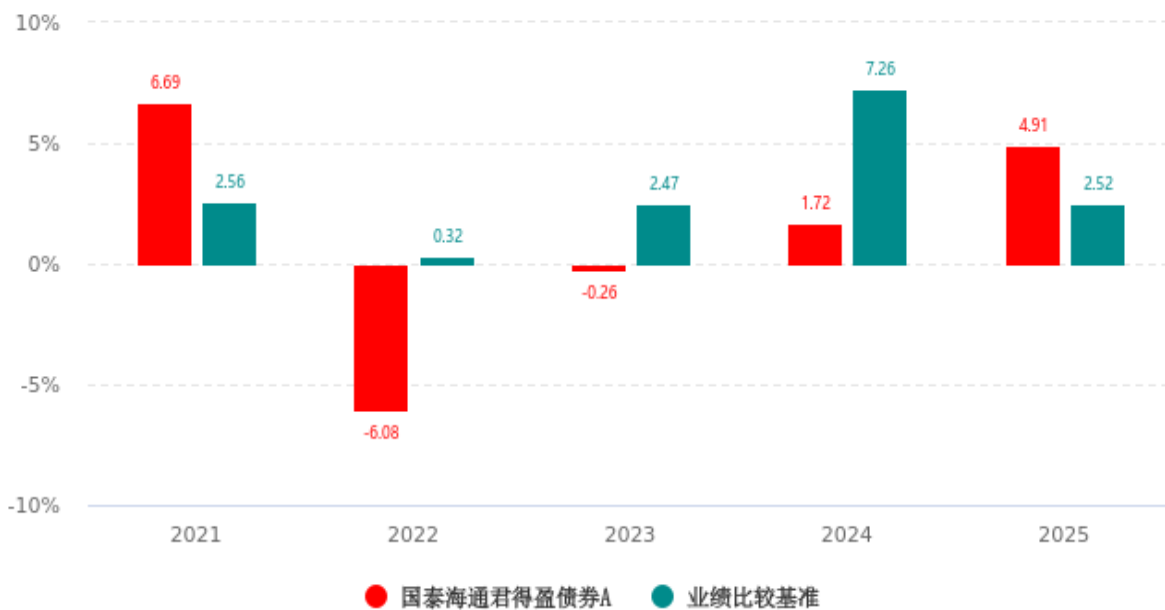
注：国泰海通君得盈债券 C 类份额首次确认日为 2021 年 3 月 9 日。

国泰海通君得盈债券D累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年01月24日-2025年12月31日)

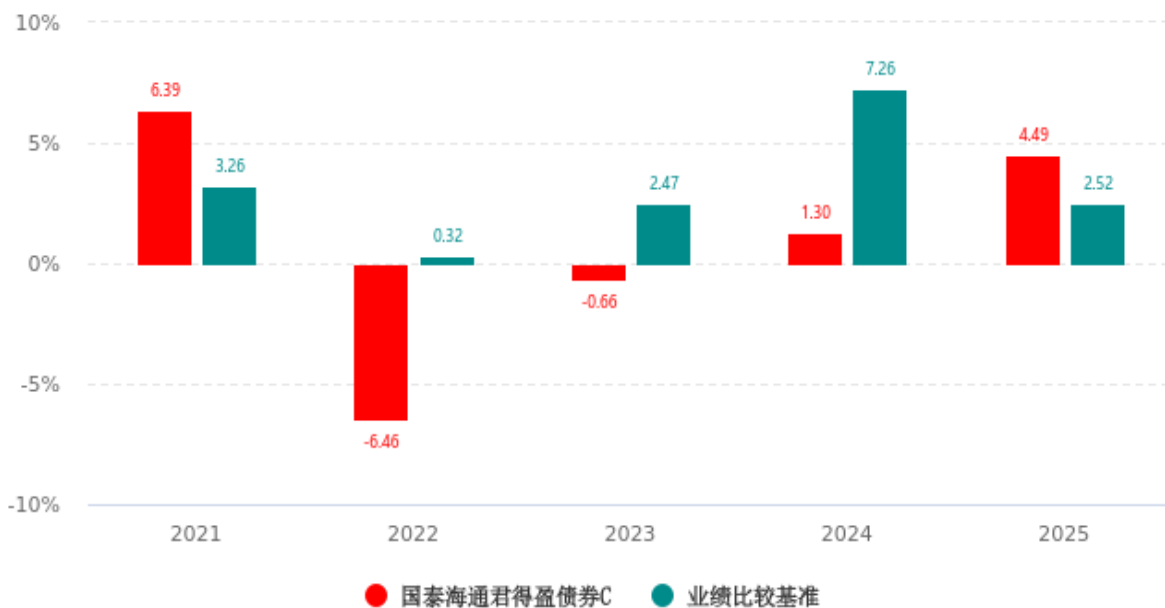


注：国泰海通君得盈债券 D 类份额首次确认日为 2025 年 1 月 24 日。

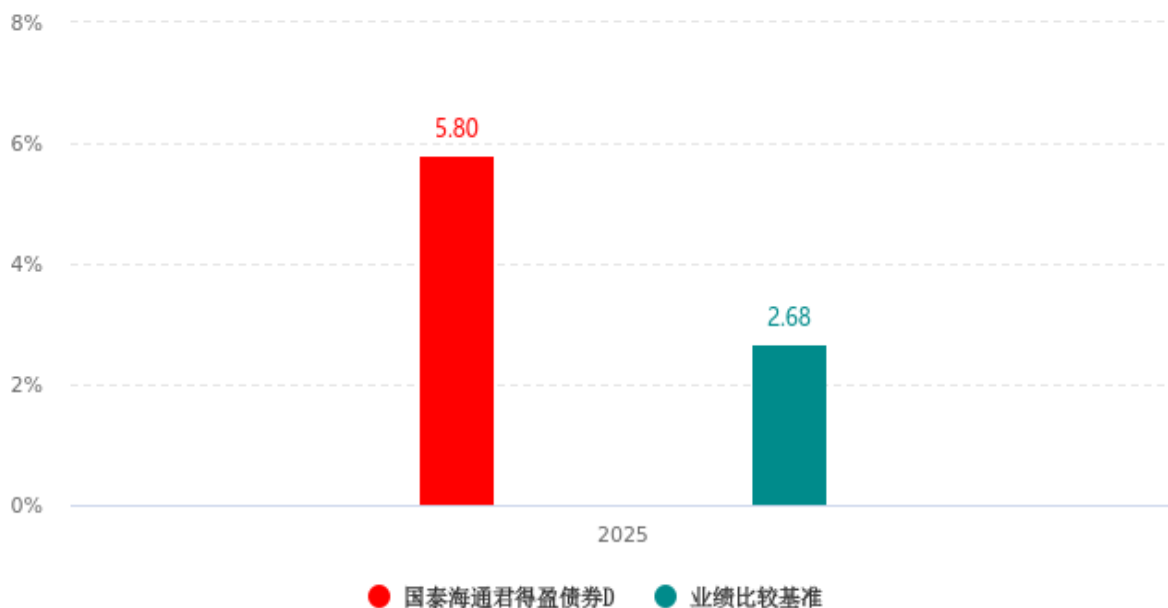
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同生效日为 2021 年 01 月 28 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



注：本基金合同生效日为 2021 年 01 月 28 日，国泰海通君得盈债券 C 类份额首次确认日为 2021 年 3 月 9 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



注：本基金合同生效日为 2021 年 01 月 28 日，国泰海通君得盈债券 D 类份额首次确认日为 2025 年 1 月 24 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未发生利润分配。

§ 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 2025 年 12 月 31 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 71 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		
朱莹	国泰海通 1 年定开债券发起式基金经理，国泰海通安弘六个月定开债券基金经理，国泰海通安平一年定开债券发起基金经理，国泰海通君得盛债券基金经理，国泰海通安睿纯债债券基金经理，国泰海通稳债增利债券发起基金经理，国泰海通稳健添利债券基金经理，国泰海通君得盈债券基金经理。现任多资产策略投资部（公募组）基金经理。	2025-09-09	-	5 年	朱莹，上海财经大学经济学学士、国际商务硕士、北卡罗莱纳大学夏洛特分校数理金融硕士、FRM。历任上海东证期货衍生品研究院高级金融工程分析师；2020 年 9 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任固定收益部研究员、投资经理助理、固定收益投资部（公募）基金经理，现任本公司多资产策略投资部（公募组）基金经理，主要从事债券投资研究工作。
刘晟	国泰海通中证 1000 指数增强基金经理，国泰海通君得盈债券基金经理，国泰海通新锐量化选股混合基金经理，国泰海通中证全指指数增强基金经理。现任量化投资部（公募）基金经理。	2025-09-09	-	4 年	刘晟，北京大学金融学硕士研究生。2021 年 7 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任权益与衍生品部量化研究员助理，量化投资部研究员助理、投资助理，现任量化投资部（公募）基金经理，主要从事领域 Alpha 因子和模型的研究工作。
杨勇	国泰海通安睿纯债债券基金经理，国泰海通安宜纯债债券基金经理，国泰海通稳健添利债券基金经理，国泰海通君享利 30 天滚动持有债券发起基金经理，国泰海通 120 天持有债券发起基金经理。本基金基金经理（已于 2025 年 9 月 9 日离任）。	2023-12-12	2025-09-09	10 年	杨勇，复旦大学工商管理硕士，历任中国银行股份有限公司上海人民币交易业务总部交易员，平安银行股份有限公司总行资金营运中心投资经理，国泰君安证券股份有限公司固定收益证券部投资经理，永赢基金管理有限公司固定收益投资部总监助理、副总监。2023 年 6 月加入上海国泰君安证券资产管

					理有限公司固定收益投资部（公募）担任副总经理。
周一洋	本基金基金经理（已于 2025 年 9 月 9 日离任）。	2022-11-14	2025-09-09	9 年	周一洋，哥伦比亚大学统计学硕士，历任海通证券有限公司总部研究所证券分析师、高级分析师等职务，主要从事资产配置、行业轮动和权益策略研究。2021 年 6 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任固定收益研究部高级研究员、多资产策略投资部高级研究员、多资产策略投资部（公募组）基金经理，现任本公司多资产策略投资部研究员。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《上海国泰海通证券资产管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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 1 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

2025 年，中国经济在复杂的内外部环境中展现出强大的韧性与活力，经济运行呈现“稳中有进、结构优化”的态势。上半年，受财政发力前置与货币政策适度宽松的推动，制造业与消费双轮驱动经济复苏；下半年，尽管面临外部地缘政治与贸易环境的扰动，但出口仍保持稳健，国内政策重心逐步转向结构调整与内需提振。

2025 年 A 股市场整体呈现出“波动加剧、结构分化”的运行特征。全年经历了年初的震荡修复，二季度的探底回升，以及下半年在流动性宽松环境下的高位震荡。一季度，市场受人工智能与人形机器人产业爆发驱动，科技成长板块率先突围，AH 股联动效应显著；二季度，市场遭遇贸易摩擦的短期冲击，但在政策强力托底与中央汇金维稳下，走出了深度的“V”型反转，市场风格开始极致演绎——代表防御属性的红利低波板块与代表进攻属性的科技成长板块呈现“哑铃”两端齐涨的态势；三季度，市场情绪在高位震荡中进一步分化，科技成长在业绩验证下延续强势，而红利板块短期修整；四季度，随着国内外流动性环境的进一步宽松，市场进入高位震荡与风格快速轮动期，结构性机会层出不穷。

报告期内上半年本基金的权益部分投资于可转债和股票，其中可转债投资的行业分布主要集中于银行、公用事业和制造业，股票方面重点投资于红利股。9 月本基金更换基金经理，权益仅投资于股票，股票采用量化投资策略，以中证 A500 指数为基准目标，主要配置中证 A500 指数增强策略，针对 A 股市场极致的结构性分化行情，辅助以特征鲜明的“哑铃型”量化配置体系。在运作层面，我们坚持基本面与量价信号相结合的多因子量化框架，通过严格控制行业与风格暴露，在降低跟踪误差的同时，力求获取稳定的超额收益。量化策略在市场轮动与震荡环境中保持运作纪律，避免受短期市场情绪干扰，致力于通过长期累积增强收益。2025 年，国内债券市场整体呈现震荡偏弱的格局，主要是受资金面波动、政策因素、外部冲击、商品价格上涨及权益市场风险偏好抬升等多重因素的交替影响，全年债券收益率呈 N 形走势，信用债与利率债表现出现分化。报告期内本基金主要投资于高等级信用债，以票息策略为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰海通君得盈债券 A 基金份额净值为 1.0697 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.91%，同期业绩比较基准收益率为 2.52%；截至报告期末国泰海通君得盈债券 C 基金份额净值为 1.0492 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.49%，同期业绩比较基准收益率为 2.52%；截至报告期末国泰海通君得盈债券 D 基金份额净值为 1.0657 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 5.80%，同期业绩比较基准收益率为 2.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，预计全球增长仍处于温和区间，通胀在主要经济体继续回落但黏性仍在，货币政策更可能从高位维持转向谨慎渐进的宽松，但大国博弈与地缘扰动仍可能对企业信心、全球贸易与风险偏好造成阶段性冲击。我们预计 A 股市场“稳健上涨”的趋势和“结构性行情”将并存，风格鲜明的“市场分域”会继续成为获取超额收益的来源之一：一方面，高股息资产在低利率环境下具备低波动的配置价值；另一方面，以科技创新为代表的高成长板块在产业升级驱动下具备极强的进攻弹性。

基于上述判断，本基金的权益部分投资在 2026 年将继续以中证 A500 指数为基准目标，力求在复杂的市场环境中实现风险与收益的动态平衡：一是坚持稳健的仓位配置，在中证 A500 指数增强的基础上，灵活配置“哑铃型”量化增强策略，坚守风险和收益相对均衡的核心定位。二是深化量化模型迭代。面对日益加快的市场风格轮动节奏，我们将持续推进量化模型的迭代与优化。我们将重点关注不同风格特征下的因子有效性变化，通过多因子体系动态调整各分域的配置权重，既要保障组合风格的纯粹性，又要提升模型对市场变化的适应能力。债券市场方面预计整体偏宽幅震荡格局，把握市场的节奏更加重要。需要关注经济基本面、价格水平的预期和现实之间的差异、政府债供求关系的变化以及权益市场风险偏好的变动。机构行为仍将对券种利差和期限利差的变化产生重要影响，重点关注交易型机构和配置型机构力量的相对强弱变化。本基金将继续保持高等级信用债的持仓，以配置思路参与债券市场投资。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合规运作角度出发，在合规文化建设、制度体系建设、合规审查及检查、反洗钱、员工执业行为规范等角度开展工作，不断深化员工的合规意识，推动公司合规文化和内部风险控制机制的完善和优化。

内部监察工作重点包括以下几个方面：

1、合规文化建设。管理人通过内外部合规培训、合规考试、法规解读、法律法规库维护更新、监管会议精神传达等多种形式推动公司合规文化建设，不断提高全体员工合规意识，为公司业

务健康发展提供良好的文化土壤。

2、制度体系建设和完善。管理人根据法律法规变化，结合行业新动态，围绕新业务需要，不断优化和健全公司制度体系，并注重相关制度体系的落实和执行。通过制度体系的建设和完善，不断提升了业务管理流程的健全性、规范性、精细化和可操作性，为公司业务规范运营和合规管理进一步夯实了制度基础。

3、合规审查和检查。根据法律法规、监管要求和公司制度规定，做好对公司新业务、新产品、新投资品种及其他创新业务的法律合规及风险控制支持，定期对产品销售、投资、研究及交易等相关业务活动的日常合规性进行检查，查漏补缺。合规检查工作促进了内部控制管理的完善，防范了合规风险的进一步发生。

4、员工执业与投资行为管理。根据法律法规和公司制度要求，管理人不断加强员工执业行为管理。管理人要求新员工入职时需提供和完善个人信息并完成相关投资的申报工作，对投资、交易人员的通讯工具实行交易时间段集中管理，并对监控摄像、电子邮件、电话录音和即时通讯工具聊天记录定期进行合规检查。通过一系列常态化的员工执业和投资行为管理，促进员工执业和投资行为持续符合监管要求。

5、反洗钱合规管理。本报告期内，管理人持续加强反洗钱合规管理，制定反洗钱工作方案，并在年度内推进落实。持续做好日常可疑交易监控排查、客户风险等级划分、修订反洗钱内部控制管理制度、跟进反洗钱系统改造、完成各类反洗钱工作报告、反洗钱金融机构分类评级自评工作等。

管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部合规风控工作的科学性和有效性，努力防范和控制各类风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2026]200Z2731 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国泰海通君得盈债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了国泰海通君得盈债券型证券投资基金（以下简称“国泰海通君得盈债券基金”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表

	<p>以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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，公允反映了国泰海通君得盈债券基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和中国注册会计师独立性准则，我们独立于国泰海通君得盈债券基金，并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定，同时履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>国泰海通君得盈债券基金的基金管理人上海国泰海通证券资产管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估国泰海通君得盈债券基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算国泰海通君得盈债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督国泰海通君得盈债券基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉</p>

	<p>及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对国泰海通君得盈债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国泰海通君得盈债券基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	张振波 陈轶杰
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
审计报告日期	2026-03-26

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰海通君得盈债券型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	62,502,550.44	1,684,697.47
结算备付金		56,102,617.30	1,158,531.36

存出保证金		191,265.49	25,139.02
交易性金融资产	7.4.7.2	2,590,007,711.85	105,151,500.09
其中：股票投资		876,531,081.36	17,454,267.79
基金投资		-	-
债券投资		1,713,476,630.49	87,697,232.30
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	7.4.7.3	-	-
应收清算款		-	404,958.10
应收股利		-	-
应收申购款		16,530.92	120.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.4	-	-
资产总计		2,708,820,676.00	108,424,946.04
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 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		630,115,130.85	17,005,710.90
应付清算款		2,662,544.50	273,338.86

应付赎回款		98,047.07	853,832.68
应付管理人报酬		1,050,077.45	46,150.63
应付托管费		175,012.90	7,691.75
应付销售服务费		4,220.35	13,926.08
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7,512.10	4,037.76
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.5	1,930,917.80	99,803.94
负债合计		636,043,463.02	18,304,492.60
净资产：			
实收基金	7.4.7.6	1,937,945,286.27	89,007,842.00
未分配利润	7.4.7.7	134,831,926.71	1,112,611.44
净资产合计		2,072,777,212.98	90,120,453.44
负债和净资产总计		2,708,820,676.00	108,424,946.04

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,937,945,286.27 份。其中国泰海通君得盈债券 A 基金份额净值 1.0697 元，基金份额总额 1,925,792,327.72 份；国泰海通君得盈债券 C 基金份额净值 1.0492 元，基金份额总额 12,099,857.74 份；国泰海通君得盈债券 D 基金份额净值 1.0657 元，基金份额总额 53,100.81 份。

7.2 利润表

会计主体：国泰海通君得盈债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
----	-----	---------------------------------------	--

一、营业总收入		39,299,076.29	2,458,939.43
1. 利息收入		868,696.28	24,846.75
其中：存款利息收入	7.4.7.8	359,067.26	22,548.24
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		400,436.95	2,298.51
其他利息收入		109,192.07	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		15,115,229.69	1,734,570.55
其中：股票投资收益	7.4.7.9	2,077,880.33	-5,479,425.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.10	10,410,703.21	6,430,522.68
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.11	-109,078.82	128,528.66
股利收益	7.4.7.12	2,735,724.97	654,944.45
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	23,301,114.85	696,580.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	14,035.47	2,942.08
减：二、营业总支出		7,484,293.85	1,686,331.66
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,170,440.78	675,785.29
2. 托管费	7.4.10.2.2	695,073.47	112,630.70
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	168,540.94	180,611.78
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,245,371.56	502,862.42
其中：卖出回购金融资产支出		2,245,371.56	502,862.42

6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		5,489.14	8,945.45
8. 其他费用	7.4.7.15	199,377.96	205,496.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,814,782.44	772,607.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,814,782.44	772,607.77
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		31,814,782.44	772,607.77

7.3 净资产变动表

会计主体：国泰海通君得盈债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	89,007,842.00	1,112,611.44	90,120,453.44
二、本期期初净资产	89,007,842.00	1,112,611.44	90,120,453.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,848,937,444.27	133,719,315.27	1,982,656,759.54
（一）、综合收益总额	-	31,814,782.44	31,814,782.44
（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）	1,848,937,444.27	101,904,532.83	1,950,841,977.10
其中：1. 基金申购款	3,805,152,112.09	206,248,867.67	4,011,400,979.76
2. 基金赎回款	-	-104,344,334.84	-
	1,956,214,667.82		2,060,559,002.66
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,937,945,286.27	134,831,926.71	2,072,777,212.98
项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	137,537,879.54	-253,822.07	137,284,057.47
二、本期期初净资产	137,537,879.54	-253,822.07	137,284,057.47

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-48,530,037.54	1,366,433.51	-47,163,604.03
（一）、综合收益总额	-	772,607.77	772,607.77
（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）	-48,530,037.54	593,825.74	-47,936,211.80
其中：1. 基金申购款	692,959.03	-10,013.22	682,945.81
2. 基金赎回款	-49,222,996.57	603,838.96	-48,619,157.61
（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）	-	0.00	-
四、本期期末净资产	89,007,842.00	1,112,611.44	90,120,453.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

陶耿	陶耿	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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划，于 2011 年 6 月 14 日经中国证监会证监许可[2011]941 号文核准设立，自 2011 年 8 月 22 日起开始募集，于 2011 年 9 月 16 日结束募集工作，并于 2011 年 9 月 22 日正式成立。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 30 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告〔2018〕39 号）的规定，国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更，《国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划资产管理合同》自 2021 年 1 月 28 日起生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告〔2018〕39 号）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等规定及中国证监会《关于准予国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划变更注册的批复》（证监许可〔2021〕4085 号），国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划于 2022 年 1 月 17 日起正式变更为国泰君安君得盈债券型证券投资基金。

2025 年 7 月 25 日，上海国泰君安证券资产管理有限公司变更名称为上海国泰海通证券资产管

理有限公司。2025 年 9 月 29 日，国泰君安君得盈债券型证券投资基金变更为国泰海通君得盈债券型证券投资基金，《国泰海通君得盈债券型证券投资基金基金合同》自基金管理人公告的生效之日起生效，原《国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰海通君得盈债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括股票（包含主板、创业板及其他依法发行上市的股票）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可转换债券、可交换债券、可分离交易债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、国债期货等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资的信用债评级 AA+（含 AA+）以上，其中投资于评级 AA+ 的信用债比例不超过基金信用债资产的 50%；投资评级 AAA 的信用债比例不低于基金信用债资产的 50%。若无债项评级或者债项评级为 A-1 的，则以主体评级为准。本产品投资的信用债需有评级满足上述要求。本基金投资于可转换债券、可交换债券、可分离交易债券的比例不超过基金资产的 20%。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中债综合财富指数收益率×70%+一年定期存款税后利率×20%+沪深 300 指数收益率×10%。

7.4.2 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 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年度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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、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公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无金融资产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。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损

益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经

发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)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；或者(3)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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，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。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 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变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，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。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理

标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起,对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入,恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入,免征增值税直至债券到期。资管产

品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	62,502,550.44	1,684,697.47
等于：本金	62,495,645.00	1,684,509.63
加：应计利息	6,905.44	187.84
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	62,502,550.44	1,684,697.47

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		861,237,029.46	-	876,531,081.36	15,294,051.90
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	36,926,321.69	232,437.54	37,205,437.54	46,678.31
	银行间市场	1,652,940,439.85	14,373,912.95	1,676,271,192.95	8,956,840.15
	合计	1,689,866,761.54	14,606,350.49	1,713,476,630.49	9,003,518.46
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,551,103,791.00	14,606,350.49	2,590,007,711.85	24,297,570.36
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		17,120,841.08	-	17,454,267.79	333,426.71
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	8,451,042.17	23,532.67	8,582,529.17	107,954.33
	银行间市场	77,895,525.53	664,103.13	79,114,703.13	555,074.47
	合计	86,346,567.70	687,635.80	87,697,232.30	663,028.80
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		103,467,408.78	687,635.80	105,151,500.09	996,455.51

7.4.7.3 买入返售金融资产

7.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.03	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,772,617.77	60,503.94
其中：交易所市场	1,718,599.27	50,275.44
银行间市场	54,018.50	10,228.50
应付利息	-	-
预提信息披露费	120,000.00	-
预提审计费	29,000.00	30,000.00
预提账户维护费	9,300.00	9,300.00
合计	1,930,917.80	99,803.94

7.4.7.6 实收基金

国泰海通君得盈债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,368,446.49	48,368,446.49
本期申购	1,897,424,980.84	1,897,424,980.84
本期赎回（以“-”号填列）	-20,001,099.61	-20,001,099.61
本期末	1,925,792,327.72	1,925,792,327.72

国泰海通君得盈债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	40,639,395.51	40,639,395.51
本期申购	4,450,135.70	4,450,135.70
本期赎回（以“-”号填列）	-32,989,673.47	-32,989,673.47
本期末	12,099,857.74	12,099,857.74

国泰海通君得盈债券 D

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	1,903,276,995.55	1,903,276,995.55
本期赎回（以“-”号填列）	-1,903,223,894.74	-1,903,223,894.74
本期末	53,100.81	53,100.81

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.7 未分配利润

国泰海通君得盈债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	441,489.29	504,236.51	945,725.80
本期期初	441,489.29	504,236.51	945,725.80
本期利润	6,842,039.12	23,469,799.91	30,311,839.03
本期基金份额交易产生的变动数	107,952,076.11	-4,976,599.43	102,975,476.68
其中：基金申购款	108,532,553.41	-4,943,210.38	103,589,343.03
基金赎回款	-580,477.30	-33,389.05	-613,866.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	115,235,604.52	18,997,436.99	134,233,041.51

国泰海通君得盈债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-245,609.21	412,494.85	166,885.64
本期期初	-245,609.21	412,494.85	166,885.64
本期利润	1,418,816.28	-117,658.07	1,301,158.21
本期基金份额交易产生的变动数	-693,503.84	-179,142.99	-872,646.83
其中：基金申购款	80,626.81	6,663.00	87,289.81
基金赎回款	-774,130.65	-185,805.99	-959,936.64

本期已分配利润	-	-	-
本期末	479,703.23	115,693.79	595,397.02

国泰海通君得盈债券 D

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	252,812.19	-51,026.99	201,785.20
本期基金份额交易产生的变动数	-249,880.90	51,583.88	-198,297.02
其中：基金申购款	107,531,711.87	-4,959,477.04	102,572,234.83
基金赎回款	-107,781,592.77	5,011,060.92	-102,770,531.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,931.29	556.89	3,488.18

7.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	207,962.50	12,299.42
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	150,916.21	9,973.96
其他	188.55	274.86
合计	359,067.26	22,548.24

7.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至	上年度可比期间 2024 年 01 月
----	----------------------	---------------------

	2025 年 12 月 31 日	01 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,745,108,949.98	213,775,509.61
减：卖出股票成本总额	1,739,907,309.22	218,858,626.32
减：交易费用	3,123,760.43	396,308.53
买卖股票差价收入	2,077,880.33	-5,479,425.24

7.4.7.10 债券投资收益

7.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	9,825,707.99	3,138,809.40
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	584,995.22	3,291,713.28
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	10,410,703.21	6,430,522.68

7.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出债券(债转股及债券到期 兑付)成交总额	2,326,829,737.74	734,774,166.14
减：卖出债券(债转股及债券 到期兑付)成本总额	2,301,485,127.44	725,509,070.12
减：应计利息总额	24,707,308.43	5,940,398.54
减：交易费用	52,306.65	32,984.20
买卖债券差价收入	584,995.22	3,291,713.28

7.4.7.11 衍生工具收益

7.4.7.11.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
国债期货投资收益	-108,800.00	133,650.00

减：交易费用	278.82	1,228.63
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	-	3,892.71
合计	-109,078.82	128,528.66

7.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,735,724.97	654,944.45
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	2,735,724.97	654,944.45

7.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	23,301,114.85	696,580.05
——股票投资	14,960,625.19	498,286.38
——债券投资	8,340,489.66	198,293.67
——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	23,301,114.85	696,580.05

7.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	14,035.47	2,942.08
合计	14,035.47	2,942.08

7.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	29,000.00	30,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	13,177.96	18,296.02
账户维护费	37,200.00	37,200.00
合计	199,377.96	205,496.02

7.4.7.16 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 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

基金管理人股东国泰海通证券股份有限公司于 2025 年 4 月 4 日发布《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，公司名称由国泰君安证券股份有限公司变更为国泰海通证券股份有限公司。

基金管理人上海国泰海通证券资产管理有限公司 2025 年 7 月 25 日发布《关于公司法定名称、住所变更的公告》，公司名称由上海国泰君安证券资产管理有限公司变更为上海国泰海通证券资产

管理有限公司。

7.4.9.2 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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰海通证券	4,329,132,447.58	100.00%	426,501,310.32	100.00%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰海通证券	286,201,928.93	100.00%	265,027,537.68	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰海通证券	238,600,000.00	100.00%	8,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 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	1,985,820.11	100.00%	1,718,599.27	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 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	265,369.29	100.00%	50,275.44	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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,170,440.78	675,785.29
其中：应支付销售机构的客户维护费	173,566.26	197,416.51
应支付基金管理人的净管理费	3,996,874.52	478,368.78

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

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	695,073.47	112,630.70

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

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	国泰海通君得 盈债券 A	国泰海通君得 盈债券 C	国泰海通君得 盈债券 D	合计
国泰海通资管	-	66,485.64	15,360.75	81,846.39
国泰海通证券	-	53,502.85	11,507.51	65,010.36
建设银行	-	262.68	-	262.68
合计	-	120,251.17	26,868.26	147,119.43
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	国泰海通君得 盈债券 A	国泰海通君得 盈债券 C	国泰海通君得 盈债券 D	合计
国泰海通资管	-	88,167.04	-	88,167.04
国泰海通证券	-	78,988.47	-	78,988.47
建设银行	-	577.98	-	577.98
合计	-	167,733.49	-	167,733.49

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.4%，销售服务费按前一日 C 类份额的基金资产净值的 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 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

类份额的销售服务费年费率为 0.1%，销售服务费按前一日 D 类份额的基金资产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为 D 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 D 类份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 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

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年	上年度可比期间 2024 年 01 月 01
-------	-----------------------------	------------------------

	12 月 31 日		日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	62,502,550.44	207,962.50	1,684,697.47	12,299.42

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须做说明的其他关联方交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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
688012	中微公司	2025-12-19	筹划发行股份购买资产	272.72	2026-01-05	278.00	5,400	1,488,843.20	1,472,688.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 630,115,130.85 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
232400037	24 宁波银行 二级资本债 02	2026-01-05	100.76	1,200,000	120,906,739.73
232480037	24 交行二级 资本债 02A	2026-01-05	101.51	1,000,000	101,509,715.07
232580001	25 工行二级 资本债 01BC	2026-01-05	101.45	1,000,000	101,445,917.81
232580003	25 宁波银行 二级资本债 01	2026-01-05	101.57	350,000	35,548,752.06
232580009	25 中信银行 二级资本债 01BC	2026-01-05	100.39	1,500,000	150,585,139.73
232580012	25 中行二级 资本债 01BC	2026-01-05	100.28	950,000	95,266,598.63
232580035	25 农行二级 资本债 03A(BC)	2026-01-05	100.53	800,000	80,421,536.44
合计				6,800,000	685,684,399.47

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金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。

7.4.13.2.1 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	133,119,422.47	-
合计	133,119,422.47	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、本基金持有的未评级债券包括国债、政策性金融债。

7.4.13.2.2 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	1,565,381,302.54	60,392,669.89
AAA 以下	-	5,350,108.44
未评级	14,975,905.48	21,954,453.97
合计	1,580,357,208.02	87,697,232.30

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。

7.4.13.3 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 2025 年 12 月 31 日除卖出回购金融资产款余额中有 630,115,130.85 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。

7.4.13.3.1 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上市公司发行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 7.4.12。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 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	62,502,550.44	-	-	-	62,502,550.44
结 算 备 付 金	56,102,617.30	-	-	-	56,102,617.30
存 出 保 证 金	191,265.49	-	-	-	191,265.49
交 易 性 金	148,095,327.95	1,565,381,302.54	-	876,531,081.36	2,590,007,711.85

融 资 产					
应 收 申 购 款	-	-	-	16,530.92	16,530.92
资 产 总 计	266,891,761.18	1,565,381,302.54	-	876,547,612.28	2,708,820,676.00
负 债					
卖 出 回 购 金 融 资 产 款	630,115,130.85	-	-	-	630,115,130.85
应 付 清 算 款	-	-	-	2,662,544.50	2,662,544.50
应 付 赎 回 款	-	-	-	98,047.07	98,047.07
应 付 管 理 人 报 酬	-	-	-	1,050,077.45	1,050,077.45
应 付 托 管	-	-	-	175,012.90	175,012.90

费					
应付销售服务费	-	-	-	4,220.35	4,220.35
应交税费	-	-	-	7,512.10	7,512.10
其他负债	-	-	-	1,930,917.80	1,930,917.80
负债总计	630,115,130.85	-	-	5,928,332.17	636,043,463.02
利率敏感度缺口	- 363,223,369.67	1,565,381,302.5 4	-	870,619,280.1 1	2,072,777,212.9 8
上年度末 2024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	1,684,697.47	-	-	-	1,684,697.47

结算备付金	1,158,531.36	-	-	-	1,158,531.36
存出保证金	25,139.02	-	-	-	25,139.02
交易性金融资产	15,626,861.22	63,411,871.08	8,658,500.00	17,454,267.79	105,151,500.09
应收清算款	-	-	-	404,958.10	404,958.10
应收申购款	-	-	-	120.00	120.00
资产总计	18,495,229.07	63,411,871.08	8,658,500.00	17,859,345.89	108,424,946.04
负债					
卖出回购金融资产款	17,005,710.90	-	-	-	17,005,710.90
应付	-	-	-	273,338.86	273,338.86

清算款					
应付赎回款	-	-	-	853,832.68	853,832.68
应付管理人报酬	-	-	-	46,150.63	46,150.63
应付托管费	-	-	-	7,691.75	7,691.75
应付销售服务费	-	-	-	13,926.08	13,926.08
应交税费	-	-	-	4,037.76	4,037.76
其他负债	-	-	-	99,803.94	99,803.94
负债总计	17,005,710.90	-	-	1,298,781.70	18,304,492.60
利率敏感度	1,489,518.17	63,411,871.08	8,658,500.00	16,560,564.19	90,120,453.44

缺口					
----	--	--	--	--	--

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。

7.4.13.4.1.2 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	基准利率点利率增加 0.1%	-5,790,779.55	-343,200.00
	基准利率点利率减少 0.1%	5,818,503.10	348,271.52

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

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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	876,531,081.3	42.29	17,454,267.7	19.37

	6		9	
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	876,531,081.36	42.29	17,454,267.79	19.37

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 7.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准（附注 7.4.1）上升 5%	171,393,791.79	-
	业绩比较基准（附注 7.4.1）下降 5%	-171,393,791.79	-

注：于 2024 年 12 月 31 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 19.37%，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

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	875,058,393.36	26,036,796.96
第二层次	1,714,949,318.49	79,114,703.13
第三层次	-	-
合计	2,590,007,711.85	105,151,500.09

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	876,531,081.36	32.36
	其中：股票	876,531,081.36	32.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,713,476,630.49	63.26
	其中：债券	1,713,476,630.49	63.26
	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	118,605,167.74	4.38
8	其他各项资产	207,796.41	0.01
9	合计	2,708,820,676.00	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	694,141.00	0.03
B	采矿业	48,919,277.28	2.36
C	制造业	559,893,093.24	27.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,737,278.00	1.05
E	建筑业	10,599,670.20	0.51
F	批发和零售业	10,010,594.00	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	23,961,529.00	1.16
H	住宿和餐饮业	5,244,546.00	0.25
I	信息传输、软件和信息技术服务业	55,167,708.85	2.66
J	金融业	94,094,608.52	4.54
K	房地产业	9,242,835.00	0.45
L	租赁和商务服务业	9,283,810.00	0.45
M	科学研究和技术服务业	19,404,430.27	0.94
N	水利、环境和公共设施管理业	2,997,363.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	49,135.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,149,069.00	0.25
S	综合	81,993.00	0.00
	合计	876,531,081.36	42.29

8.2.2 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。

8.3 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	81,800	30,041,868.00	1.45
2	601318	中国平安	366,000	25,034,400.00	1.21
3	601899	紫金矿业	468,800	16,159,536.00	0.78
4	600519	贵州茅台	10,452	14,394,285.36	0.69
5	300502	新易盛	30,200	13,012,576.00	0.63
6	300274	阳光电源	72,100	12,331,984.00	0.59
7	603259	药明康德	135,700	12,299,848.00	0.59
8	300308	中际旭创	19,400	11,834,000.00	0.57
9	688981	中芯国际	96,268	11,824,598.44	0.57
10	600887	伊利股份	402,000	11,497,200.00	0.55
11	600309	万华化学	139,200	10,673,856.00	0.51
12	601398	工商银行	1,263,200	10,017,176.00	0.48
13	000333	美的集团	128,100	10,011,015.00	0.48
14	600276	恒瑞医药	167,600	9,983,932.00	0.48
15	600019	宝钢股份	1,302,600	9,704,370.00	0.47
16	300604	长川科技	92,071	9,327,713.01	0.45
17	600031	三一重工	437,700	9,248,601.00	0.45
18	601328	交通银行	1,216,600	8,820,350.00	0.43
19	300438	鹏辉能源	155,200	8,259,744.00	0.40
20	600011	华能国际	1,068,200	7,968,772.00	0.38
21	603799	华友钴业	114,200	7,795,292.00	0.38
22	600150	中国船舶	233,200	7,756,232.00	0.37
23	600795	国电电力	1,508,900	7,604,856.00	0.37
24	300033	同花顺	23,400	7,539,012.00	0.36
25	600919	江苏银行	713,700	7,422,480.00	0.36
26	002916	深南电路	31,700	7,363,593.00	0.36

27	600690	海尔智家	278,300	7,260,847.00	0.35
28	688111	金山办公	23,580	7,240,710.60	0.35
29	600660	福耀玻璃	110,800	7,176,516.00	0.35
30	002281	光迅科技	102,487	7,168,965.65	0.35
31	688608	恒玄科技	30,700	6,967,058.00	0.34
32	302132	中航成飞	86,300	6,817,700.00	0.33
33	300433	蓝思科技	216,700	6,559,509.00	0.32
34	600018	上港集团	1,205,000	6,531,100.00	0.32
35	688396	华润微	122,141	6,456,373.26	0.31
36	002414	高德红外	433,000	6,352,110.00	0.31
37	601988	中国银行	1,069,300	6,127,089.00	0.30
38	600547	山东黄金	157,800	6,108,438.00	0.29
39	603986	兆易创新	27,800	5,956,150.00	0.29
40	601117	中国化学	789,700	5,946,441.00	0.29
41	000001	平安银行	517,900	5,909,239.00	0.29
42	000338	潍柴动力	341,300	5,870,360.00	0.28
43	002222	福晶科技	103,500	5,831,190.00	0.28
44	601166	兴业银行	276,000	5,812,560.00	0.28
45	300394	天孚通信	27,500	5,583,325.00	0.27
46	601225	陕西煤业	252,300	5,379,036.00	0.26
47	688041	海光信息	23,582	5,292,036.62	0.26
48	600160	巨化股份	135,200	5,194,384.00	0.25
49	688008	澜起科技	44,026	5,186,262.80	0.25
50	601319	中国人保	557,500	4,989,625.00	0.24
51	601857	中国石油	474,700	4,941,627.00	0.24
52	002625	光启技术	98,000	4,778,480.00	0.23
53	002371	北方华创	10,200	4,682,616.00	0.23
54	002940	昂利康	134,700	4,515,144.00	0.22
55	002603	以岭药业	256,800	4,383,576.00	0.21
56	000157	中联重科	494,100	4,264,083.00	0.21
57	002555	三七互娱	179,300	4,231,480.00	0.20
58	688166	博瑞医药	83,703	4,106,469.18	0.20
59	688108	赛诺医疗	209,354	4,027,970.96	0.19
60	002444	巨星科技	117,300	3,990,546.00	0.19
61	002156	通富微电	104,300	3,932,110.00	0.19
62	301236	软通动力	82,400	3,908,232.00	0.19
63	600754	锦江酒店	151,800	3,835,986.00	0.19
64	600573	惠泉啤酒	319,300	3,809,249.00	0.18
65	300768	迪普科技	204,100	3,781,973.00	0.18
66	600392	盛和资源	173,500	3,735,455.00	0.18
67	300008	天海防务	468,800	3,698,832.00	0.18
68	002415	海康威视	123,400	3,682,256.00	0.18
69	300917	特发服务	93,900	3,671,490.00	0.18

70	603697	有友食品	295,900	3,624,775.00	0.17
71	601107	四川成渝	578,100	3,514,848.00	0.17
72	600482	中国动力	167,700	3,471,390.00	0.17
73	300017	网宿科技	332,100	3,404,025.00	0.16
74	600415	小商品城	213,300	3,402,135.00	0.16
75	002734	利民股份	212,700	3,390,438.00	0.16
76	000039	中集集团	335,111	3,381,269.99	0.16
77	002624	完美世界	197,700	3,240,303.00	0.16
78	002558	巨人网络	72,700	3,147,183.00	0.15
79	600007	中国国贸	154,400	3,060,208.00	0.15
80	300346	南大光电	70,800	3,037,320.00	0.15
81	688280	精进电动	341,000	2,966,700.00	0.14
82	000975	山金国际	120,900	2,941,497.00	0.14
83	600118	中国卫星	30,700	2,914,965.00	0.14
84	002475	立讯精密	50,100	2,841,171.00	0.14
85	300139	晓程科技	89,200	2,708,112.00	0.13
86	002137	实益达	315,500	2,706,990.00	0.13
87	300127	银河磁体	86,300	2,617,479.00	0.13
88	600585	海螺水泥	117,200	2,561,992.00	0.12
89	300620	光库科技	17,100	2,514,555.00	0.12
90	002074	国轩高科	62,800	2,456,108.00	0.12
91	688336	三生国健	41,040	2,444,752.80	0.12
92	601919	中远海控	158,400	2,404,512.00	0.12
93	600988	赤峰黄金	76,347	2,385,080.28	0.12
94	300014	亿纬锂能	35,700	2,347,632.00	0.11
95	601126	四方股份	78,000	2,346,240.00	0.11
96	300251	光线传媒	143,000	2,342,340.00	0.11
97	600941	中国移动	23,000	2,324,150.00	0.11
98	600028	中国石化	366,100	2,262,498.00	0.11
99	688062	迈威生物	58,651	2,256,303.97	0.11
100	688365	光云科技	133,200	2,247,084.00	0.11
101	300945	曼卡龙	134,100	2,167,056.00	0.10
102	688256	寒武纪	1,590	2,155,324.50	0.10
103	001389	广合科技	26,400	2,155,032.00	0.10
104	600039	四川路桥	215,516	2,144,384.20	0.10
105	601077	渝农商行	331,400	2,140,844.00	0.10
106	002091	江苏国泰	234,900	2,121,147.00	0.10
107	603008	喜临门	101,500	2,078,720.00	0.10
108	300277	海联讯	157,200	2,051,460.00	0.10
109	688088	虹软科技	40,442	2,001,879.00	0.10
110	000100	TCL 科技	437,400	1,985,796.00	0.10
111	002312	川发龙蟒	181,000	1,978,330.00	0.10
112	301365	矩阵股份	82,400	1,964,416.00	0.09

113	300037	新宙邦	37,300	1,954,520.00	0.09
114	600176	中国巨石	113,500	1,940,850.00	0.09
115	300748	金力永磁	56,400	1,923,804.00	0.09
116	300570	太辰光	15,600	1,802,580.00	0.09
117	600030	中信证券	62,700	1,800,117.00	0.09
118	300573	兴齐眼药	25,100	1,764,279.00	0.09
119	000421	南京公用	249,300	1,722,663.00	0.08
120	000725	京东方 A	398,800	1,678,948.00	0.08
121	688063	派能科技	28,800	1,636,416.00	0.08
122	002028	思源电气	10,500	1,623,195.00	0.08
123	300454	深信服	13,900	1,600,724.00	0.08
124	600487	亨通光电	64,000	1,582,720.00	0.08
125	300727	润禾材料	43,300	1,543,212.00	0.07
126	002402	和而泰	39,100	1,529,592.00	0.07
127	601100	恒立液压	13,700	1,505,767.00	0.07
128	300408	三环集团	32,800	1,500,600.00	0.07
129	000651	格力电器	37,300	1,500,206.00	0.07
130	001376	百通能源	88,300	1,486,972.00	0.07
131	600170	上海建工	557,600	1,477,640.00	0.07
132	688385	复旦微电	20,000	1,474,000.00	0.07
133	688012	中微公司	5,400	1,472,688.00	0.07
134	600071	凤凰光学	67,700	1,455,550.00	0.07
135	301052	果麦文化	38,100	1,455,039.00	0.07
136	688591	泰凌微	33,848	1,440,570.88	0.07
137	300450	先导智能	28,700	1,434,426.00	0.07
138	601298	青岛港	171,400	1,429,476.00	0.07
139	300760	迈瑞医疗	7,500	1,428,375.00	0.07
140	688373	盟科药业	234,800	1,418,192.00	0.07
141	000729	燕京啤酒	125,200	1,405,996.00	0.07
142	002352	顺丰控股	36,400	1,394,848.00	0.07
143	002398	垒知集团	244,800	1,375,776.00	0.07
144	601872	招商轮船	152,600	1,370,348.00	0.07
145	300898	熊猫乳品	50,800	1,368,044.00	0.07
146	600685	中船防务	47,300	1,345,685.00	0.06
147	002085	万丰奥威	83,800	1,341,638.00	0.06
148	600188	兖矿能源	101,300	1,332,095.00	0.06
149	688231	隆达股份	50,700	1,318,200.00	0.06
150	601088	中国神华	32,500	1,316,250.00	0.06
151	300063	天龙集团	153,000	1,311,210.00	0.06
152	002811	郑中设计	86,900	1,289,596.00	0.06
153	002004	华邦健康	264,200	1,262,876.00	0.06
154	601633	长城汽车	55,800	1,262,754.00	0.06
155	688208	道通科技	34,300	1,262,240.00	0.06

156	002027	分众传媒	170,700	1,258,059.00	0.06
157	688772	珠海冠宇	57,191	1,231,322.23	0.06
158	300805	电声股份	115,400	1,217,470.00	0.06
159	000933	神火股份	44,000	1,208,680.00	0.06
160	688322	奥比中光	13,239	1,187,141.13	0.06
161	300456	赛微电子	21,100	1,180,756.00	0.06
162	002185	华天科技	106,800	1,171,596.00	0.06
163	301150	中一科技	27,900	1,171,521.00	0.06
164	000977	浪潮信息	17,500	1,165,500.00	0.06
165	601009	南京银行	101,400	1,159,002.00	0.06
166	600346	恒力石化	51,200	1,153,536.00	0.06
167	300285	国瓷材料	41,100	1,126,551.00	0.05
168	688779	五矿新能	148,600	1,113,014.00	0.05
169	300775	三角防务	36,500	1,109,600.00	0.05
170	600026	中远海能	94,700	1,106,096.00	0.05
171	601898	中煤能源	88,100	1,095,964.00	0.05
172	688629	华丰科技	10,900	1,090,654.00	0.05
173	688521	芯原股份	7,800	1,068,366.00	0.05
174	300476	胜宏科技	3,700	1,064,046.00	0.05
175	601728	中国电信	167,900	1,057,770.00	0.05
176	300129	泰胜风能	100,900	1,055,414.00	0.05
177	301536	星辰科技	17,500	1,048,425.00	0.05
178	300358	楚天科技	106,700	1,044,593.00	0.05
179	688347	华虹公司	9,440	1,018,292.80	0.05
180	688321	微芯生物	34,844	1,018,141.68	0.05
181	300206	理邦仪器	79,200	1,012,968.00	0.05
182	001979	招商蛇口	117,000	1,010,880.00	0.05
183	301408	华人健康	54,200	1,005,952.00	0.05
184	600258	首旅酒店	59,200	991,600.00	0.05
185	300283	温州宏丰	129,000	971,370.00	0.05
186	688700	东威科技	27,446	968,294.88	0.05
187	600004	白云机场	102,100	965,866.00	0.05
188	300034	钢研高纳	48,600	951,588.00	0.05
189	301529	福赛科技	8,400	950,040.00	0.05
190	688148	芳源股份	108,100	948,037.00	0.05
191	600143	金发科技	48,400	945,736.00	0.05
192	688180	君实生物	27,593	942,576.88	0.05
193	002950	奥美医疗	85,300	931,476.00	0.04
194	300709	精研科技	19,496	919,431.36	0.04
195	300418	昆仑万维	21,900	913,230.00	0.04
196	601187	厦门银行	122,922	902,247.48	0.04
197	002614	奥佳华	123,400	902,054.00	0.04
198	300735	光弘科技	36,100	897,446.00	0.04

199	688222	成都先导	38,167	895,016.15	0.04
200	300132	青松股份	102,440	892,252.40	0.04
201	688387	信科移动	69,100	891,390.00	0.04
202	688668	鼎通科技	7,100	880,400.00	0.04
203	002436	兴森科技	41,500	878,555.00	0.04
204	002758	浙农股份	87,200	878,104.00	0.04
205	002463	沪电股份	12,000	876,840.00	0.04
206	600015	华夏银行	127,100	873,177.00	0.04
207	300867	圣元环保	45,800	872,948.00	0.04
208	688023	安恒信息	16,624	854,639.84	0.04
209	002255	海陆重工	67,300	849,326.00	0.04
210	002803	吉宏股份	51,300	839,268.00	0.04
211	301526	国际复材	119,700	837,900.00	0.04
212	002195	岩山科技	113,800	806,842.00	0.04
213	002293	罗莱生活	77,000	790,790.00	0.04
214	002273	水晶光电	31,000	778,720.00	0.04
215	301038	深水规院	33,200	778,540.00	0.04
216	688099	晶晨股份	8,900	776,347.00	0.04
217	688001	华兴源创	25,675	774,871.50	0.04
218	000726	鲁泰 A	106,700	759,704.00	0.04
219	300171	东富龙	47,800	750,460.00	0.04
220	002292	奥飞娱乐	83,700	740,745.00	0.04
221	300172	中电环保	135,100	736,295.00	0.04
222	600115	中国东航	122,100	732,600.00	0.04
223	603288	海天味业	19,700	729,294.00	0.04
224	300153	科泰电源	24,900	723,843.00	0.03
225	300219	鸿利智汇	98,000	706,580.00	0.03
226	600009	上海机场	21,500	704,340.00	0.03
227	002367	康力电梯	87,100	702,026.00	0.03
228	601169	北京银行	127,500	698,700.00	0.03
229	002612	朗姿股份	33,800	690,872.00	0.03
230	600742	富维股份	68,700	687,000.00	0.03
231	601229	上海银行	67,900	685,790.00	0.03
232	688095	福昕软件	7,671	684,790.17	0.03
233	601600	中国铝业	55,700	680,654.00	0.03
234	688135	利扬芯片	24,399	677,316.24	0.03
235	600814	杭州解百	82,800	670,680.00	0.03
236	601918	新集能源	100,900	666,949.00	0.03
237	000425	徐工机械	57,500	665,850.00	0.03
238	601766	中国中车	97,600	665,632.00	0.03
239	300259	新天科技	149,100	662,004.00	0.03
240	300299	富春股份	91,800	651,780.00	0.03
241	603365	水星家纺	30,900	650,136.00	0.03

242	301138	华研精机	15,900	616,920.00	0.03
243	688136	科兴制药	19,462	616,361.54	0.03
244	600741	华域汽车	30,800	616,000.00	0.03
245	600546	山煤国际	60,900	614,481.00	0.03
246	600212	绿能慧充	76,300	614,215.00	0.03
247	002016	世荣兆业	106,200	613,836.00	0.03
248	688275	万润新能	8,124	612,549.60	0.03
249	002111	威海广泰	58,200	612,264.00	0.03
250	688584	上海合晶	27,900	612,126.00	0.03
251	688499	利元亨	10,602	611,947.44	0.03
252	601816	京沪高铁	118,300	609,245.00	0.03
253	300136	信维通信	9,800	607,600.00	0.03
254	603166	福达股份	38,600	606,020.00	0.03
255	002440	闰土股份	80,900	604,323.00	0.03
256	002142	宁波银行	21,500	603,935.00	0.03
257	300434	金石亚药	57,900	595,212.00	0.03
258	002116	中国海诚	57,700	593,156.00	0.03
259	600267	海正药业	59,700	590,433.00	0.03
260	002358	森源电气	107,800	584,276.00	0.03
261	688031	星环科技	5,400	584,226.00	0.03
262	000993	闽东电力	47,800	572,644.00	0.03
263	000301	东方盛虹	51,300	558,657.00	0.03
264	002365	永安药业	37,400	558,008.00	0.03
265	600016	民生银行	144,800	554,584.00	0.03
266	688146	中船特气	13,700	553,480.00	0.03
267	600057	厦门象屿	64,900	552,948.00	0.03
268	300100	双林股份	13,900	550,718.00	0.03
269	300662	科锐国际	21,700	549,661.00	0.03
270	601238	广汽集团	67,200	548,352.00	0.03
271	688235	百济神州	2,000	537,200.00	0.03
272	300221	银禧科技	52,000	536,640.00	0.03
273	002488	金固股份	60,600	532,674.00	0.03
274	600372	中航机载	39,100	524,722.00	0.03
275	000895	双汇发展	19,800	524,106.00	0.03
276	300407	凯发电气	45,900	519,588.00	0.03
277	600219	南山铝业	96,500	519,170.00	0.03
278	688255	凯尔达	14,068	515,310.84	0.02
279	300763	锦浪科技	7,200	514,152.00	0.02
280	300289	利德曼	73,200	510,204.00	0.02
281	301116	益客食品	46,500	508,245.00	0.02
282	688046	药康生物	33,067	507,909.12	0.02
283	601998	中信银行	65,700	505,890.00	0.02
284	300644	南京聚隆	13,700	505,667.00	0.02

285	300771	智莱科技	32,500	503,750.00	0.02
286	603682	锦和商管	76,400	503,476.00	0.02
287	300381	溢多利	76,900	501,388.00	0.02
288	300627	华测导航	14,300	499,213.00	0.02
289	300435	中泰股份	22,300	495,506.00	0.02
290	688561	奇安信	13,826	491,929.08	0.02
291	301082	久盛电气	27,300	488,670.00	0.02
292	300223	北京君正	4,600	487,784.00	0.02
293	000831	中国稀土	10,500	487,620.00	0.02
294	688220	翱捷科技	5,853	483,516.33	0.02
295	300753	爱朋医疗	17,400	482,850.00	0.02
296	301175	中科环保	81,400	481,074.00	0.02
297	002090	金智科技	40,700	480,260.00	0.02
298	600722	金牛化工	80,200	476,388.00	0.02
299	300118	东方日升	32,300	473,518.00	0.02
300	002493	荣盛石化	40,200	470,742.00	0.02
301	300054	鼎龙股份	12,300	462,480.00	0.02
302	688331	荣昌生物	5,900	458,961.00	0.02
303	002386	天原股份	84,000	456,120.00	0.02
304	300214	日科化学	68,100	454,908.00	0.02
305	300509	新美星	34,500	442,980.00	0.02
306	688678	福立旺	18,300	442,494.00	0.02
307	300016	北陆药业	55,600	441,464.00	0.02
308	300741	华宝股份	23,600	438,488.00	0.02
309	688333	铂力特	3,900	434,889.00	0.02
310	002931	锋龙股份	13,700	434,290.00	0.02
311	002033	丽江股份	47,200	431,880.00	0.02
312	000011	深物业 A	47,800	430,678.00	0.02
313	300296	利亚德	67,300	425,336.00	0.02
314	300201	海伦哲	62,000	423,460.00	0.02
315	002593	日上集团	71,300	421,383.00	0.02
316	600406	国电南瑞	18,700	420,376.00	0.02
317	300905	宝丽迪	13,000	418,990.00	0.02
318	301073	君亭酒店	16,000	416,960.00	0.02
319	688484	南芯科技	10,200	414,732.00	0.02
320	300726	宏达电子	8,000	407,280.00	0.02
321	000949	新乡化纤	73,700	405,350.00	0.02
322	688362	甬矽电子	12,455	403,666.55	0.02
323	688182	灿勤科技	13,400	395,568.00	0.02
324	600989	宝丰能源	20,000	392,600.00	0.02
325	300248	新开普	31,500	390,915.00	0.02
326	301165	锐捷网络	4,400	390,720.00	0.02
327	603118	共进股份	33,900	389,850.00	0.02

328	300503	昊志机电	6,100	388,692.00	0.02
329	603185	弘元绿能	12,700	387,350.00	0.02
330	300702	天宇股份	16,400	387,040.00	0.02
331	600853	龙建股份	89,300	386,669.00	0.02
332	301558	三态股份	46,800	381,420.00	0.02
333	600757	长江传媒	42,700	379,176.00	0.02
334	688187	时代电气	7,300	374,417.00	0.02
335	300596	利安隆	8,800	371,448.00	0.02
336	688158	优刻得	13,200	370,788.00	0.02
337	301230	泓博医药	12,400	370,388.00	0.02
338	601326	秦港股份	104,800	365,752.00	0.02
339	600549	厦门钨业	8,800	361,328.00	0.02
340	300101	振芯科技	12,700	361,061.00	0.02
341	688435	英方软件	7,700	360,129.00	0.02
342	002048	宁波华翔	11,400	358,644.00	0.02
343	000009	中国宝安	35,700	351,645.00	0.02
344	300973	立高食品	8,100	348,300.00	0.02
345	301509	金凯生科	10,200	344,556.00	0.02
346	300382	斯莱克	22,100	343,876.00	0.02
347	002746	仙坛股份	56,400	342,348.00	0.02
348	600971	恒源煤电	54,800	341,952.00	0.02
349	301022	海泰科	10,300	340,827.00	0.02
350	300375	鹏翎股份	64,700	340,322.00	0.02
351	300567	精测电子	3,700	337,440.00	0.02
352	000919	金陵药业	42,400	337,080.00	0.02
353	300458	全志科技	7,900	332,037.00	0.02
354	000601	韶能股份	70,600	331,820.00	0.02
355	688237	超卓航科	6,726	327,892.50	0.02
356	000755	山西高速	65,200	327,304.00	0.02
357	688141	杰华特	7,500	325,725.00	0.02
358	688249	晶合集成	9,800	325,262.00	0.02
359	600782	新钢股份	83,600	324,368.00	0.02
360	688660	电气风电	18,900	321,489.00	0.02
361	600335	国机汽车	49,100	319,641.00	0.02
362	002636	金安国纪	19,100	319,161.00	0.02
363	002409	雅克科技	4,300	318,630.00	0.02
364	300681	英搏尔	12,700	318,262.00	0.02
365	000988	华工科技	4,000	317,320.00	0.02
366	600598	北大荒	20,800	310,960.00	0.02
367	600893	航发动力	7,700	308,231.00	0.01
368	002697	红旗连锁	51,800	307,692.00	0.01
369	002942	新农股份	16,000	307,520.00	0.01
370	601949	中国出版	47,500	306,375.00	0.01

371	600576	祥源文旅	48,700	303,888.00	0.01
372	688443	智翔金泰	11,000	299,640.00	0.01
373	000423	东阿阿胶	6,100	299,388.00	0.01
374	301286	侨源股份	7,000	296,030.00	0.01
375	000060	中金岭南	50,600	296,010.00	0.01
376	688372	伟测科技	2,700	294,543.00	0.01
377	301128	强瑞技术	2,900	292,639.00	0.01
378	301109	军信股份	19,500	292,500.00	0.01
379	600748	上实发展	53,800	291,596.00	0.01
380	300059	东方财富	12,400	287,432.00	0.01
381	603596	伯特利	5,600	287,112.00	0.01
382	688388	嘉元科技	7,000	286,860.00	0.01
383	601818	光大银行	81,900	285,831.00	0.01
384	600300	维维股份	80,500	282,555.00	0.01
385	301158	德石股份	12,400	277,388.00	0.01
386	688525	佰维存储	2,400	275,496.00	0.01
387	002772	众兴菌业	18,800	274,292.00	0.01
388	000990	诚志股份	34,600	274,032.00	0.01
389	001337	四川黄金	9,800	273,028.00	0.01
390	600352	浙江龙盛	25,600	272,896.00	0.01
391	688202	美迪西	4,800	270,720.00	0.01
392	300774	倍杰特	14,200	269,800.00	0.01
393	001965	招商公路	26,700	269,136.00	0.01
394	301048	金鹰重工	23,600	269,040.00	0.01
395	600717	天津港	59,900	267,753.00	0.01
396	300698	万马科技	6,300	265,419.00	0.01
397	600075	新疆天业	53,400	264,330.00	0.01
398	300871	回盛生物	12,600	261,198.00	0.01
399	300995	奇德新材	6,300	260,253.00	0.01
400	300513	恒实科技	27,400	260,026.00	0.01
401	600535	天士力	17,100	257,697.00	0.01
402	688084	晶品特装	3,100	256,680.00	0.01
403	600886	国投电力	19,100	250,592.00	0.01
404	002246	北化股份	13,900	250,478.00	0.01
405	301611	珂玛科技	2,900	248,617.00	0.01
406	688602	康鹏科技	28,600	248,248.00	0.01
407	301308	江波龙	1,000	244,840.00	0.01
408	688609	九联科技	23,964	244,672.44	0.01
409	688590	新致软件	13,100	244,446.00	0.01
410	600425	青松建化	58,700	244,192.00	0.01
411	000568	泸州老窖	2,100	244,062.00	0.01
412	002349	精华制药	33,500	243,210.00	0.01
413	000978	桂林旅游	33,500	242,540.00	0.01

414	688162	巨一科技	7,760	239,008.00	0.01
415	600686	金龙汽车	13,300	235,942.00	0.01
416	600571	信雅达	14,800	235,024.00	0.01
417	688377	迪威尔	6,400	234,880.00	0.01
418	002967	广电计量	10,600	233,306.00	0.01
419	688778	厦钨新能	3,000	232,110.00	0.01
420	300980	祥源新材	7,100	231,673.00	0.01
421	688036	传音控股	3,500	231,560.00	0.01
422	688281	华秦科技	3,100	228,780.00	0.01
423	603167	渤海轮渡	24,100	227,263.00	0.01
424	000026	飞亚达	13,800	226,044.00	0.01
425	688312	燕麦科技	6,700	222,306.00	0.01
426	002010	传化智联	37,500	217,875.00	0.01
427	002487	大金重工	4,100	212,913.00	0.01
428	301607	富特科技	5,300	212,583.00	0.01
429	000792	盐湖股份	7,500	211,200.00	0.01
430	002258	利尔化学	16,000	208,800.00	0.01
431	300747	锐科激光	7,700	208,131.00	0.01
432	300884	狄耐克	13,800	204,240.00	0.01
433	601999	出版传媒	29,600	203,352.00	0.01
434	688506	百利天恒	617	199,352.70	0.01
435	301026	浩通科技	7,000	198,380.00	0.01
436	688458	美芯晟	4,952	196,297.28	0.01
437	601628	中国人寿	4,300	195,650.00	0.01
438	688536	思瑞浦	1,205	192,655.40	0.01
439	300247	融捷健康	37,200	190,836.00	0.01
440	600908	无锡银行	31,900	189,167.00	0.01
441	601128	常熟银行	26,800	188,672.00	0.01
442	603019	中科曙光	2,200	188,408.00	0.01
443	600497	驰宏锌锗	25,600	187,136.00	0.01
444	300873	海晨股份	8,500	186,745.00	0.01
445	600027	华电国际	37,500	186,000.00	0.01
446	300047	天源迪科	14,800	185,740.00	0.01
447	688128	中国电研	6,305	183,349.40	0.01
448	301316	慧博云通	4,100	183,188.00	0.01
449	300018	中元股份	16,600	182,600.00	0.01
450	300269	联建光电	27,500	180,400.00	0.01
451	000910	大亚圣象	24,100	179,786.00	0.01
452	601665	齐鲁银行	31,246	179,352.04	0.01
453	002878	元隆雅图	9,800	178,556.00	0.01
454	600704	物产中大	32,000	178,240.00	0.01
455	600999	招商证券	10,700	178,048.00	0.01
456	002787	华源控股	14,300	178,035.00	0.01

457	603126	中材节能	26,400	177,408.00	0.01
458	601997	贵阳银行	30,000	176,100.00	0.01
459	603323	苏农银行	34,600	174,730.00	0.01
460	000828	东莞控股	16,200	174,312.00	0.01
461	301511	德福科技	4,800	171,792.00	0.01
462	300390	天华新能	3,100	169,291.00	0.01
463	300043	星辉娱乐	29,800	168,370.00	0.01
464	301338	凯格精机	1,900	167,409.00	0.01
465	603565	中谷物流	16,400	164,656.00	0.01
466	002467	二六三	26,800	163,212.00	0.01
467	300999	金龙鱼	5,600	160,944.00	0.01
468	600269	赣粤高速	31,000	160,890.00	0.01
469	002523	天桥起重	37,300	160,017.00	0.01
470	688343	云天励飞	2,100	159,768.00	0.01
471	300733	西菱动力	8,500	159,715.00	0.01
472	601000	唐山港	40,900	157,056.00	0.01
473	603687	大胜达	16,400	156,292.00	0.01
474	300779	惠城环保	1,200	156,132.00	0.01
475	600126	杭钢股份	19,000	155,040.00	0.01
476	002755	奥赛康	9,400	153,502.00	0.01
477	601658	邮储银行	27,700	150,965.00	0.01
478	002394	联发股份	9,200	145,912.00	0.01
479	002250	联化科技	10,900	145,842.00	0.01
480	002556	辉隆股份	23,700	143,148.00	0.01
481	000963	华东医药	3,600	142,020.00	0.01
482	300548	长芯博创	1,000	142,000.00	0.01
483	000733	振华科技	2,700	141,507.00	0.01
484	603967	中创物流	10,300	141,419.00	0.01
485	300624	万兴科技	2,000	141,300.00	0.01
486	002314	南山控股	49,500	141,075.00	0.01
487	600469	风神股份	20,300	140,882.00	0.01
488	300380	安硕信息	3,400	140,658.00	0.01
489	300395	菲利华	1,400	140,420.00	0.01
490	300207	欣旺达	5,300	138,595.00	0.01
491	600729	重庆百货	5,300	137,800.00	0.01
492	300505	川金诺	6,100	136,579.00	0.01
493	000959	首钢股份	27,500	134,750.00	0.01
494	300708	聚灿光电	15,100	134,088.00	0.01
495	600526	菲达环保	25,000	134,000.00	0.01
496	300553	集智股份	3,300	133,287.00	0.01
497	300347	泰格医药	2,300	130,410.00	0.01
498	603466	风语筑	13,900	130,104.00	0.01
499	002867	周大生	10,600	129,108.00	0.01

500	688219	会通股份	10,300	127,926.00	0.01
501	003013	地铁设计	9,000	127,530.00	0.01
502	688030	山石网科	7,000	127,190.00	0.01
503	300049	福瑞医科	1,800	126,738.00	0.01
504	002912	中新赛克	4,200	126,588.00	0.01
505	688006	杭可科技	4,300	125,947.00	0.01
506	002317	众生药业	6,600	125,268.00	0.01
507	000555	神州信息	7,500	124,125.00	0.01
508	601019	山东出版	14,300	123,552.00	0.01
509	300400	劲拓股份	6,100	120,780.00	0.01
510	600801	华新建材	4,900	120,246.00	0.01
511	001286	陕西能源	12,800	119,168.00	0.01
512	003025	思进智能	8,200	117,834.00	0.01
513	688475	萤石网络	3,900	117,429.00	0.01
514	300045	华力创通	4,000	115,640.00	0.01
515	000050	深天马 A	12,800	115,584.00	0.01
516	002340	格林美	13,800	115,368.00	0.01
517	688098	申联生物	12,975	115,218.00	0.01
518	300719	安达维尔	6,300	114,093.00	0.01
519	000019	深粮控股	16,400	113,980.00	0.01
520	002245	蔚蓝锂芯	6,400	113,920.00	0.01
521	002155	湖南黄金	5,400	113,886.00	0.01
522	002327	富安娜	16,700	112,057.00	0.01
523	300558	贝达药业	2,400	112,056.00	0.01
524	688601	力芯微	2,600	110,734.00	0.01
525	002572	索菲亚	8,100	110,241.00	0.01
526	300927	江天化学	4,700	109,557.00	0.01
527	688028	沃尔德	1,689	109,008.06	0.01
528	300102	乾照光电	3,900	107,484.00	0.01
529	603489	八方股份	3,500	107,030.00	0.01
530	603115	海星股份	5,700	106,647.00	0.01
531	688191	智洋创新	3,300	106,194.00	0.01
532	300145	南方泵业	22,100	104,312.00	0.01
533	600416	湘电股份	6,600	104,148.00	0.01
534	688327	云从科技	7,200	103,464.00	0.00
535	300693	盛弘股份	2,700	103,356.00	0.00
536	600798	宁波海运	28,900	101,728.00	0.00
537	300832	新产业	1,800	101,250.00	0.00
538	600787	中储股份	17,800	100,036.00	0.00
539	601018	宁波港	27,500	99,825.00	0.00
540	300403	汉宇集团	6,900	99,429.00	0.00
541	300872	天阳科技	4,800	98,688.00	0.00
542	601866	中远海发	39,100	98,532.00	0.00

543	002153	石基信息	9,000	97,470.00	0.00
544	601900	南方传媒	7,200	96,552.00	0.00
545	601518	吉林高速	33,600	94,752.00	0.00
546	600100	同方股份	10,600	94,552.00	0.00
547	002284	亚太股份	6,300	94,059.00	0.00
548	603858	步长制药	6,000	93,840.00	0.00
549	300765	新诺威	2,600	93,782.00	0.00
550	300485	赛升药业	8,700	92,046.00	0.00
551	600548	深高速	10,400	91,520.00	0.00
552	000920	沃顿科技	7,300	90,885.00	0.00
553	600320	振华重工	17,400	89,610.00	0.00
554	600166	福田汽车	30,600	89,352.00	0.00
555	002241	歌尔股份	3,100	89,063.00	0.00
556	002460	赣锋锂业	1,400	88,046.00	0.00
557	301367	瑞迈特	1,000	85,710.00	0.00
558	300087	荃银高科	7,300	85,264.00	0.00
559	002975	博杰股份	1,100	84,700.00	0.00
560	688428	诺诚健华	4,122	84,583.44	0.00
561	600803	新奥股份	4,000	83,040.00	0.00
562	603659	璞泰来	3,000	82,020.00	0.00
563	600805	悦达投资	15,100	81,993.00	0.00
564	300932	三友联众	6,700	80,333.00	0.00
565	600278	东方创业	10,500	79,800.00	0.00
566	601022	宁波远洋	8,700	79,779.00	0.00
567	603551	奥普科技	6,800	78,812.00	0.00
568	300850	新强联	1,900	78,603.00	0.00
569	688425	铁建重工	15,000	76,050.00	0.00
570	688720	艾森股份	1,073	75,517.74	0.00
571	601890	亚星锚链	7,300	75,117.00	0.00
572	600366	宁波韵升	5,400	74,466.00	0.00
573	002648	卫星化学	4,200	74,256.00	0.00
574	300224	正海磁材	4,800	74,208.00	0.00
575	301155	海力风电	900	72,837.00	0.00
576	600282	南钢股份	13,800	72,588.00	0.00
577	600382	广东明珠	10,100	72,013.00	0.00
578	300801	泰和科技	2,600	71,838.00	0.00
579	300979	华利集团	1,400	70,294.00	0.00
580	688209	英集芯	3,500	69,790.00	0.00
581	002918	蒙娜丽莎	4,900	69,727.00	0.00
582	002709	天赐材料	1,500	69,495.00	0.00
583	300488	恒锋工具	2,100	68,544.00	0.00
584	688311	盟升电子	1,500	68,400.00	0.00
585	300619	金银河	1,500	65,850.00	0.00

586	600120	浙江东方	10,400	64,168.00	0.00
587	002905	金逸影视	5,600	63,280.00	0.00
588	603726	朗迪集团	2,600	62,920.00	0.00
589	688656	浩欧博	400	61,520.00	0.00
590	002406	远东传动	7,700	61,138.00	0.00
591	600395	盘江股份	13,100	61,046.00	0.00
592	301321	翰博高新	3,200	60,960.00	0.00
593	688227	品高股份	926	60,199.26	0.00
594	300238	冠昊生物	4,300	59,555.00	0.00
595	600758	辽宁能源	16,200	58,968.00	0.00
596	301606	绿联科技	1,000	58,740.00	0.00
597	688259	创耀科技	1,400	58,520.00	0.00
598	688131	皓元医药	800	57,664.00	0.00
599	688662	富信科技	1,119	57,348.75	0.00
600	300328	宜安科技	3,300	56,331.00	0.00
601	600558	大西洋	9,200	56,120.00	0.00
602	301270	汉仪股份	1,500	56,070.00	0.00
603	002391	长青股份	9,400	55,742.00	0.00
604	600738	丽尚国潮	10,600	54,696.00	0.00
605	300664	鹏鹞环保	10,200	54,672.00	0.00
606	301299	卓创资讯	1,000	54,380.00	0.00
607	605138	盛泰集团	7,700	53,592.00	0.00
608	002372	伟星新材	5,100	53,193.00	0.00
609	002419	天虹股份	9,600	53,088.00	0.00
610	002128	电投能源	1,900	53,029.00	0.00
611	600479	千金药业	5,200	52,832.00	0.00
612	000539	粤电力 A	11,800	52,156.00	0.00
613	600111	北方稀土	1,100	50,732.00	0.00
614	300920	润阳科技	1,100	50,677.00	0.00
615	688356	键凯科技	600	49,320.00	0.00
616	300244	迪安诊断	3,100	49,135.00	0.00
617	300001	特锐德	1,900	48,792.00	0.00
618	300859	西域旅游	1,300	48,061.00	0.00
619	600780	通宝能源	8,400	47,712.00	0.00
620	301110	青木科技	700	46,326.00	0.00
621	301101	明月镜片	1,100	45,573.00	0.00
622	300378	鼎捷数智	1,000	45,260.00	0.00
623	300942	易瑞生物	4,700	44,227.00	0.00
624	000017	深中华 A	5,600	44,072.00	0.00
625	603648	畅联股份	4,000	43,600.00	0.00
626	000800	一汽解放	6,200	42,036.00	0.00
627	301111	粤万年青	2,200	41,866.00	0.00
628	688360	德马科技	1,900	40,394.00	0.00

629	601198	东兴证券	2,900	40,252.00	0.00
630	601928	凤凰传媒	4,000	40,160.00	0.00
631	688612	威迈斯	1,200	39,564.00	0.00
632	688070	纵横股份	711	39,389.40	0.00
633	300546	雄帝科技	1,500	39,285.00	0.00
634	300318	博晖创新	6,200	38,874.00	0.00
635	300787	海能实业	3,300	38,775.00	0.00
636	688183	生益电子	394	37,701.86	0.00
637	300357	我武生物	1,300	36,855.00	0.00
638	600572	康恩贝	8,100	36,126.00	0.00
639	601599	浙文影业	8,900	35,422.00	0.00
640	600496	精工钢构	8,500	35,275.00	0.00
641	300858	科拓生物	2,100	35,217.00	0.00
642	600965	福成股份	5,900	35,105.00	0.00
643	000581	威孚高科	1,700	35,054.00	0.00
644	688167	炬光科技	200	35,014.00	0.00
645	000902	新洋丰	2,200	34,364.00	0.00
646	301568	思泰克	700	33,971.00	0.00
647	603739	蔚蓝生物	2,400	33,960.00	0.00
648	600398	海澜之家	5,600	33,880.00	0.00
649	600968	海油发展	8,800	33,792.00	0.00
650	002626	金达威	1,700	33,507.00	0.00
651	688819	天能股份	1,001	33,253.22	0.00
652	002181	粤传媒	3,800	32,756.00	0.00
653	600050	中国联通	6,300	32,193.00	0.00
654	600617	国新能源	10,200	32,028.00	0.00
655	002060	广东建工	8,500	30,600.00	0.00
656	002162	悦心健康	6,400	29,824.00	0.00
657	300342	天银机电	900	29,817.00	0.00
658	003012	东鹏控股	4,500	29,475.00	0.00
659	300066	三川智慧	4,700	29,281.00	0.00
660	002206	海利得	4,900	28,665.00	0.00
661	000543	皖能电力	3,600	28,620.00	0.00
662	002991	甘源食品	500	28,455.00	0.00
663	000404	长虹华意	4,100	27,757.00	0.00
664	300041	回天新材	2,500	27,700.00	0.00
665	300290	荣科科技	1,000	27,530.00	0.00
666	688631	莱斯信息	400	27,232.00	0.00
667	300739	明阳电路	1,400	25,732.00	0.00
668	688636	智明达	600	25,704.00	0.00
669	601963	重庆银行	2,300	24,909.00	0.00
670	600017	日照港	8,100	24,300.00	0.00
671	600127	金健米业	3,600	24,192.00	0.00

672	300473	德尔股份	800	23,824.00	0.00
673	600108	亚盛集团	7,500	23,625.00	0.00
674	300515	三德科技	1,200	23,592.00	0.00
675	600827	百联股份	2,600	23,374.00	0.00
676	002468	申通快递	1,700	22,814.00	0.00
677	601083	锦江航运	2,000	22,320.00	0.00
678	600362	江西铜业	400	21,968.00	0.00
679	300806	斯迪克	700	21,518.00	0.00
680	603890	春秋电子	1,300	20,969.00	0.00
681	603387	基蛋生物	2,500	20,925.00	0.00
682	603367	辰欣药业	1,200	20,784.00	0.00
683	600970	中材国际	2,000	20,780.00	0.00
684	300240	飞力达	2,700	20,358.00	0.00
685	002765	蓝黛科技	1,500	20,055.00	0.00
686	301358	湖南裕能	300	19,398.00	0.00
687	603817	海峡环保	2,600	18,434.00	0.00
688	301439	泓淋电力	1,200	17,892.00	0.00
689	600273	嘉化能源	2,000	17,480.00	0.00
690	001332	锡装股份	300	16,857.00	0.00
691	002389	航天彩虹	700	16,786.00	0.00
692	002545	东方铁塔	900	16,605.00	0.00
693	002345	潮宏基	1,300	16,250.00	0.00
694	600710	苏美达	1,500	16,215.00	0.00
695	600662	外服控股	3,200	16,064.00	0.00
696	301339	通行宝	1,100	15,994.00	0.00
697	300409	道氏技术	700	15,743.00	0.00
698	601717	中创智领	600	14,730.00	0.00
699	301021	英诺激光	300	14,595.00	0.00
700	300940	南极光	500	14,230.00	0.00
701	301055	张小泉	700	13,727.00	0.00
702	603708	家家悦	1,100	13,013.00	0.00
703	600380	健康元	1,100	12,705.00	0.00
704	600663	陆家嘴	1,600	12,656.00	0.00
705	688352	颀中科技	1,000	12,610.00	0.00
706	002242	九阳股份	1,200	12,528.00	0.00
707	688543	国科军工	200	12,414.00	0.00
708	688199	久日新材	509	11,997.13	0.00
709	301000	肇民科技	300	11,811.00	0.00
710	300363	博腾股份	500	11,620.00	0.00
711	002958	青农商行	3,700	11,470.00	0.00
712	301382	蜂助手	300	10,632.00	0.00
713	600064	南京高科	1,200	10,416.00	0.00
714	000778	新兴铸管	2,400	10,032.00	0.00

715	600819	耀皮玻璃	1,200	9,696.00	0.00
716	000576	甘化科工	900	9,477.00	0.00
717	002042	华孚时尚	2,200	9,350.00	0.00
718	603999	读者传媒	1,300	9,139.00	0.00
719	000501	武商集团	900	9,108.00	0.00
720	002233	塔牌集团	1,000	9,010.00	0.00
721	601163	三角轮胎	600	8,574.00	0.00
722	002014	永新股份	700	8,344.00	0.00
723	300130	新国都	300	8,319.00	0.00
724	300420	五洋自控	2,000	7,980.00	0.00
725	002508	老板电器	400	7,740.00	0.00
726	603538	美诺华	400	7,696.00	0.00
727	002946	新乳业	400	7,412.00	0.00
728	300416	苏试试验	400	7,136.00	0.00
729	300310	宜通世纪	1,200	7,092.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	39,976,138.00	44.36
2	601318	中国平安	27,943,080.00	31.01
3	601398	工商银行	21,042,268.00	23.35
4	600519	贵州茅台	20,982,987.28	23.28
5	601899	紫金矿业	19,747,142.00	21.91
6	000333	美的集团	19,637,115.00	21.79
7	601166	兴业银行	18,620,851.00	20.66
8	300604	长川科技	18,213,022.32	20.21
9	300308	中际旭创	18,161,085.00	20.15
10	600919	江苏银行	17,484,127.00	19.40
11	300274	阳光电源	16,953,240.00	18.81
12	600941	中国移动	15,417,565.00	17.11
13	600887	伊利股份	15,219,997.00	16.89
14	601088	中国神华	15,004,009.00	16.65
15	603259	药明康德	14,799,059.00	16.42
16	300433	蓝思科技	14,653,058.74	16.26
17	300502	新易盛	14,473,624.00	16.06
18	688981	中芯国际	14,138,748.88	15.69
19	688008	澜起科技	13,961,837.29	15.49
20	600150	中国船舶	13,870,782.22	15.39
21	600309	万华化学	13,545,861.00	15.03

22	002415	海康威视	13,535,551.00	15.02
23	600276	恒瑞医药	12,990,801.05	14.41
24	600031	三一重工	12,927,573.00	14.34
25	300394	天孚通信	12,882,469.13	14.29
26	600547	山东黄金	12,560,582.00	13.94
27	601328	交通银行	12,542,694.00	13.92
28	300124	汇川技术	12,532,648.70	13.91
29	600183	生益科技	12,344,753.36	13.70
30	300476	胜宏科技	12,278,043.90	13.62
31	002558	巨人网络	12,233,296.00	13.57
32	600660	福耀玻璃	11,946,257.00	13.26
33	600795	国电电力	11,569,981.00	12.84
34	600019	宝钢股份	11,498,124.00	12.76
35	603799	华友钴业	11,129,395.00	12.35
36	002281	光迅科技	11,037,924.00	12.25
37	688608	恒玄科技	10,814,608.18	12.00
38	002475	立讯精密	10,779,488.00	11.96
39	600406	国电南瑞	10,352,139.00	11.49
40	688041	海光信息	10,333,797.08	11.47
41	688111	金山办公	10,333,348.88	11.47
42	601988	中国银行	10,289,602.00	11.42
43	688256	寒武纪	10,154,598.02	11.27
44	600489	中金黄金	10,018,747.00	11.12
45	300438	鹏辉能源	9,936,028.08	11.03
46	601857	中国石油	9,915,132.00	11.00
47	688108	赛诺医疗	9,855,238.90	10.94
48	300033	同花顺	9,817,200.00	10.89
49	300573	兴齐眼药	9,713,345.89	10.78
50	301236	软通动力	9,607,416.00	10.66
51	601288	农业银行	9,597,197.00	10.65
52	002241	歌尔股份	9,580,327.00	10.63
53	601766	中国中车	9,539,003.00	10.58
54	002624	完美世界	9,528,551.00	10.57
55	603986	兆易创新	9,462,262.00	10.50
56	600690	海尔智家	9,390,261.00	10.42
57	000568	泸州老窖	9,231,511.00	10.24
58	300567	精测电子	9,076,049.25	10.07
59	002436	兴森科技	9,043,710.00	10.04
60	600011	华能国际	8,827,910.00	9.80
61	002414	高德红外	8,637,914.96	9.58
62	002156	通富微电	8,633,815.00	9.58
63	688180	君实生物	8,497,690.73	9.43
64	601919	中远海控	8,371,565.00	9.29

65	600699	均胜电子	8,244,150.00	9.15
66	002371	北方华创	8,232,692.39	9.14
67	603501	豪威集团	8,228,186.00	9.13
68	003816	中国广核	8,141,645.00	9.03
69	601628	中国人寿	8,123,095.00	9.01
70	601225	陕西煤业	8,106,745.00	9.00
71	601872	招商轮船	8,105,707.00	8.99
72	000338	潍柴动力	8,034,987.00	8.92
73	688235	百济神州	7,811,392.23	8.67
74	688396	华润微	7,660,718.21	8.50
75	601665	齐鲁银行	7,638,080.38	8.48
76	002463	沪电股份	7,588,389.09	8.42
77	302132	中航成飞	7,524,553.00	8.35
78	600018	上港集团	7,502,333.00	8.32
79	600497	驰宏锌锗	7,481,841.00	8.30
80	300661	圣邦股份	7,457,957.00	8.28
81	300014	亿纬锂能	7,448,424.00	8.26
82	601298	青岛港	7,448,418.00	8.26
83	688343	云天励飞	7,411,365.13	8.22
84	002920	德赛西威	7,315,349.00	8.12
85	600438	通威股份	7,281,434.00	8.08
86	600028	中国石化	7,280,045.00	8.08
87	000001	平安银行	7,167,434.00	7.95
88	603288	海天味业	7,156,462.00	7.94
89	688183	生益电子	7,134,393.88	7.92
90	000063	中兴通讯	7,124,030.00	7.91
91	300207	欣旺达	7,108,482.00	7.89
92	002916	深南电路	7,084,718.00	7.86
93	601668	中国建筑	6,962,742.00	7.73
94	300442	润泽科技	6,855,207.00	7.61
95	000009	中国宝安	6,847,350.28	7.60
96	000975	山金国际	6,844,900.10	7.60
97	601018	宁波港	6,750,391.00	7.49
98	601077	渝农商行	6,749,959.00	7.49
99	601186	中国铁建	6,743,556.00	7.48
100	601319	中国人保	6,656,599.00	7.39
101	600988	赤峰黄金	6,653,079.41	7.38
102	601179	中国西电	6,560,879.00	7.28
103	300223	北京君正	6,492,376.00	7.20
104	300456	赛微电子	6,482,064.00	7.19
105	002555	三七互娱	6,478,969.00	7.19
106	002772	众兴菌业	6,421,311.00	7.13
107	601117	中国化学	6,419,938.00	7.12

108	002603	以岭药业	6,351,587.00	7.05
109	300774	倍杰特	6,327,051.00	7.02
110	601985	中国核电	6,211,364.00	6.89
111	601888	中国中免	6,189,939.00	6.87
112	002938	鹏鼎控股	6,081,653.00	6.75
113	688062	迈威生物	6,074,651.91	6.74
114	301205	联特科技	6,035,215.00	6.70
115	600886	国投电力	6,008,337.00	6.67
116	600188	兖矿能源	5,955,088.00	6.61
117	601633	长城汽车	5,948,080.00	6.60
118	601169	北京银行	5,866,253.00	6.51
119	300458	全志科技	5,860,056.00	6.50
120	300418	昆仑万维	5,856,925.00	6.50
121	600352	浙江龙盛	5,845,794.00	6.49
122	600741	华域汽车	5,823,628.00	6.46
123	600760	中航沈飞	5,817,727.00	6.46
124	002222	福晶科技	5,798,119.00	6.43
125	600160	巨化股份	5,779,825.00	6.41
126	600332	白云山	5,703,157.00	6.33
127	300017	网宿科技	5,694,676.00	6.32
128	300496	中科创达	5,652,399.88	6.27
129	688249	晶合集成	5,641,715.39	6.26
130	688599	天合光能	5,598,682.95	6.21
131	300558	贝达药业	5,466,727.00	6.07
132	601728	中国电信	5,465,329.00	6.06
133	600535	天士力	5,420,252.00	6.01
134	002137	实益达	5,341,041.00	5.93
135	300059	东方财富	5,319,367.00	5.90
136	600585	海螺水泥	5,298,258.00	5.88
137	002625	光启技术	5,268,875.00	5.85
138	000039	中集集团	5,268,661.57	5.85
139	301165	锐捷网络	5,254,966.00	5.83
140	002683	广东宏大	5,238,132.00	5.81
141	300917	特发服务	5,225,571.00	5.80
142	600026	中远海能	5,194,145.00	5.76
143	002312	川发龙蟒	5,148,659.00	5.71
144	300450	先导智能	5,143,611.00	5.71
145	000725	京东方 A	5,120,371.00	5.68
146	002940	昂利康	5,116,002.00	5.68
147	688321	微芯生物	5,108,162.43	5.67
148	600893	航发动力	5,076,364.00	5.63
149	301095	广立微	4,988,298.00	5.54
150	600686	金龙汽车	4,979,227.00	5.53

151	000963	华东医药	4,966,608.00	5.51
152	300115	长盈精密	4,965,544.00	5.51
153	600096	云天化	4,927,632.00	5.47
154	300296	利亚德	4,919,482.00	5.46
155	300768	迪普科技	4,897,016.00	5.43
156	300132	青松股份	4,895,495.40	5.43
157	300570	太辰光	4,785,891.00	5.31
158	688772	珠海冠宇	4,759,082.97	5.28
159	603993	洛阳钼业	4,751,062.14	5.27
160	600039	四川路桥	4,745,915.88	5.27
161	000157	中联重科	4,690,534.00	5.20
162	002841	视源股份	4,585,482.00	5.09
163	601600	中国铝业	4,566,351.00	5.07
164	300008	天海防务	4,536,247.00	5.03
165	002467	二六三	4,533,112.00	5.03
166	600118	中国卫星	4,471,288.48	4.96
167	600141	兴发集团	4,462,468.00	4.95
168	002273	水晶光电	4,450,522.00	4.94
169	688099	晶晨股份	4,423,262.83	4.91
170	300139	晓程科技	4,392,023.00	4.87
171	300251	光线传媒	4,382,748.00	4.86
172	601995	中金公司	4,352,734.00	4.83
173	688220	翱捷科技	4,344,837.44	4.82
174	002138	顺络电子	4,329,855.00	4.80
175	688336	三生国健	4,327,235.10	4.80
176	601998	中信银行	4,290,878.00	4.76
177	688088	虹软科技	4,272,832.49	4.74
178	688166	博瑞医药	4,245,175.35	4.71
179	600549	厦门钨业	4,234,790.00	4.70
180	002008	大族激光	4,219,842.00	4.68
181	002444	巨星科技	4,207,938.00	4.67
182	601818	光大银行	4,199,283.00	4.66
183	601009	南京银行	4,193,126.00	4.65
184	300454	深信服	4,160,546.00	4.62
185	300748	金力永磁	4,158,390.00	4.61
186	600415	小商品城	4,142,176.00	4.60
187	600573	惠泉啤酒	4,131,481.00	4.58
188	300390	天华新能	4,083,254.00	4.53
189	688661	和林微纳	4,061,008.68	4.51
190	002074	国轩高科	4,059,711.00	4.50
191	600315	上海家化	4,035,960.00	4.48
192	002292	奥飞娱乐	3,985,077.00	4.42
193	603699	纽威股份	3,973,648.00	4.41

194	300468	四方精创	3,963,411.00	4.40
195	301150	中一科技	3,963,276.26	4.40
196	600754	锦江酒店	3,957,557.00	4.39
197	000100	TCL 科技	3,939,850.00	4.37
198	301358	湖南裕能	3,931,312.00	4.36
199	603020	爱普股份	3,911,000.00	4.34
200	603126	中材节能	3,892,819.00	4.32
201	301217	铜冠铜箔	3,881,567.00	4.31
202	600460	士兰微	3,872,618.00	4.30
203	301123	奕东电子	3,806,200.00	4.22
204	300735	光弘科技	3,760,919.00	4.17
205	600392	盛和资源	3,677,842.00	4.08
206	600007	中国国贸	3,676,589.00	4.08
207	600015	华夏银行	3,668,440.00	4.07
208	688012	中微公司	3,642,388.44	4.04
209	603697	有友食品	3,636,290.00	4.03
210	600482	中国动力	3,618,922.00	4.02
211	300408	三环集团	3,607,113.00	4.00
212	601127	赛力斯	3,591,008.00	3.98
213	000421	南京公用	3,579,736.00	3.97
214	300346	南大光电	3,551,743.80	3.94
215	002001	新和成	3,544,943.00	3.93
216	601107	四川成渝	3,538,028.00	3.93
217	300505	川金诺	3,520,794.00	3.91
218	300206	理邦仪器	3,505,903.00	3.89
219	001389	广合科技	3,505,693.00	3.89
220	600722	金牛化工	3,493,644.00	3.88
221	002004	华邦健康	3,475,976.00	3.86
222	001979	招商蛇口	3,474,091.00	3.85
223	002631	德尔未来	3,464,633.00	3.84
224	688373	盟科药业	3,463,827.07	3.84
225	600749	西藏旅游	3,449,101.00	3.83
226	002734	利民股份	3,431,305.00	3.81
227	600748	上实发展	3,422,602.81	3.80
228	600885	宏发股份	3,406,481.00	3.78
229	600030	中信证券	3,401,801.00	3.77
230	002410	广联达	3,393,658.00	3.77
231	300925	法本信息	3,380,439.00	3.75
232	601126	四方股份	3,373,235.00	3.74
233	002091	江苏国泰	3,355,611.00	3.72
234	600839	四川长虹	3,336,330.00	3.70
235	000938	紫光股份	3,336,250.46	3.70
236	600418	江淮汽车	3,321,453.00	3.69

237	600219	南山铝业	3,293,986.00	3.66
238	600120	浙江东方	3,261,644.00	3.62
239	688141	杰华特	3,249,977.05	3.61
240	301183	东田微	3,234,392.00	3.59
241	688361	中科飞测	3,175,385.79	3.52
242	002383	合众思壮	3,171,274.00	3.52
243	002152	广电运通	3,159,023.00	3.51
244	601390	中国中铁	3,158,530.00	3.50
245	301536	星宸科技	3,150,176.00	3.50
246	688472	阿特斯	3,149,246.19	3.49
247	600938	中国海油	3,145,902.00	3.49
248	000729	燕京啤酒	3,138,779.00	3.48
249	002945	华林证券	3,100,361.00	3.44
250	600478	科力远	3,096,857.00	3.44
251	000830	鲁西化工	3,068,278.00	3.40
252	002409	雅克科技	3,057,519.00	3.39
253	000933	神火股份	3,031,473.00	3.36
254	688036	传音控股	3,023,592.50	3.36
255	601058	赛轮轮胎	3,002,855.00	3.33
256	600066	宇通客车	2,971,966.00	3.30
257	000538	云南白药	2,952,853.00	3.28
258	600166	福田汽车	2,943,265.00	3.27
259	300620	光库科技	2,930,225.00	3.25
260	688365	光云科技	2,928,095.10	3.25
261	300619	金银河	2,926,099.00	3.25
262	688591	泰凌微	2,920,787.91	3.24
263	301017	漱玉平民	2,916,136.00	3.24
264	688280	精进电动	2,903,594.90	3.22
265	301082	久盛电气	2,900,116.00	3.22
266	002142	宁波银行	2,887,410.00	3.20
267	300054	鼎龙股份	2,874,439.00	3.19
268	300127	银河磁体	2,867,382.00	3.18
269	300240	飞力达	2,817,977.00	3.13
270	688222	成都先导	2,814,730.22	3.12
271	600025	华能水电	2,765,047.00	3.07
272	300063	天龙集团	2,764,501.00	3.07
273	000301	东方盛虹	2,742,269.00	3.04
274	301137	哈焊华通	2,723,767.00	3.02
275	300805	电声股份	2,721,092.00	3.02
276	002196	方正电机	2,709,061.00	3.01
277	603817	海峡环保	2,695,752.00	2.99
278	603979	金诚信	2,674,669.00	2.97
279	300003	乐普医疗	2,658,691.00	2.95

280	300760	迈瑞医疗	2,655,864.00	2.95
281	300377	赢时胜	2,651,357.00	2.94
282	600196	复星医药	2,625,093.00	2.91
283	301607	富特科技	2,624,673.00	2.91
284	002179	中航光电	2,613,926.00	2.90
285	600071	凤凰光学	2,581,500.98	2.86
286	002202	金风科技	2,567,912.00	2.85
287	688063	派能科技	2,552,037.31	2.83
288	300024	机器人	2,550,628.00	2.83
289	300058	蓝色光标	2,515,857.00	2.79
290	688347	华虹公司	2,512,004.62	2.79
291	601012	隆基绿能	2,507,692.00	2.78
292	301396	宏景科技	2,500,682.60	2.77
293	600674	川投能源	2,486,681.00	2.76
294	300413	芒果超媒	2,479,548.00	2.75
295	002703	浙江世宝	2,478,559.00	2.75
296	688322	奥比中光	2,472,562.35	2.74
297	600170	上海建工	2,466,284.00	2.74
298	688387	信科移动	2,458,475.69	2.73
299	301308	江波龙	2,452,019.00	2.72
300	688095	福昕软件	2,449,415.75	2.72
301	300921	南凌科技	2,426,188.00	2.69
302	688578	艾力斯	2,419,360.05	2.68
303	301016	雷尔伟	2,418,896.00	2.68
304	300136	信维通信	2,395,959.00	2.66
305	000988	华工科技	2,389,861.00	2.65
306	600016	民生银行	2,364,153.00	2.62
307	301120	新特电气	2,358,276.00	2.62
308	300173	ST 福能	2,340,041.00	2.60
309	603008	喜临门	2,328,893.00	2.58
310	002422	科伦药业	2,306,793.00	2.56
311	300945	曼卡龙	2,302,492.00	2.55
312	600050	中国联通	2,294,652.00	2.55
313	688275	万润新能	2,287,886.25	2.54
314	300045	华力创通	2,269,519.00	2.52
315	002095	生意宝	2,260,931.00	2.51
316	300012	华测检测	2,248,360.00	2.49
317	605133	嵘泰股份	2,245,705.50	2.49
318	300228	富瑞特装	2,238,161.00	2.48
319	002358	森源电气	2,233,362.00	2.48
320	002614	奥佳华	2,212,484.00	2.46
321	603777	来伊份	2,202,049.00	2.44
322	600372	中航机载	2,190,113.00	2.43

323	688678	福立旺	2,189,093.64	2.43
324	300283	温州宏丰	2,183,164.00	2.42
325	002318	久立特材	2,178,063.00	2.42
326	002155	湖南黄金	2,176,458.60	2.42
327	600100	同方股份	2,173,391.00	2.41
328	688199	久日新材	2,165,781.31	2.40
329	002562	兄弟科技	2,162,694.00	2.40
330	603037	凯众股份	2,151,044.00	2.39
331	600023	浙能电力	2,142,545.00	2.38
332	688779	五矿新能	2,129,276.61	2.36
333	300424	航新科技	2,115,249.00	2.35
334	688521	芯原股份	2,098,481.25	2.33
335	688629	华丰科技	2,093,122.48	2.32
336	300328	宜安科技	2,089,307.00	2.32
337	301526	国际复材	2,076,523.00	2.30
338	301110	青木科技	2,074,039.00	2.30
339	300696	爱乐达	2,064,851.00	2.29
340	601898	中煤能源	2,059,786.00	2.29
341	300474	景嘉微	2,049,098.00	2.27
342	688158	优刻得	2,043,812.04	2.27
343	002250	联化科技	2,031,970.00	2.25
344	300037	新宙邦	2,030,010.00	2.25
345	002714	牧原股份	2,028,607.66	2.25
346	688327	云从科技	2,028,315.42	2.25
347	002523	天桥起重	2,023,911.00	2.25
348	300277	海联讯	2,016,018.00	2.24
349	600798	宁波海运	2,006,351.00	2.23
350	600425	青松建化	1,984,297.00	2.20
351	688206	概伦电子	1,977,391.90	2.19
352	002028	思源电气	1,970,070.41	2.19
353	301408	华人健康	1,959,205.00	2.17
354	002950	奥美医疗	1,950,806.00	2.16
355	002460	赣锋锂业	1,928,344.00	2.14
356	002090	金智科技	1,926,405.00	2.14
357	000999	华润三九	1,924,602.00	2.14
358	688613	奥精医疗	1,923,408.97	2.13
359	301365	矩阵股份	1,905,943.00	2.11
360	600176	中国巨石	1,884,888.00	2.09
361	688469	芯联集成	1,874,278.66	2.08
362	600879	航天电子	1,871,045.00	2.08
363	601866	中远海发	1,848,796.00	2.05
364	300801	泰和科技	1,844,695.00	2.05
365	300867	圣元环保	1,835,900.00	2.04

366	000651	格力电器	1,830,756.00	2.03
367	603399	永杉锂业	1,829,099.00	2.03
368	300373	扬杰科技	1,820,136.00	2.02
369	300709	精研科技	1,819,151.36	2.02

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。

8.4.2 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	601088	中国神华	14,246,943.00	15.81
2	600183	生益科技	13,790,745.00	15.30
3	601166	兴业银行	13,160,193.00	14.60
4	600941	中国移动	13,062,689.03	14.49
5	601398	工商银行	12,682,614.00	14.07
6	300476	胜宏科技	12,521,861.00	13.89
7	601288	农业银行	11,315,370.00	12.56
8	300124	汇川技术	11,136,365.50	12.36
9	000333	美的集团	11,091,161.81	12.31
10	300604	长川科技	10,819,756.36	12.01
11	600919	江苏银行	10,579,438.00	11.74
12	300308	中际旭创	10,525,426.00	11.68
13	600406	国电南瑞	10,400,585.00	11.54
14	600489	中金黄金	9,892,271.00	10.98
15	002415	海康威视	9,628,910.50	10.68
16	000568	泸州老窖	9,420,256.00	10.45
17	300750	宁德时代	9,216,482.00	10.23
18	688008	澜起科技	8,896,596.87	9.87
19	002241	歌尔股份	8,554,471.00	9.49
20	688256	寒武纪	8,530,682.45	9.47
21	300567	精测电子	8,506,652.00	9.44
22	300394	天孚通信	8,469,194.00	9.40
23	002436	兴森科技	8,435,918.00	9.36
24	003816	中国广核	8,228,388.00	9.13
25	601628	中国人寿	8,141,469.00	9.03
26	002558	巨人网络	8,104,781.00	8.99
27	601766	中国中车	8,098,783.00	8.99
28	600699	均胜电子	7,934,817.23	8.80
29	600438	通威股份	7,898,852.00	8.76
30	300433	蓝思科技	7,856,385.00	8.72
31	002475	立讯精密	7,711,381.00	8.56
32	688183	生益电子	7,657,761.77	8.50

33	601179	中国西电	7,630,447.00	8.47
34	002772	众兴菌业	7,610,865.00	8.45
35	603501	豪威集团	7,514,138.91	8.34
36	601665	齐鲁银行	7,450,800.00	8.27
37	688235	百济神州	7,408,029.11	8.22
38	601318	中国平安	7,392,545.00	8.20
39	688180	君实生物	7,350,453.48	8.16
40	300573	兴齐眼药	7,313,432.00	8.12
41	601668	中国建筑	7,249,030.00	8.04
42	600497	驰宏锌锗	7,174,119.00	7.96
43	601857	中国石油	7,019,677.00	7.79
44	300442	润泽科技	6,962,407.06	7.73
45	688343	云天励飞	6,956,476.52	7.72
46	002463	沪电股份	6,952,138.00	7.71
47	300661	圣邦股份	6,947,949.00	7.71
48	601872	招商轮船	6,841,531.00	7.59
49	300774	倍杰特	6,828,963.48	7.58
50	600547	山东黄金	6,688,679.00	7.42
51	601985	中国核电	6,668,769.00	7.40
52	601018	宁波港	6,658,429.00	7.39
53	601186	中国铁建	6,642,318.06	7.37
54	000009	中国宝安	6,484,506.24	7.20
55	601899	紫金矿业	6,422,377.00	7.13
56	002920	德赛西威	6,409,781.59	7.11
57	000063	中兴通讯	6,327,378.25	7.02
58	603288	海天味业	6,277,840.19	6.97
59	301205	联特科技	6,220,610.00	6.90
60	300207	欣旺达	6,168,958.00	6.85
61	300223	北京君正	6,146,398.00	6.82
62	601888	中国中免	6,098,141.95	6.77
63	601298	青岛港	5,959,705.00	6.61
64	600150	中国船舶	5,956,539.00	6.61
65	600886	国投电力	5,927,692.00	6.58
66	002624	完美世界	5,922,369.00	6.57
67	600519	贵州茅台	5,900,135.00	6.55
68	601919	中远海控	5,810,899.00	6.45
69	600096	云天化	5,786,586.00	6.42
70	300456	赛微电子	5,635,836.00	6.25
71	301236	软通动力	5,544,876.00	6.15
72	300274	阳光电源	5,475,957.00	6.08
73	603993	洛阳钼业	5,470,494.17	6.07
74	600332	白云山	5,425,647.00	6.02
75	600760	中航沈飞	5,399,194.00	5.99

76	600741	华域汽车	5,331,508.64	5.92
77	600028	中国石化	5,329,970.00	5.91
78	600352	浙江龙盛	5,303,528.00	5.88
79	601077	渝农商行	5,296,596.00	5.88
80	002938	鹏鼎控股	5,224,017.00	5.80
81	601169	北京银行	5,166,228.00	5.73
82	300496	中科创达	5,118,684.00	5.68
83	600535	天士力	4,998,904.00	5.55
84	300558	贝达药业	4,965,739.00	5.51
85	600686	金龙汽车	4,946,211.00	5.49
86	300458	全志科技	4,942,462.00	5.48
87	688108	赛诺医疗	4,928,725.01	5.47
88	300418	昆仑万维	4,919,945.00	5.46
89	002683	广东宏大	4,903,616.00	5.44
90	688599	天合光能	4,895,564.94	5.43
91	688249	晶合集成	4,890,343.84	5.43
92	300115	长盈精密	4,878,351.00	5.41
93	600309	万华化学	4,873,720.00	5.41
94	688041	海光信息	4,853,655.68	5.39
95	301358	湖南裕能	4,832,284.00	5.36
96	300059	东方财富	4,785,657.00	5.31
97	300014	亿纬锂能	4,709,910.00	5.23
98	000963	华东医药	4,585,655.00	5.09
99	600660	福耀玻璃	4,581,913.00	5.08
100	600118	中国卫星	4,572,313.00	5.07
101	300390	天华新能	4,543,726.60	5.04
102	600141	兴发集团	4,534,250.00	5.03
103	301095	广立微	4,511,067.00	5.01
104	301165	锐捷网络	4,482,501.00	4.97
105	601633	长城汽车	4,473,198.00	4.96
106	601600	中国铝业	4,446,863.00	4.93
107	002281	光迅科技	4,442,928.65	4.93
108	600893	航发动力	4,399,341.00	4.88
109	300132	青松股份	4,345,357.00	4.82
110	600887	伊利股份	4,331,224.00	4.81
111	002841	视源股份	4,311,785.00	4.78
112	600188	兖矿能源	4,307,983.00	4.78
113	300296	利亚德	4,306,225.00	4.78
114	601995	中金公司	4,294,963.00	4.77
115	601988	中国银行	4,274,681.00	4.74
116	601728	中国电信	4,273,468.00	4.74
117	002138	顺络电子	4,271,444.00	4.74
118	600026	中远海能	4,208,447.00	4.67

119	603986	兆易创新	4,184,839.00	4.64
120	688661	和林微纳	4,111,186.68	4.56
121	002156	通富微电	4,071,055.00	4.52
122	600988	赤峰黄金	4,061,290.00	4.51
123	688321	微芯生物	4,057,232.45	4.50
124	002467	二六三	4,021,937.00	4.46
125	002008	大族激光	4,021,353.00	4.46
126	600549	厦门钨业	4,015,914.00	4.46
127	301217	铜冠铜箔	3,992,064.00	4.43
128	300468	四方精创	3,987,047.00	4.42
129	603699	纽威股份	3,960,958.00	4.40
130	601818	光大银行	3,912,658.00	4.34
131	601998	中信银行	3,805,811.00	4.22
132	300450	先导智能	3,802,109.00	4.22
133	600315	上海家化	3,780,602.00	4.20
134	601127	赛力斯	3,727,926.00	4.14
135	600795	国电电力	3,724,966.00	4.13
136	688772	珠海冠宇	3,723,732.00	4.13
137	601328	交通银行	3,717,621.00	4.13
138	301123	奕东电子	3,714,153.00	4.12
139	002371	北方华创	3,707,966.95	4.11
140	688062	迈威生物	3,701,766.57	4.11
141	000975	山金国际	3,685,006.00	4.09
142	688608	恒玄科技	3,626,939.30	4.02
143	300502	新易盛	3,607,036.00	4.00
144	600885	宏发股份	3,606,609.00	4.00
145	600460	士兰微	3,593,033.00	3.99
146	603799	华友钴业	3,576,795.00	3.97
147	002631	德尔未来	3,574,986.00	3.97
148	600066	宇通客车	3,574,104.26	3.97
149	301017	漱玉平民	3,572,400.00	3.96
150	600031	三一重工	3,539,194.00	3.93
151	603020	爱普股份	3,530,564.00	3.92
152	300505	川金诺	3,488,260.00	3.87
153	002273	水晶光电	3,471,008.00	3.85
154	002001	新和成	3,443,817.00	3.82
155	600749	西藏旅游	3,427,663.00	3.80
156	600219	南山铝业	3,425,451.00	3.80
157	688220	翱捷科技	3,414,669.46	3.79
158	600938	中国海油	3,406,003.00	3.78
159	301183	东田微	3,399,963.00	3.77
160	002383	合众思壮	3,397,196.00	3.77
161	002292	奥飞娱乐	3,386,279.00	3.76

162	000725	京东方 A	3,377,609.00	3.75
163	603126	中材节能	3,357,842.00	3.73
164	688361	中科飞测	3,303,740.39	3.67
165	002414	高德红外	3,297,594.10	3.66
166	600418	江淮汽车	3,259,884.00	3.62
167	002410	广联达	3,236,447.00	3.59
168	600839	四川长虹	3,221,804.00	3.57
169	688099	晶晨股份	3,184,695.88	3.53
170	601058	赛轮轮胎	3,176,320.00	3.52
171	688472	阿特斯	3,168,289.94	3.52
172	688036	传音控股	3,165,588.71	3.51
173	601009	南京银行	3,133,662.00	3.48
174	000938	紫光股份	3,126,034.00	3.47
175	002945	华林证券	3,109,402.00	3.45
176	300925	法本信息	3,087,224.00	3.43
177	002196	方正电机	3,049,008.00	3.38
178	300619	金银河	3,045,927.00	3.38
179	603979	金诚信	3,035,004.00	3.37
180	000830	鲁西化工	3,030,994.00	3.36
181	301137	哈焊华通	3,027,464.00	3.36
182	601390	中国中铁	2,984,783.00	3.31
183	301150	中一科技	2,979,137.16	3.31
184	000538	云南白药	2,919,097.00	3.24
185	600478	科力远	2,915,660.00	3.24
186	002152	广电运通	2,897,423.00	3.22
187	300570	太辰光	2,882,455.00	3.20
188	600120	浙江东方	2,838,831.00	3.15
189	603817	海峡环保	2,828,326.00	3.14
190	600015	华夏银行	2,817,522.00	3.13
191	600025	华能水电	2,785,674.00	3.09
192	600166	福田汽车	2,784,470.00	3.09
193	300377	赢时胜	2,781,643.00	3.09
194	600722	金牛化工	2,780,726.00	3.09
195	002202	金风科技	2,778,589.00	3.08
196	002312	川发龙蟒	2,740,911.13	3.04
197	600748	上实发展	2,739,301.00	3.04
198	300003	乐普医疗	2,715,693.00	3.01
199	300058	蓝色光标	2,702,599.00	3.00
200	002409	雅克科技	2,685,741.00	2.98
201	600039	四川路桥	2,663,355.00	2.96
202	300454	深信服	2,617,477.00	2.90
203	300735	光弘科技	2,612,716.00	2.90
204	688578	艾力斯	2,592,919.65	2.88

205	600196	复星医药	2,582,921.00	2.87
206	300240	飞力达	2,578,665.00	2.86
207	002422	科伦药业	2,557,930.00	2.84
208	300054	鼎龙股份	2,550,945.00	2.83
209	601225	陕西煤业	2,548,626.00	2.83
210	688981	中芯国际	2,543,522.00	2.82
211	002703	浙江世宝	2,536,423.00	2.81
212	600023	浙能电力	2,512,584.00	2.79
213	600674	川投能源	2,508,080.00	2.78
214	601012	隆基绿能	2,496,835.00	2.77
215	300228	富瑞特装	2,496,356.00	2.77
216	300045	华力创通	2,487,853.00	2.76
217	002137	实益达	2,481,185.00	2.75
218	300748	金力永磁	2,472,062.76	2.74
219	600585	海螺水泥	2,448,047.00	2.72
220	002179	中航光电	2,446,166.00	2.71
221	002078	太阳纸业	2,437,480.00	2.70
222	300921	南凌科技	2,434,207.00	2.70
223	300024	机器人	2,422,781.00	2.69
224	688141	杰华特	2,417,288.75	2.68
225	301607	富特科技	2,409,931.00	2.67
226	605133	嵘泰股份	2,405,564.00	2.67
227	300206	理邦仪器	2,402,886.00	2.67
228	688111	金山办公	2,397,271.75	2.66
229	301016	雷尔伟	2,395,262.00	2.66
230	002555	三七互娱	2,389,301.00	2.65
231	300413	芒果超媒	2,372,807.32	2.63
232	688012	中微公司	2,351,910.84	2.61
233	301308	江波龙	2,348,318.00	2.61
234	301396	宏景科技	2,339,389.00	2.60
235	300408	三环集团	2,333,689.00	2.59
236	002142	宁波银行	2,331,342.50	2.59
237	002562	兄弟科技	2,314,105.00	2.57
238	000933	神火股份	2,302,377.00	2.55
239	301082	久盛电气	2,285,237.00	2.54
240	300012	华测检测	2,282,925.00	2.53
241	001979	招商蛇口	2,280,363.00	2.53
242	002004	华邦健康	2,240,549.00	2.49
243	301120	新特电气	2,218,272.00	2.46
244	688088	虹软科技	2,214,943.29	2.46
245	300801	泰和科技	2,204,901.00	2.45
246	600050	中国联通	2,196,893.00	2.44
247	603777	来伊份	2,193,500.00	2.43

248	300328	宜安科技	2,192,956.73	2.43
249	300017	网宿科技	2,190,920.00	2.43
250	000039	中集集团	2,180,441.00	2.42
251	603037	凯众股份	2,178,216.50	2.42
252	002318	久立特材	2,167,601.00	2.41
253	600100	同方股份	2,164,846.00	2.40
254	000301	东方盛虹	2,162,099.00	2.40
255	300696	爱乐达	2,158,746.00	2.40
256	688199	久日新材	2,140,061.59	2.37
257	000999	华润三九	2,135,023.00	2.37
258	000338	潍柴动力	2,134,972.00	2.37
259	002603	以岭药业	2,126,652.00	2.36
260	301536	星宸科技	2,119,618.50	2.35
261	600690	海尔智家	2,091,149.00	2.32
262	600019	宝钢股份	2,088,308.00	2.32
263	000988	华工科技	2,086,331.00	2.32
264	300173	ST 福能	2,065,069.00	2.29
265	002095	生意宝	2,055,136.00	2.28
266	002714	牧原股份	2,042,447.40	2.27
267	300424	航新科技	2,026,954.00	2.25
268	002250	联化科技	2,017,865.00	2.24
269	688469	芯联集成	1,993,131.00	2.21
270	688222	成都先导	1,992,197.44	2.21
271	301110	青木科技	1,988,596.00	2.21
272	300438	鹏辉能源	1,973,366.00	2.19
273	603399	永杉锂业	1,969,942.00	2.19
274	300251	光线传媒	1,953,877.00	2.17
275	000100	TCL 科技	1,948,528.00	2.16
276	002155	湖南黄金	1,946,015.00	2.16
277	300474	景嘉微	1,940,474.54	2.15
278	000792	盐湖股份	1,931,743.00	2.14
279	688775	影石创新	1,926,102.00	2.14
280	601838	成都银行	1,902,594.00	2.11
281	688336	三生国健	1,899,105.47	2.11
282	601689	拓普集团	1,897,653.00	2.11
283	688387	信科移动	1,895,623.23	2.10
284	600879	航天电子	1,880,885.00	2.09
285	000505	京粮控股	1,879,017.00	2.09
286	002161	远望谷	1,853,934.00	2.06
287	600470	六国化工	1,845,824.00	2.05
288	300803	指南针	1,829,396.00	2.03
289	601319	中国人保	1,821,712.00	2.02
290	002400	省广集团	1,819,850.26	2.02

291	002523	天桥起重	1,819,009.00	2.02
292	301292	海科新源	1,815,592.00	2.01
293	600928	西安银行	1,803,259.00	2.00

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。

8.4.3 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	2,584,023,497.60
卖出股票收入（成交）总额	1,745,108,949.98

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。

8.5 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	37,205,437.54	1.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,676,271,192.95	80.87
	其中：政策性金融债	110,889,890.41	5.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,713,476,630.49	82.67

8.6 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	232580009	25 中信银行 二级资本债 01BC	1,500,000	150,585,139.73	7.26
2	232400037	24 宁波银行	1,200,000	120,906,739.7	5.83

		二级资本债 02		3	
3	232480035	24 平安银行 二级资本债 01A	1,148,000	116,963,725.2 4	5.64
4	232580035	25 农行二级 资本债 03A(BC)	1,100,000	110,579,612.6 0	5.33
5	232580012	25 中行二级 资本债 01BC	1,100,000	110,308,693.1 5	5.32

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，并积极采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对国债市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求合理的估值水平，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合整体风险的目的。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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交通银行股份有限公司,及其分支行 2025 年 1 月至 2025 年 12 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、香港金融管理局罚款、警示等。

本基金持有的前十名证券发行主体宁波银行股份有限公司,及其分支行 2025 年 1 月至 2025 年 12 月多次因违规被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行罚款、警示等。

本基金持有的前十名证券发行主体平安银行股份有限公司,及其分支行 2025 年 1 月至 2025 年 12 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、证监会分局罚款、警示等。

本基金持有的前十名证券发行主体上海银行股份有限公司,及其分支行 2025 年 1 月至 2025 年 12 月多次因违规被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行罚款、警示等。

本基金持有的前十名证券发行主体兴业银行股份有限公司,及其分支行 2025 年 1 月至 2025 年 12 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局地方分局、地方财政局、证监会分局、中国银行间市场交易商协会罚款、警示等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国工商银行股份有限公司,及其分支行 2025 年 1 月至 2025 年 12 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行及分支行、国家外汇管理局地方分局、地方财政局罚款、警示等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国农业银行股份有限公司,及其分支行 2025 年 1 月至 2025 年 12 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、证监会分局、地方财政局罚款、警示等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国银行股份有限公司,及其分支行 2025 年 1 月至 2025 年 12 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、证监会分局、深圳证券交易所罚款、警示等。

本基金持有的前十名证券发行主体中信银行股份有限公司,及其分支行 2025 年 1 月至 2025 年 12 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、警示等。

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规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规定备选股票库之外的情况。

8.12.3 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	191,265.49
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	16,530.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	207,796.41

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国泰海通君得盈债券 A	374	5,149,177.35	1,906,548,265.44	99.00%	19,244,062.28	1.00%
国泰海通君得盈债券 C	1,048	11,545.67	282,512.48	2.33%	11,817,345.26	97.67%
国泰海通君得盈债券 D	11	4,827.35	0.00	0.00%	53,100.81	100.00%
合计	1,433	1,352,369.36	1,906,830,777.92	98.39%	31,114,508.35	1.61%

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）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国泰海通君得盈债券 A	99,651.47	0.0052%
	国泰海通君得盈债券 C	63,799.19	0.5273%
	国泰海通君得盈债券 D	18,068.10	34.0260%
	合计	181,518.76	0.0094%

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）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	国泰海通君得盈 债券 A	0~10
	国泰海通君得盈 债券 C	0
	国泰海通君得盈 债券 D	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰海通君得盈 债券 A	0~10
	国泰海通君得盈 债券 C	0~10
	国泰海通君得盈 债券 D	0~10
	合计	10~50

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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰海通君得盈 债券 A	国泰海通君得 盈债券 C	国泰海通君得盈 债券 D
基金合同生效日（2021 年 01 月 28 日）基金份额总额	52,495,722.43	-	-

本报告期期初基金份额总额	48,368,446.49	40,639,395.51	-
本报告期基金总申购份额	1,897,424,980.84	4,450,135.70	1,903,276,995.55
减：本报告期基金总赎回份额	20,001,099.61	32,989,673.47	1,903,223,894.74
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,925,792,327.72	12,099,857.74	53,100.81

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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：

2025 年 4 月 26 日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，陶耿同志担任公司董事长，谢乐斌同志不再担任公司董事长，生效日期为 2025 年 4 月 25 日。

2025 年 9 月 30 日，本基金管理人发布了《关于上海国泰海通证券资产管理有限公司监事变更的公告》，根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、公司章程（2025 年 7 月修订）规定，公司不再设职工监事，原公司第二届第二次职工代表大会选举产生的职工监事王红莲不再任职公司职工监事。

2025 年 10 月 14 日，本基金管理人发布了《关于上海国泰海通证券资产管理有限公司监事变更的公告》，根据公司章程规定，经公司股东国泰海通证券股份有限公司研究决定，董博阳同志不再担任公司监事职务。

2025 年 12 月 25 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》，左秀海同志担任公司副总裁，生效日期为 2025 年 12 月 24 日。

2、本报告期内本基金托管人重大人事变动如下：

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建

信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金 9 月更换基金经理，权益投资策略改变为以中证 A500 指数增强为主的策略，并针对 A 股市场极致的结构性分化行情，辅助以特征鲜明的“哑铃型”量化配置体系。

11.5 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。报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 29,000.00 元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为 2024 年 11 月 5 日至今。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用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	交易单	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
-----	-----	------	-----------	----

称	元数量	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	4,329,132,447.58	100.00%	1,985,820.11	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。

11.7.2 基金租用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	286,201,928.93	100.00%	238,600,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 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	国泰君安君得盈债券型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-01-16

2	国泰君安君得盈债券型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-01-16
3	国泰君安君得盈债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2025年第1号）	证监会指定网站、公司官网	2025-01-16
4	国泰君安君得盈债券型证券投资基金 2024 年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-01-22
5	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 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	2025-01-22
6	国泰君安君得盈债券型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-01-22
7	国泰君安君得盈债券型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-01-22
8	国泰君安君得盈债券型证券投资基金（D类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-01-22
9	国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金合同	证监会指定网站、公司官网	2025-01-22
10	国泰君安君得盈债券型证券投资基金托管协议	证监会指定网站、公司官网	2025-01-22
11	国泰君安君得盈债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2025年第2号）	证监会指定网站、公司官网	2025-01-22
12	关于国泰君安君得盈债券型证券投资基金增加D类基金份额并修改法律文件的公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2025-01-22
13	上海国泰君安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（2024年度）	证监会指定网站、公司官网	2025-03-29
14	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 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	2025-03-31
15	国泰君安君得盈债券型证券投资基金 2024 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-03-31
16	国泰君安君得盈债券型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-04-22
17	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2025 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	2025-04-22

18	上海国泰君安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	2025-04-26
19	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于办公地址变更的公告	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、上交所	2025-04-30
20	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在蚂蚁财富开通基金转换业务的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2025-04-30
21	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	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	2025-06-11
22	国泰君安君得盈债券型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-07-21
23	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年 2 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	2025-07-21
24	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于基金管理人法定名称、住所变更的公告	证监会指定网站、公司官网、上交所	2025-07-25
25	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于基金管理人法定名称、住所变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025-07-26
26	国泰君安君得盈债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-08-02
27	国泰君安君得盈债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-08-02
28	国泰君安君得盈债券型证券投资基金（D 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-08-02
29	国泰君安君得盈债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2025 年第 3 号）	证监会指定网站、公司官网	2025-08-02
30	关于上海国泰海通证券资产管理有限公司管理人官网地址变更的公告	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、上交所	2025-08-09
31	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于吸收合并事项通知债权人的公告	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、上交所	2025-08-27
32	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年中期	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025-08-29

	报告提示性公告		
33	国泰君安君得盈债券型证券投资基金 2025 年中期报告	证监会指定网站、公司官网	2025-08-29
34	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	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	2025-09-05
35	国泰君安君得盈债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-09-09
36	国泰君安君得盈债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-09-09
37	国泰君安君得盈债券型证券投资基金（D 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-09-09
38	国泰君安君得盈债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2025 年第 4 号）	证监会指定网站、公司官网	2025-09-09
39	国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2025-09-09
40	关于提高国泰君安君得盈债券型证券投资基金 D 类份额（代码：023210）净值精度的公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2025-09-24
41	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告	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、上交所	2025-09-26
42	国泰海通君得盈债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-09-29
43	国泰海通君得盈债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-09-29
44	国泰海通君得盈债券型证券投资基金（D 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2025-09-29
45	国泰海通君得盈债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2025 年第 5 号）	证监会指定网站、公司官网	2025-09-29
46	国泰海通君得盈债券型证券投资基金基金合同	证监会指定网站、公司官网	2025-09-29
47	国泰海通君得盈债券型证券投资基金托管协议	证监会指定网站、公司官网	2025-09-29
48	关于上海国泰海通证券资产管理有限公司监事变更的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指	2025-10-14

		定网站、公司官网、上交所	
49	国泰海通君得盈债券型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-10-28
50	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年 3 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	2025-10-28
51	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、公司官网、上交所	2025-12-25
52	在本报告期内刊登的其他公告	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20250916-20251231	-	1,896,452,683.48	-	1,896,452,683.48	97.86%
	2	20250101-20250915	17,930,072.72	-	17,930,072.72	-	-

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；

(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

上海国泰海通证券资产管理有限公司（以下简称“本公司”）于 2025 年 7 月 25 日办理完成工商变更登记，公司法定名称由“上海国泰君安证券资产管理有限公司”变更为“上海国泰海通证券资产管理有限公司”。根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的要求，本公司已于 2025 年 7 月 25 日公告更名事宜。经与各基金托管人协商一致，并履行适当程序，本公司旗下的公开募集证券投资基金自 2025 年 9 月 29 日起变更基金名称（各基金的基金代码保持不变），具体情况详见管理人于 2025 年 9 月 26 日发布的《上海国泰海通证券资产管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 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>。

13.3 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
二〇二六年三月三十一日