

# 国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)

## 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:交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>6</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>8</b>
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	11
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	16
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 .....	16
<b>§ 5 托管人报告 .....</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	16
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 .....	16
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 .....	16
<b>§ 6 审计报告 .....</b>	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	16
6.2 审计报告的基本内容 .....	17
<b>§ 7 年度财务报表 .....</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表 .....	19
7.2 利润表 .....	21
7.3 净资产变动表 .....	22
7.4 报表附注 .....	23
<b>§ 8 投资组合报告 .....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	50
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 .....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	51
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 .....	51
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 .....	51

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.....	51
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.....	51
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	52
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
8.12 本报告期投资基金情况.....	52
8.13 投资组合报告附注.....	55
<b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>55</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	56
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>57</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>57</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
11.4 基金投资策略的改变.....	58
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	58
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
11.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	58
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
11.9 其他重大事件.....	60
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>62</b>

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.....	62
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>63</b>
13.1 备查文件目录.....	63
13.2 存放地点 .....	63
13.3 查阅方式 .....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)	
基金简称	国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF)	
基金主代码	952013	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 11 月 16 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	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	783,421,926.16 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) A	国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) C
下属分级基金的交易代码	952013	952313
报告期末下属分级基金的份额总额	533,151,897.31 份	250,270,028.85 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。国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划合同生效日为 2020 年 11 月 16 日，“国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划”于 2022 年 3 月 21 日变更注册为“国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)”。

国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 由国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 变更而来。国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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	在控制风险的前提下，通过优选基金积极把握基金市场的投资机会，力求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金采取积极的资产配置策略，通过宏观策略研究，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，精选基金品种，构建有超额收益能力的基金组合。同时通过有效地风险管理，降低业绩的波动性，获得稳定而持续的投资收益。</p> <p>2、基金投资策略</p> <p>(1) 开放式基金投资策略</p> <p>本基金以权益类基金为重点投资方向，在开放式基金的投资选择上，更倾向于挑选中长期主动管理能力得到验证的优质基金产品进行配置。在具体选择维度上分为基金公司、基金经理、基金产品三个方向，进行定量和定性的合</p>

	<p>理分析，筛选出超额收益稳定的基金产品进入组合配置。</p> <p>(2) 场内ETF等基金投资策略</p> <p>场内ETF等基金评价中更多考虑业绩持续性和市场因素的影响。通过对基金规模、流动性、跟踪误差、交易成本，以及ETF所跟踪指数的综合评价挑选适合的ETF投资标的，再根据市场波动因素的变化在适当时机完成基金的买入或卖出操作。</p> <p>其他投资策略还包括股票的投资策略、债券的投资策略、资产支持证券等品种投资策略和公募REITs投资策略等。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率*75%+中债综合(全价)指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	方圆
	联系电话	021-38676022	95559
	电子邮箱	zgxxpl@gtht.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		95521	95559
传真		021-38871190	021-62701216
注册地址		上海市黄浦区中山南路888号8层	中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		上海市黄浦区中山南路888号B栋2-6层及8层	中国(上海)长宁区仙霞路18号
邮政编码		200011	200336
法定代表人		陶耿	任德奇

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 50 楼
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	
	国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) A	国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) C	国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) A	国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) C	国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) A	国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) C
本期已实现收益	165,372,854.43	57,415,703.82	81,640,538.73	31,366,782.40	123,831,513.55	46,177,843.41
本期利润	159,715,357.57	56,435,400.63	20,645,098.33	6,400,531.01	120,132,280.96	43,861,774.32
加权平均基金份额本期利润	0.2636	0.2550	0.0282	0.0234	-0.1336	-0.1356
本期加权平均净值利润率	20.81%	20.48%	2.61%	2.20%	-10.83%	-11.10%
本期基金份额净值增长率	22.85%	22.36%	3.21%	2.80%	-11.34%	-11.70%
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	219,900,326.98	96,256,007.42	99,608,065.36	31,870,940.39	90,111,552.54	29,587,863.30
期末可供分配基金份额利润	0.4125	0.3846	0.1498	0.1316	0.1140	0.1008
期末基金资产净值	753,052,224.29	346,526,036.27	764,716,448.23	274,038,139.37	880,617,171.78	323,118,296.66
期末基金份额净值	1.4125	1.3846	1.1498	1.1316	1.1140	1.1008
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	1.01%	-9.67%	-17.78%	-26.17%	-20.34%	-28.18%
-------------	-------	--------	---------	---------	---------	---------

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

##### 国泰海通君得益三个月持有混合(FOF)A净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.97%	1.05%	-0.11%	0.71%	-3.86%	0.34%
过去六个月	16.51%	1.01%	12.65%	0.68%	3.86%	0.33%
过去一年	22.85%	1.05%	12.78%	0.71%	10.07%	0.34%
过去三年	12.42%	0.99%	16.84%	0.80%	-4.42%	0.19%
过去五年	-4.59%	1.02%	-1.12%	0.88%	-3.47%	0.14%
自基金合同生效起至今	1.01%	1.01%	5.99%	0.88%	-4.98%	0.13%

##### 国泰海通君得益三个月持有混合(FOF)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	-4.07%	1.05%	-0.11%	0.71%	-3.96%	0.34%
过去六个月	16.27%	1.01%	12.65%	0.68%	3.62%	0.33%
过去一年	22.36%	1.05%	12.78%	0.71%	9.58%	0.34%
过去三年	11.07%	0.99%	16.84%	0.80%	-5.77%	0.19%
自基金合同生效起至今	-9.67%	1.02%	-4.25%	0.88%	-5.42%	0.14%

#### 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

国泰海通君得益三个月持有混合(FOF)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  
(2020年11月16日-2025年12月31日)

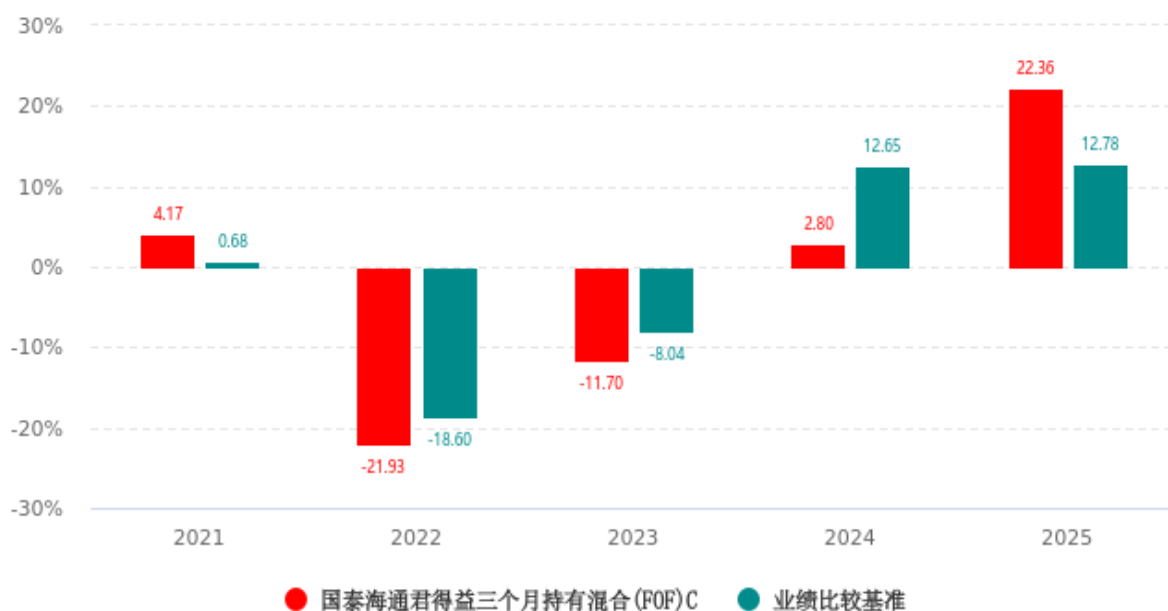
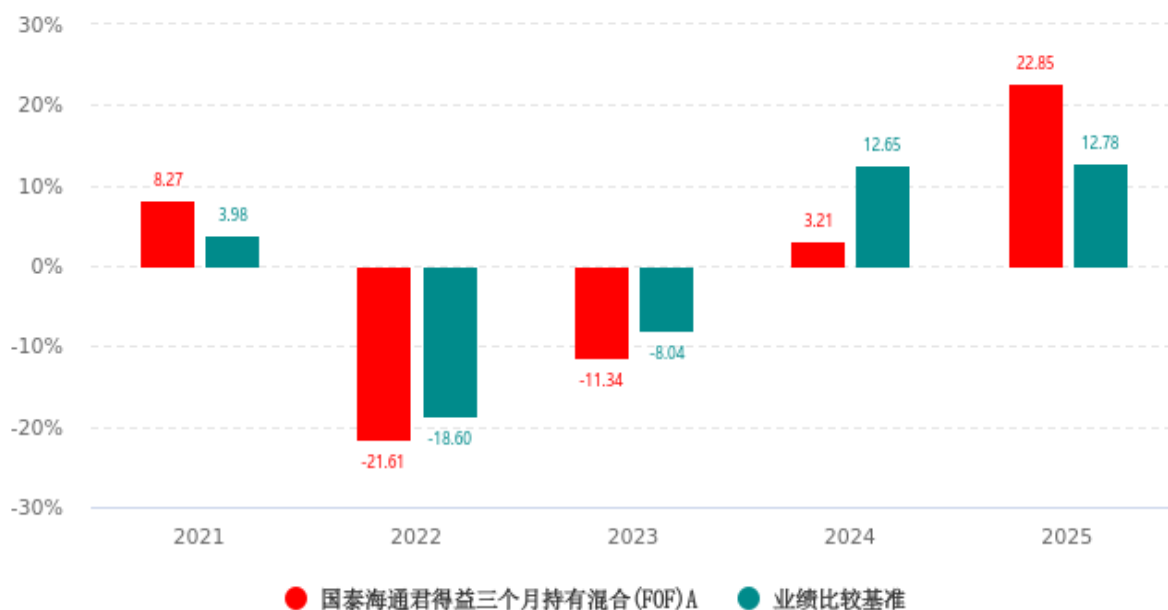


国泰海通君得益三个月持有混合(FOF)C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年01月12日-2025年12月31日)



注：本基金于2020年11月16日参公生效，C类份额于2021年1月12日首次申购确认，C类份额当期的相关数据和指标按实际存续期（即2021年1月12日至2025年12月31日）计算。

### 3.2.3 过去五年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2020年11月16日，C类份额于2021年1月12日首次申购确认，C类份额首次申购确认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、国泰海通君得益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、国泰海通君得益混合型证券投资基金、国泰海通东久新经济产业园封闭基础设施证券投资基金、国泰海通君得益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		
高琛	国泰海通善融稳健一年持有混合 (FOF) 基金经理，国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) 基金经理，国泰海通善怡稳健六个月持有债券发起 (FOF) 基金经理。现任基金投资部（公募）基金经理。	2022-03-21	-	15 年	高琛，华东理工大学工商管理硕士。曾任上海证券基金评价分析师、金融实验室负责人，国泰君安资产管理业务委员会执行办董事。2019 年 4 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，现担任基金投资部（公募）基金经理。
郭圳滨	国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) 基金经理，国泰海通善融稳健一年持有混合 (FOF) 基金经理，国泰海通善怡稳健六个月持有债券发起 (FOF) 基金经理。现任基金投资部（公募）基金经理。	2025-06-17	-	7 年	郭圳滨，中山大学概率论与数理统计专业，硕士研究生，历任广发证券股份有限公司发展研究中心金融工程分析师，申万宏源证券有限公司财富管理部资产配置经理。2022 年 11 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任基金投资部研究员，现任基金投资部（公募）基金经理。

注：1、上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基

金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的次数为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，A股市场在全球主要市场中表现亮眼，走出了一轮由科技成长与上游资源双轮驱动的结构牛市。市场在政策利好、经济复苏预期及流动性充裕的背景下全面上行，主要宽基指数年度

涨幅均超过 10%，市场活力与韧性显著增强。行业层面，科技和有色行业构成全年双主线。科技赛道以 AI 为核心的产业浪潮贯穿全年，从 DeepSeek 模型发布到“人工智能+”行动纲领出台，从算力基础设施到下游应用，AI 产业链的蓬勃发展在资本市场得到了充分映射，光模块等细分领域涨幅居前。有色金属行业则在美联储降息周期开启下的金融属性提振，以及国内“反内卷”政策优化行业竞争格局等多重因素下走出趋势性行情。

债券市场方面，在宽货币预期提前透支的背景下，债市交易空间受限，投资者体验感普遍不佳。10 年期国债收益率从年初的 1.60% 附近震荡上行，年末收于 1.85% 左右，全年上行幅度约 25 个基点。收益率曲线呈现陡峭化变动，短端利率因资金面整体宽松而相对稳健，DR007 中枢维持在 1.5% 附近；但中长端利率上行更为明显，30 年期国债收益率上行幅度达 36 个基点，这导致以国债指数为代表的利率债资产年度收益率为负。

君得益：组合 80% 资产投资于偏权益类基金。组合运作上，上半年引入子策略资产单元进行组合配置，丰富业绩收益来源的多元化，四季度组合管理模式进行了重新的调整，去除了子单元模式，采取底层基金配置、主动中观配置及交易型配置等子部分进行运作，在管理模式切换过程中，调整动作对组合表现产生了一定影响。在仓位上，2025 年市场震荡向上，组合整体维持偏高仓位运作。结构上，组合始终以均衡型基金作为底仓（量化基金、主动基金等），在持仓风格上向成长风格相对倾斜。行业上，组合仍相对重视科技、顺周期、港股等资产的投资机会，并相应在该方向进行一定比例的超配。

#### 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益三个月持有混合(FOF)A 基金份额净值为 1.4125 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 22.85%，同期业绩比较基准收益率为 12.78%；截至报告期末国泰海通君得益三个月持有混合(FOF)C 基金份额净值为 1.3846 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 22.36%，同期业绩比较基准收益率为 12.78%。

#### 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，“长期慢牛”叙事可期，积极关注基本面改善带来的投资机会。低利率的市场环境下，权益资产的性价比较高，居民存款搬家有较大空间。结构上重视多条逻辑性重叠的板块：

（1）大宗商品类：把握供需错配带来的业绩增长机会，关注工业金属（铜）、黄金、化工等；（2）科技：海内外科技叙事持续共振，把握主线机会，关注算力、AI 应用、存储等；（3）新能源：反内卷推动行业反弹，重点关注储能子板块；（4）内需：重点关注政策扶持方向与行业基本面改善带来的投资线索，关注文旅旅游、新消息、必需消费品等；（5）红利：低利率环境下的配置机会，其中港股红利性价比更高；（6）港股：受益于美联储降息、人民币升值加速。

债券市场方面，总量层面仍处于弱复苏周期，预计财政维持扩张力度，货币政策延续支持性立场，工具上使用灵活。风险上关注市场对中长期通缩预期的逐步扭转，供给端“反内卷”政策或持续发力。从机构申赎行为看，纯债类基金赎回压力明显增加，而固收+类基金出现趋势性资金流

入，对应的是风险偏好抬升，中国资产价值重估。

#### 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约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人

独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### 4.8 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

本报告期内，基金托管人在国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，上海国泰海通证券资产管理有限公司在国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，由上海国泰君安证券资产管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### § 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	安永华明 (2026) 审字第 70074144_B04 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	国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 全体份额持有人
审计意见	<p>我们审计了国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。</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，我们独立于国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)，并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	<p>国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>

	治理层负责监督国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 的财务报告过程。
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。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，就可能导致对国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、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。我们与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	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	吕红艳   陈雯
会计师事务所的地址	上海市浦东新区世纪大道 100 号上海环球金融中心 50 楼
审计报告日期	2026-03-27

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)

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
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	68,881,214.45	75,413,277.93
结算备付金		850,053.94	36,531.73
存出保证金		194,270.82	43,426.72
交易性金融资产	7.4.7.2	996,473,012.06	968,580,075.76
其中：股票投资		-	-
基金投资		996,473,012.06	968,580,075.76
债券投资		-	-
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		37,672,016.88	-
应收股利		-	3,905.71
应收申购款		3,331.96	17,427.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.4	70,058.73	68,509.96
资产总计		1,104,143,958.84	1,044,163,155.27
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,637,468.09	3,864,057.65
应付管理人报酬		589,554.62	560,152.05
应付托管费		175,147.97	174,735.62
应付销售服务费		104,517.87	95,253.01
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	662,561.87
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.5	59,009.73	51,807.47
负债合计		4,565,698.28	5,408,567.67
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.6	783,421,926.16	907,275,581.85
未分配利润	7.4.7.7	316,156,334.40	131,479,005.75
净资产合计		1,099,578,260.56	1,038,754,587.60
负债和净资产总计		1,104,143,958.84	1,044,163,155.27

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 783,421,926.16 份。其中国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) A 基金份额净值 1.4125 元，基金份额总额 533,151,897.31 份；国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) C 基金份额净值 1.3846 元，基金份额总额 250,270,028.85 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)

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
<b>一、营业总收入</b>		226,271,025.33	37,295,666.70
1. 利息收入		292,059.49	527,119.79
其中：存款利息收入	7.4.7.8	286,500.31	514,318.49
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		5,559.18	12,801.30
2. 投资收益（损失以“-”填列）		231,867,912.84	-103,925,650.20
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益	7.4.7.9	229,738,560.79	-105,866,370.70
债券投资收益	7.4.7.10	-	48,796.63
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	7.4.7.11	2,129,352.05	1,891,923.87
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.12	-6,637,800.05	140,052,950.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	748,853.05	641,246.64
<b>减：二、营业总支出</b>		10,120,267.13	10,250,037.36
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,714,021.53	6,826,405.81
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,964,218.60	2,053,577.08
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,101,545.94	1,163,182.82
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		167,678.82	32,488.55
8. 其他费用	7.4.7.15	172,802.24	174,383.10
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		216,150,758.20	27,045,629.34
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		216,150,758.20	27,045,629.34
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		216,150,758.20	27,045,629.34

### 7.3 净资产变动表

会计主体：国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)

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	907,275,581.85	131,479,005.75	1,038,754,587.60
二、本期期初净资产	907,275,581.85	131,479,005.75	1,038,754,587.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-123,853,655.69	184,677,328.65	60,823,672.96
（一）、综合收益总额	-	216,150,758.20	216,150,758.20
（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）	-123,853,655.69	-31,473,429.55	-155,327,085.24

“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	66,256,445.42	24,171,577.47	90,428,022.89
2. 基金赎回款	-190,110,101.11	-55,645,007.02	-245,755,108.13
(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	783,421,926.16	316,156,334.40	1,099,578,260.56
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	1,084,036,052.60	119,699,415.84	1,203,735,468.44
二、本期期初净资产	1,084,036,052.60	119,699,415.84	1,203,735,468.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-176,760,470.75	11,779,589.91	-164,980,880.84
(一)、综合收益总额	-	27,045,629.34	27,045,629.34
(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）	-176,760,470.75	-15,266,039.43	-192,026,510.18
其中：1. 基金申购款	3,867,602.04	338,778.25	4,206,380.29
2. 基金赎回款	-180,628,072.79	-15,604,817.68	-196,232,890.47
(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	907,275,581.85	131,479,005.75	1,038,754,587.60

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

国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)（以下简称“本基金”或“基金”）由国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)变更而来。国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)由国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划变更而来。国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划由国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划变更而来。本基金为契约型开放式。

国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，于 2011 年 3 月 30 日经中国证监会证监许可〔2011〕466 号文核准设立，自 2011 年 4 月 25 日起开始募集并于 2011 年 5 月 31 日结束募集，于 2011 年 6 月 7 日成立。

根据《基金法》、《运作办法》、《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》等法律法规的规定，国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划变更为国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)，并相应修改《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划资产管理合同》等法律文件。2021 年 11 月 5 日，国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 经中国证监会《关于准予国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划变更注册的批复》（证监许可[2021]3519 号文）注册。

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，国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 变更为国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)，《国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》自基金管理人公告的生效之日起生效，原《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》同日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金、香港互认基金和公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”）、国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板以及其他依法发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及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：投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%，其中，股票、股票型基金、混合型基金（混合型基金仅包含以下两类：基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产 60% 的混合型基金；根据基金披露的定期报告，最近四个季度股票资产占基金资产比例均不低于 60% 的混合型基金）合计占基金资产的比例为 60%–95%，投资于货币市场基金的资产占基金资产的比例不高于 15%；本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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。

本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*75%+中债综合（全价）指数收益率\*25%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）

编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

###### （2）金融负债分类

本基金的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。

#### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调

整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。

损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

（4）处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（5）买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

（6）公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

（7）其他收入在本基金履行了合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

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

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

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

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

(4) 法律、法规或中国证监会另有规定的从其规定。

#### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

基金目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

##### 7.4.6.1 增值税

根据财政部和国家税务总局 2017 年 6 月 30 日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，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，通知自 2018 年 1 月 1 日起施行。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、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》，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，继续免征增值税直至债券到期。

#### 7.4.6.2 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%；根据财税 2023 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，对证券（股票）交易印花税实施减半征收。

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

#### 7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 7.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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。

#### 7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 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	68,881,214.45	75,413,277.93
等于：本金	68,873,217.17	75,402,759.91
加：应计利息	7,997.28	10,518.02
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	68,881,214.45	75,413,277.93

##### 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	-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	954,306,364.42	-	996,473,012.06	42,166,647.64
其他	-	-	-	-

合计	954,306,364.4 2	-	996,473,012.0 6	42,166,647.6 4
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	-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	919,249,900.5 9	-	968,580,075.7 6	49,330,175.1 7
其他	-	-	-	-
合计	919,249,900.5 9	-	968,580,075.7 6	49,330,175.1 7

#### 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

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
应收利息	-	-
其他应收款	70,058.73	68,509.96
待摊费用	-	-
合计	70,058.73	68,509.96

#### 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	201.83	3.25

应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	10,807.90	1,804.22
其中：交易所市场	10,807.90	1,804.22
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	48,000.00	50,000.00
合计	59,009.73	51,807.47

#### 7.4.7.6 实收基金

##### 国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) 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	665,108,382.87	665,108,382.87
本期申购	3,479,666.46	3,479,666.46
本期赎回 (以“-”号填列)	-135,436,152.02	-135,436,152.02
本期末	533,151,897.31	533,151,897.31

##### 国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) 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	242,167,198.98	242,167,198.98
本期申购	62,776,778.96	62,776,778.96
本期赎回 (以“-”号填列)	-54,673,949.09	-54,673,949.09
本期末	250,270,028.85	250,270,028.85

注：申购含转换转入、红利再投资份 (金) 额，赎回含份额转出份 (金) 额。

#### 7.4.7.7 未分配利润

##### 国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) 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	196,973,739.56	-97,365,674.20	99,608,065.36
本期期初	196,973,739.56	-97,365,674.20	99,608,065.36
本期利润	165,372,854.43	-5,657,496.86	159,715,357.57
本期基金份额交易产	-52,672,220.13	13,249,124.18	-39,423,095.95

生的变动数			
其中： 基金申购款	1,496,730.01	-318,384.61	1,178,345.40
基金赎回款	-54,168,950.14	13,567,508.79	-40,601,441.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	309,674,373.86	-89,774,046.88	219,900,326.98

国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) 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	41,611,229.64	-9,740,289.25	31,870,940.39
本期期初	41,611,229.64	-9,740,289.25	31,870,940.39
本期利润	57,415,703.82	-980,303.19	56,435,400.63
本期基金份额交易产生的变动数	12,667,412.99	-4,717,746.59	7,949,666.40
其中： 基金申购款	27,347,390.49	-4,354,158.42	22,993,232.07
基金赎回款	-14,679,977.50	-363,588.17	-15,043,565.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	111,694,346.45	-15,438,339.03	96,256,007.42

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	284,102.85	510,380.10

定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	2,085.23	3,272.99
其他	312.23	665.40
合计	286,500.31	514,318.49

#### 7.4.7.9 基金投资收益

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
卖出/赎回基金成交总额	3,451,068,395.28	1,211,394,118.28
减：卖出/赎回基金成本总额	3,217,593,214.27	1,316,526,861.53
减：买卖基金差价收入应缴纳 增值税额	1,397,323.50	270,737.97
减：交易费用	2,339,296.72	462,889.48
基金投资收益	229,738,560.79	-105,866,370.70

#### 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	-	18,194.63
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差 价收入	-	30,602.00
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	-	48,796.63

##### 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	-	24,074,360.00
减：卖出债券(债转股及债券	-	23,569,398.00

到期兑付) 成本总额		
减: 应计利息总额	-	474,360.00
减: 交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-	30,602.00

#### 7.4.7.11 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	-	-
其中: 证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	2,129,352.05	1,891,923.87
合计	2,129,352.05	1,891,923.87

#### 7.4.7.12 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	-7,163,527.53	140,578,677.95
——股票投资	-	-
——债券投资	-	-32,962.00
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-7,163,527.53	140,611,639.95
——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	-525,727.48	525,727.48
合计	-6,637,800.05	140,052,950.47

#### 7.4.7.13 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	10,594.08	1,400.66
销售服务费返还收入	738,258.97	639,845.98
合计	748,853.05	641,246.64

#### 7.4.7.14 持有基金产生的费用

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
当期持有基金产生的应支付销售服务费 (元)	2,801,299.79	2,104,131.85
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	9,426,137.42	9,929,871.36
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	1,594,080.46	1,702,353.25

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用。其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

#### 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	48,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	4,802.24	4,383.10
合计	172,802.24	174,383.10

#### 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于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
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	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

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股票交易。

###### 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

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债券交易。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.10.1.5 基金交易

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	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰海通证券	2,213,908,422.55	100.00%	532,645,480.09	100.00%

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	22,097.83	100.00%	10,807.90	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	5,326.87	100.00%	1,804.22	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	6,714,021.53	6,826,405.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,773,882.11	3,548,635.10
应支付基金管理人的净管理费	2,940,139.42	3,277,770.71

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提，但本基金投资于基金管理人所管理的其他基金的部分不收取管理费。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值中扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他基金部分（若为负数，则取 0）

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 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	1,964,218.60	2,053,577.08

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提，但本基金投资于基金托管人所托管的其他公开募集证券投资基金的部分不收取托管费。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值中扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他公开募集证券投资基金部分（若为负数，则取 0）

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 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		
	国泰海通君得益三个月 持有混合 (FOF) A	国泰海通君得益三个月 持有混合 (FOF) C	合计
国泰海通证券	-	958,093.55	958,093.55
国泰海通资管	-	19,453.02	19,453.02
交通银行	-	26,813.50	26,813.50
合计	-	1,004,360.07	1,004,360.07
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		
	国泰海通君得益三个月 持有混合 (FOF) A	国泰海通君得益三个月 持有混合 (FOF) C	合计
国泰海通证券	-	1,038,099.11	1,038,099.11
国泰海通资管	-	7,433.87	7,433.87

交通银行	-	27,216.74	27,216.74
合计	-	1,072,749.72	1,072,749.72

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

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

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

销售服务费每日计提，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 日
-------	-----------------------------	--------------------------

	12月31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
交通银行	68,881,214.45	284,102.85	75,413,277.93	510,380.10

注：本基金的银行存款由基金托管人交通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

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于2025年12月31日，本基金持有基金管理人国泰海通资管及其关联方华安基金、富国基金、海富通基金、银河基金所管理的公开募集证券投资基金合计284,402,499.51元，占本基金资产净值的比例为25.86%（2024年12月31日，本基金持有基金管理人国泰海通资管及其关联方华安基金所管理的公开募集证券投资基金合计333,903,926.91元，占本基金资产净值的比例为32.14%。）

##### 7.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

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
当期交易基金产生的申购费 (元)	-	-
当期交易基金产生的赎回费 (元)	20,635.66	26,671.13
当期持有基金产生的应支付销 售服务费(元)	888,693.71	636,039.35
当期持有基金产生的应支付管 理费(元)	2,508,640.26	3,199,451.76
当期持有基金产生的应支付托 管费(元)	392,620.06	507,261.88
当期交易基金产生的交易费 (元)	2,197.53	-
当期交易基金产生的转换费 (元)	62,523.10	-

#### 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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

###### 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交通银行股份有限公司，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。

于2025年12月31日,本基金未持有信用类债券(2024年12月31日:本基金未持有信用类债券)。

#### 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在基金最短持有期到期日起(含当日)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,本基金所承担的全部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,因此账面余额即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。

本基金持有单只基金的市值,不高于本基金资产净值的20%,且不持有其他基金中基金。本基金的基金管理人管理的全部基金中基金持有单只基金(ETF联接基金除外)不超过被投资基金净资产的20%,被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准。本基金投资于一家公司发行的证券(不含本基金所投资的基金份额)市值不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券(不含本基金所投资的基金份额)不得超过该证券的10%。

本基金所持部分证券在银行间或证券交易所交易,其余亦可在基金销售机构申购、赎回,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。在本基金开放日,本基金投资于流通受限基金不高于本基金资产净值的10%;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。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金、结算备付金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年12 月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	68,881,214.45	-	-	-	68,881,214.45
结算备付金	850,053.94	-	-	-	850,053.94
存出保证金	194,270.82	-	-	-	194,270.82
交易性金融资产	-	-	-	996,473,012.06	996,473,012.06
应收清算款	-	-	-	37,672,016.88	37,672,016.88
应收申购款	-	-	-	3,331.96	3,331.96
其他资产	-	-	-	70,058.73	70,058.73
资产总计	69,925,539.21	-	-	1,034,218,419.63	1,104,143,958.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,637,468.09	3,637,468.09

应付管理人报酬	-	-	-	589,554.62	589,554.62
应付托管费	-	-	-	175,147.97	175,147.97
应付销售服务费	-	-	-	104,517.87	104,517.87
其他负债	-	-	-	59,009.73	59,009.73
负债总计	-	-	-	4,565,698.28	4,565,698.28
利率敏感度缺口	69,925,539.21	-	-	1,029,652,721.35	1,099,578,260.56
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	75,413,277.93	-	-	-	75,413,277.93
结算备付金	36,531.73	-	-	-	36,531.73
存出保证金	43,426.72	-	-	-	43,426.72
交易性金融资产	-	-	-	968,580,075.76	968,580,075.76
应收股利	-	-	-	3,905.71	3,905.71
应收申购款	-	-	-	17,427.46	17,427.46
其他资产	-	-	-	68,509.96	68,509.96
资产总计	75,493,236.38	-	-	968,669,918.89	1,044,163,155.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,864,057.65	3,864,057.65
应付管理人报酬	-	-	-	560,152.05	560,152.05
应付托管费	-	-	-	174,735.62	174,735.62
应付销售服务费	-	-	-	95,253.01	95,253.01
应交税费	-	-	-	662,561.87	662,561.87
其他负债	-	-	-	51,807.47	51,807.47
负债总计	-	-	-	5,408,567.67	5,408,567.67
利率敏感度缺口	75,493,236.38	-	-	963,261,351.22	1,038,754,587.60

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

于2025年12月31日,本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例0.00%(2024年12月31日:0.00%),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2024年12月31日:同)。

#### 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。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额,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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	996,473,012.06	90.62	968,580,075.76	93.24
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	996,473,012.06	90.62	968,580,075.76	93.24

#### 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

			日
	业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	74,871,138.18	56,330,086.20
	业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	-74,871,138.18	-56,330,086.20

#### 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	996,473,012.06	968,580,075.76
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	996,473,012.06	968,580,075.76

###### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	996,473,012.06	90.25
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	69,731,268.39	6.32
8	其他各项资产	37,939,678.39	3.44
9	合计	1,104,143,958.84	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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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

本基金本报告期末未进行股票投资。

#### 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

本基金本报告期末未进行股票投资。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未进行股票投资。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

### 8.12 本报告期投资基金情况

#### 8.12.1 投资政策及风险说明

本基金为基金中基金，本基金按照所设定的目标风险，确定权益类资产和非权益类资产的配置比例，控制本基金的波动性，从而实现本基金的风险设定目标。本基金主要投资于开放式基金，总体风险中等，符合本基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

#### 8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金 资产净 值比例 (%)	是否 属于 基金 管理人及 管理人 关联方 所管理 的基金
1	018963	国泰海通量化选股混合发起D	契约型 开放式	56,001,774.2 6	81,919,395.3 9	7.45	是
2	023881	兴全商业模式混合(LOF)C	契约型 开放式	14,478,836.0 3	67,485,854.7 4	6.14	否
3	011117	富国沪港深业绩驱动混合型C	契约型 开放式	26,249,383.8 2	60,814,572.4 3	5.53	是
4	014156	国泰海通中证500指数增强C	契约型 开放式	47,097,258.2 5	60,341,007.2 7	5.49	是
5	017535	东方红京东大数据混合C	契约型 开放式	15,051,017.6 1	54,409,428.6 6	4.95	否

6	159636	港股通科技 30ETF 工银	契约型 开放式	71,800,000.0 0	46,741,800.0 0	4.25	否
7	512400	南方中证申 万有色金属 ETF	契约型 开放式	20,000,000.0 0	38,540,000.0 0	3.50	否
8	008892	安信价值成 长混合 C	契约型 开放式	18,871,097.0 4	38,466,844.2 1	3.50	否
9	018326	国泰海通创 新成长混合 发起 C	契约型 开放式	26,573,665.1 2	38,053,488.4 5	3.46	是
10	004237	中欧新蓝筹 混合 C	契约型 开放式	13,302,287.3 7	37,330,209.0 5	3.39	否
11	004497	前海开源多 元策略混合 C	契约型 开放式	11,546,374.9 5	33,222,384.6 4	3.02	否
12	159691	港股红利 ETF 工银	契约型 开放式	25,000,000.0 0	32,175,000.0 0	2.93	否
13	013722	信澳景气优 选混合 C	契约型 开放式	18,206,399.7 2	31,646,363.9 9	2.88	否
14	020315	嘉实前沿科 技沪港深股 票 C	契约型 开放式	12,769,254.2 6	28,969,607.1 4	2.63	否
15	010811	湘财久盈中 短债 C	契约型 开放式	25,607,642.1 7	26,998,137.1 4	2.46	否
16	017874	国金量化多 策略 C	契约型 开放式	17,943,857.6 1	25,173,437.8 4	2.29	否
17	020137	平安医疗健 康混合 C	契约型 开放式	10,157,311.7 6	22,892,549.2 4	2.08	否
18	008950	平安匠心优 选混合 C	契约型 开放式	15,889,467.0 9	22,609,122.7 2	2.06	否
19	588000	华夏上证科 创板 50 成份 ETF	契约型 开放式	12,500,000.0 0	17,712,500.0 0	1.61	否
20	007045	博道沪深 300 增强 C	契约型 开放式	10,184,034.4 6	17,703,925.5 1	1.61	否
21	014521	诺安利鑫灵 活配置混合 C	契约型 开放式	7,357,920.44	16,953,384.4 9	1.54	否
22	017936	国泰海通远 见价值混合 发起 C	契约型 开放式	11,840,680.4 4	16,679,966.5 4	1.52	是
23	159655	华夏标普 500ETF(QDII )	契约型 开放式	8,283,027.00	15,033,694.0 1	1.37	否
24	159869	华夏中证动 漫游戏 ETF	契约型 开放式	10,100,000.0 0	14,544,000.0 0	1.32	否

25	004815	中欧红利优享灵活配置混合 C	契约型 开放式	6,567,389.77	14,353,030.34	1.31	否
26	015881	中欧小盘成长混合 C	契约型 开放式	8,204,441.25	13,614,449.81	1.24	否
27	005225	广发量化多因子混合 A	契约型 开放式	5,488,913.14	12,865,463.51	1.17	否
28	010388	易方达医药生物股票 C	契约型 开放式	16,265,493.05	12,750,520.00	1.16	否
29	020199	万家双引擎灵活配置混合 C	契约型 开放式	3,981,798.46	12,726,226.06	1.16	否
30	159937	博时黄金 ETF	契约型 开放式	1,200,000.00	11,128,800.00	1.01	否
31	014320	德邦半导体产业混合发起式 C	契约型 开放式	5,678,046.91	10,881,976.90	0.99	否
32	021987	国泰海通创新医药混合发起 C	契约型 开放式	10,164,823.59	9,037,544.65	0.82	是
33	019458	平安先进制造主题股票发起 C	契约型 开放式	4,329,620.54	8,163,066.57	0.74	否
34	517520	黄金股 ETF	契约型 开放式	4,000,000.00	8,160,000.00	0.74	否
35	010421	海富通消费优选混合 A	契约型 开放式	5,359,885.92	7,747,715.10	0.70	是
36	513180	华夏恒生科技 ETF (QDII)	契约型 开放式	10,000,000.00	7,320,000.00	0.67	否
37	010422	海富通消费优选混合 C	契约型 开放式	4,843,545.95	6,838,602.53	0.62	是
38	017484	财通资管数字经济混合发起式 C	契约型 开放式	3,539,422.12	6,368,836.16	0.58	否
39	004814	中欧红利优享灵活配置混合 A	契约型 开放式	2,209,164.04	5,129,899.82	0.47	否
40	022467	国泰海通中证 A500 指数增强 A	契约型 开放式	2,327,566.14	2,970,207.15	0.27	是

### 8.13 投资组合报告附注

#### 8.13.1 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南方基金管理股份有限公司，2025 年 3 月因未依法履行职责被证监会分局警示，2025 年 11 月因违规被国家外汇管理局地方分局警告、罚款。

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。

#### 8.13.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.13.3 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	194,270.82
2	应收清算款	37,672,016.88
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,331.96
6	其他应收款	70,058.73
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,939,678.39

#### 8.13.4 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。

#### 8.13.5 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
国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) A	10,773	49,489.64	7,258,905.98	1.36%	525,892,991.33	98.64%
国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) C	6,126	40,853.74	60,967,109.29	24.36%	189,302,919.56	75.64%
合计	16,899	46,359.07	68,226,015.27	8.71%	715,195,910.89	91.29%

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	国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) A	69,291.64	0.0130%
	国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) C	1,312,649.71	0.5245%
	合计	1,381,941.35	0.1764%

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) A	0~10
	国泰海通君得益	50~100

	三个月持有混合 (FOF) C	
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) A	0~10
	国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) C	10~50
	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

	国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) A	国泰海通君得益三个月持有混合 (FOF) C
基金合同生效日（2020 年 11 月 16 日）基金份额总额	30,436,055.24	-
本报告期期初基金份额总额	665,108,382.87	242,167,198.98
本报告期基金总申购份额	3,479,666.46	62,776,778.96
减：本报告期基金总赎回份额	135,436,152.02	54,673,949.09
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	533,151,897.31	250,270,028.85

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的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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，本基金投资策略无改变。

### 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金持有的大成高新技术产业股票型证券投资基金召开基金份额持有人大会，于2025年1月10日表决通过了《关于大成高新技术产业股票型证券投资基金修改基金合同等相关事项的议案》。

### 11.6 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48,000.00元，目前事务所已提供审计服务的连续年限为自合同生效日至今。

### 11.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 11.7.1 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。

#### 11.7.2 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。

### 11.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

### 11.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

## 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.8.1 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

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰海通证券股份有限公司	2	-	-	22,097.83	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。

### 11.8.2 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	-	-	-	-	-	-	2,213,908,422.55	100.00%

### 11.9 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	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 2024 年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-01-22
2	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
3	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) (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	2025-03-20
4	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) (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	2025-03-20
5	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 招募说明书 (更新) (2025 年第 1 号)	证监会指定网站、公司官网	2025-03-20
6	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
7	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
8	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 2024 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-03-31
9	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 2025 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-04-22
10	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
11	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
12	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
13	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

14	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金经理变更公告	上海证券报、证监会指定网站、公司官网	2025-06-17
15	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) (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	2025-06-17
16	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) (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	2025-06-17
17	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 招募说明书 (更新) (2025 年第 2 号)	证监会指定网站、公司官网	2025-06-17
18	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 2025 年第 2 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-07-21
19	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
20	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
21	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
22	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) (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
23	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) (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
24	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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
25	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
26	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
27	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年中期报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2025-08-29

28	国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 2025 年中期报告	证监会指定网站、公司官网	2025-08-29
29	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
30	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
31	国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) (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
32	国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) (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
33	国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 招募说明书 (更新) (2025 年第 4 号)	证监会指定网站、公司官网	2025-09-29
34	国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同	证监会指定网站、公司官网	2025-09-29
35	国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 托管协议	证监会指定网站、公司官网	2025-09-29
36	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、证监会指定网站、公司官网、上交所	2025-10-14
37	国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 2025 年第 3 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2025-10-28
38	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
39	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
40	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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## 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益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划变更注册的批复；

- 2、《国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》；
- 3、《国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 托管协议》；
- 4、《国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 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