国泰海通君得盈债券型证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 09 月 30 日

基金管理人:上海国泰海通证券资产管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 10 月 27 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年07月01日起至2026年09月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	6,258,862,162.52 份
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	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。 1、资产配置策略 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。 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。 2、固定收益品种投资策略 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。

	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。		
业绩比较基准	中债-综合财富(总值)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%		
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。		
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		
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	3,522,802,750.00 份	140,285,893.75 份	2,595,773,518.77 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。

自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“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%”变更为“中债-综合财富(总值)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%”。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日）		
	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
1.本期已实现收益	-39,435,191.28	-2,398,605.46	-31,653,091.84
2.本期利润	-162,245,106.48	-13,691,890.53	-82,256,572.45
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0538	-0.0770	-0.0374
4.期末基金资产净值	3,729,465,198.81	147,539,602.32	2,847,556,536.08
5.期末基金份额净值	1.0587	1.0517	1.0970

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。

3.2 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	净值增长率①	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	-5.83%	0.62%	-0.79%	0.15%	-5.04%	0.47%
过去六个月	1.66%	0.61%	1.28%	0.14%	0.38%	0.47%
过去一年	4.61%	0.55%	2.02%	0.12%	2.59%	0.43%
过去三年	9.68%	0.36%	12.06%	0.11%	-2.38%	0.25%
过去五年	6.38%	0.32%	16.07%	0.11%	-9.69%	0.21%
自基金合同生效起至今	10.15%	0.30%	17.75%	0.11%	-7.60%	0.19%

注：自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“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%”变更为“中债-综合财富(总值)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%”。

国泰海通君得盈债券 C 净值表现

阶段	净值增长率①	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	-5.93%	0.62%	-0.79%	0.15%	-5.14%	0.47%
过去六个月	1.47%	0.61%	1.28%	0.14%	0.19%	0.47%
过去一年	4.19%	0.55%	2.02%	0.12%	2.17%	0.43%
过去三年	8.36%	0.36%	12.06%	0.11%	-3.70%	0.25%
过去五年	4.26%	0.32%	16.07%	0.11%	-11.81%	0.21%
自基金合同生效起至今	7.77%	0.31%	18.55%	0.11%	-10.78%	0.20%

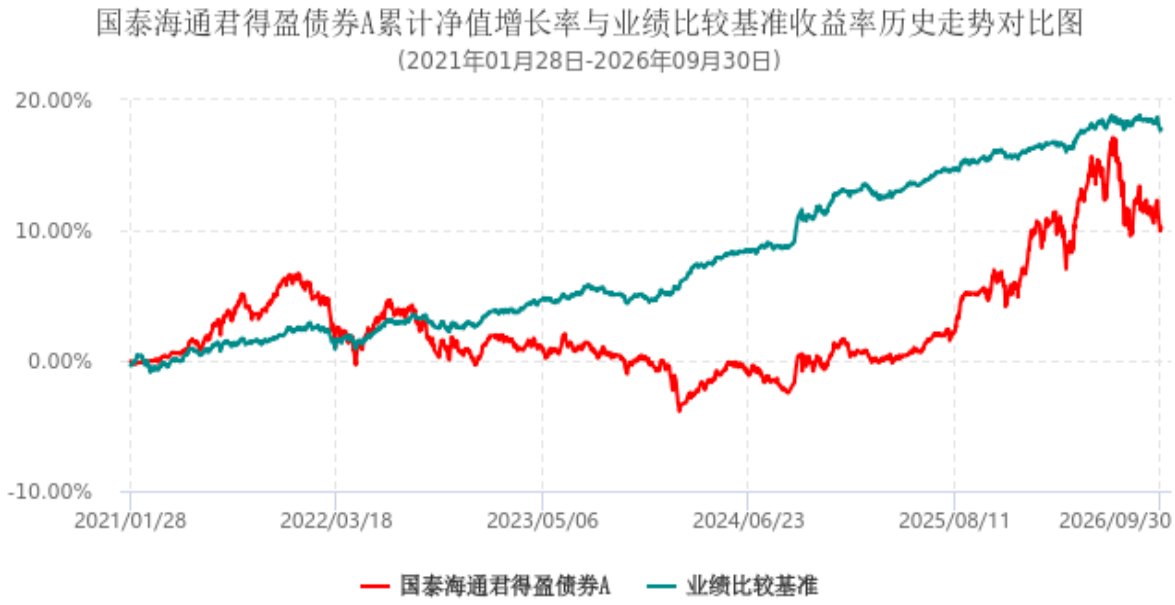
注：国泰海通君得盈债券 C 类份额首次确认日为 2021 年 3 月 9 日。自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“中债综合财富指数收益率×70%+一年定期存款税后利率×20%+沪深 300 指数收益率×10%”变更为“中债-综合财富(总值)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%”。

国泰海通君得盈债券 D 净值表现

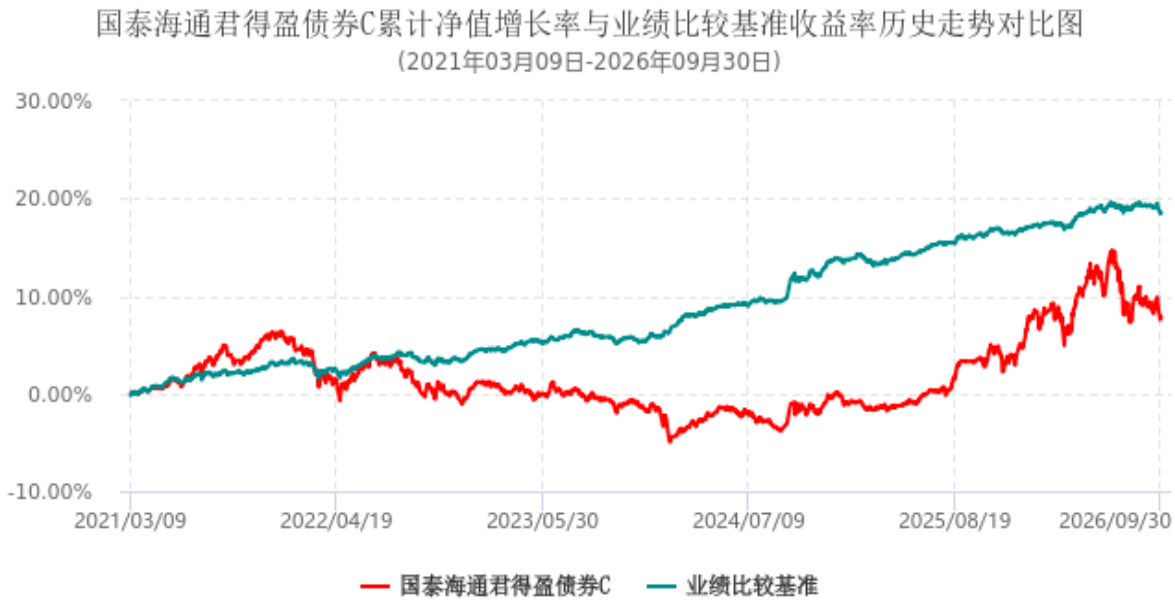
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.86%	0.62%	-0.79%	0.15%	-5.07%	0.47%
过去六个月	1.62%	0.61%	1.28%	0.14%	0.34%	0.47%
过去一年	4.57%	0.55%	2.02%	0.12%	2.55%	0.43%
自基金合同生效起至今	9.19%	0.43%	4.28%	0.11%	4.91%	0.32%

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。自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“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%”变更为“中债-综合财富(总值)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%”。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

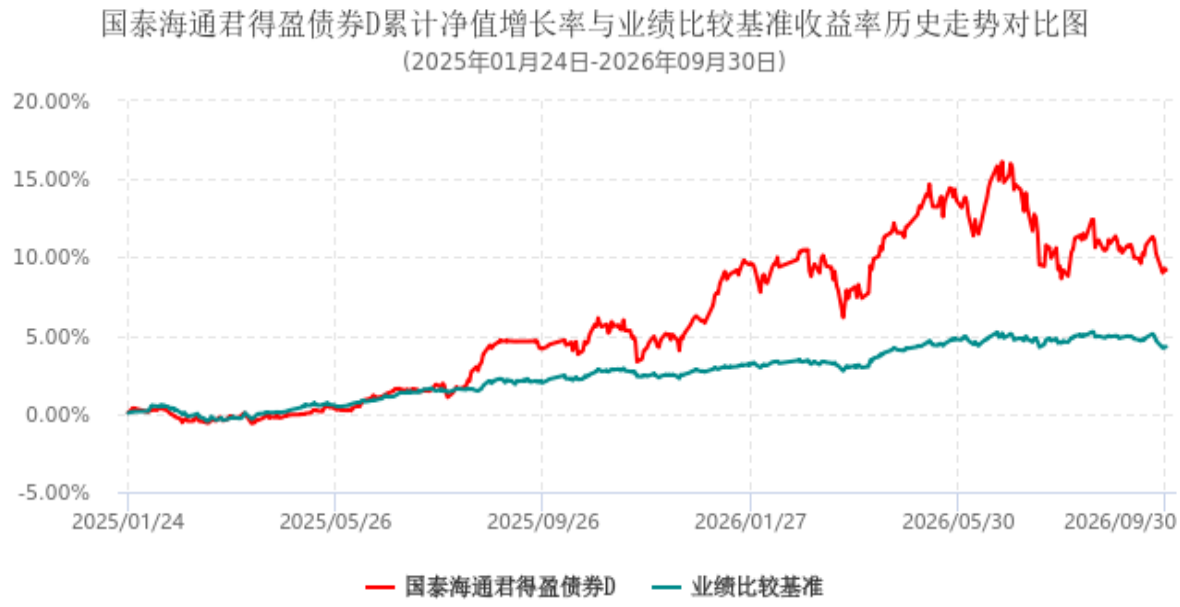


注：自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“中债综合财富指数收益率×70%+一年定期存款税后利率×20%+沪深 300 指数收益率×10%”变更为“中债-综合财富(总值)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%”。



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。自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“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%”变更为“中债-综合财富(总值)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%”。



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。自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“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%”变更为“中债-综合财富(总值)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%”。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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，国泰海通科创板量化选股股票发起基金经理。现任	2025-09-09	-	5 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

	量化投资部（公募）基金经理。				理，主要从事领域 Alpha 因子和模型的研究工作。
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，国泰海通稳瑞回报债券基金经理。现任多资产策略投资部（公募组）基金经理。	2025-09-09	-	6 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。

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所有的投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的次数为 0 次。本基金与本公司管理的其他组合在不同时间窗下(如日内、3 日内、5 日内)同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，中国经济延续“外需强于内需”的分化格局，景气度呈“低位企稳、末月回升”态势。制造业 PMI 在 7 月回落至 49.2%后连续两个月回升，9 月升至 50.1%重回扩张区间；出口是最主要亮点，三季度增速维持高位 9 月单月出口同比增长 36.3%，集成电路、汽车等高技术产品出口高增。内需仍然偏弱，8 月社零同比仅增 0.4%，1-8 月固定资产投资同比下降 7.2%。价格方面，受国际油价和有色金属价格上行传导影响，PPI 同比涨幅由 7 月的 3.5%扩大至 9 月的 5.0%，CPI 同比温和回升至 0.9%，核心 CPI 上涨 1.0%，工业品涨价向终端消费传导有限。政策端，货币政策维持“适度宽松”但总量工具按兵不动，央行主要通过 MLF 超量续作、买断式逆回购和隔夜逆回购常态化呵护流动性；财政政策三季度有所提速，8000 亿元新型政策性金融工具自 9 月初投放，超长期特别国债与专项债发行加快。权益市场方面，三季度 A 股震荡调整，市场风格和月度节奏明显分化。7 月，科技成长板块受交易拥挤、资金降温及海外扰动影响回落，前期调整较多的红利资产明显修复；8 月，海外科技企业财报及算力需求预期改善，带动电子、通信等科技方向反弹，但市场成交热度有所回落；9 月，海外高利率、美债收益率上行及节前避险情绪压制风险偏好，A 股在阶段性修复后再度调整，8 月反弹未能扭转季度跌势。三季度债券市场收益率整体震荡下行，资金面均衡偏松，资

产荒格局下信用利差多数收窄，中长端高等级品种表现占优。海外美联储 9 月重启加息、10 年期美债收益率一度冲高至 5%以上，但国内债市走势相对独立。

报告期内，本基金在权益投资方面坚持采用量化投资策略，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，辅助以特征鲜明的红利增强+双创增强“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，力求获取长期可持续的超额收益。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。报告期内，本基金在债券投资方面以银行二级资本债配置为主，组合久期中性。

4.5 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 1.0587 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.83%，同期业绩比较基准收益率为-0.79%；截至报告期末国泰海通君得盈债券 C 基金份额净值为 1.0517 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.93%，同期业绩比较基准收益率为-0.79%；截至报告期末国泰海通君得盈债券 D 基金份额净值为 1.0970 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.86%，同期业绩比较基准收益率为-0.79%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,759,419,097.18	31.85
	其中：股票	2,759,419,097.18	31.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,537,112,306.10	63.91
	其中：债券	5,537,112,306.10	63.91
	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	305,535,399.72	3.53
8	其他资产	61,852,361.94	0.71
9	合计	8,663,919,164.94	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	15,348,635.00	0.23
B	采矿业	151,795,867.00	2.26
C	制造业	1,735,194,990.53	25.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	90,807,080.33	1.35
E	建筑业	26,870,409.00	0.40
F	批发和零售业	43,571,078.66	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	111,970,944.50	1.67
H	住宿和餐饮业	6,232,389.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	147,269,635.27	2.19
J	金融业	307,782,582.88	4.58
K	房地产业	7,966,864.84	0.12
L	租赁和商务服务业	9,590,581.22	0.14
M	科学研究和技术服务业	75,200,280.95	1.12
N	水利、环境和公共设施管理业	7,314,547.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	342,220.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	21,394,023.00	0.32
S	综合	766,968.00	0.01
	合计	2,759,419,097.18	41.03

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300308	中际旭创	102,100	82,541,724.00	1.23
2	300750	宁德时代	271,400	79,007,254.00	1.17
3	600036	招商银行	1,232,600	50,857,076.00	0.76
4	300502	新易盛	121,545	47,281,005.00	0.70
5	601318	中国平安	743,800	39,637,102.00	0.59
6	600519	贵州茅台	27,952	35,180,946.24	0.52
7	601398	工商银行	3,977,000	32,929,560.00	0.49
8	000333	美的集团	401,400	32,152,140.00	0.48
9	603259	药明康德	178,100	29,803,254.00	0.44
10	300408	三环集团	238,100	27,936,273.00	0.42

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	66,108,566.52	0.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,471,003,739.58	81.36
	其中：政策性金融债	768,223,423.67	11.42
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	5,537,112,306.10	82.34

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	260206	26 国开 06	3,500,000	351,067,068.49	5.22
2	232680004	26 交行二级资本债 01BC	3,000,000	305,093,687.67	4.54
3	232680003	26 中行二级资本债 01BC	2,950,000	300,114,718.08	4.46
4	232580009	25 中信银行二级资本债 01BC	2,500,000	254,647,054.79	3.79
5	232680012	26 邮储银行二级资本债 01BC	2,500,000	253,028,301.37	3.76

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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广发银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 10 月至 2026 年 9 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、证监会分局罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体国家开发银行，及其分支行 2025 年 10 月至 2026 年 9 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警告、罚款等。

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 10 月至 2026 年 9 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行及分支行、国家外汇管理局地方分局罚款、警告等。

本基金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 10 月至 2026 年 9 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罚款、警告等。

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 10 月至 2026 年 9 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、地方财政局罚款、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体招商银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 10 月至 2026 年 9 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、地方财政局罚款、警告等。

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 10 月至 2026 年 9 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、地方财政局罚款、警告等。

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 10 月至 2026 年 9 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、警告等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国邮政储蓄银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 10 月至 2026 年 9 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、证监会分局、中国银行间市场交易商协会罚款、警告等。

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 10 月至 2026 年 9 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局地方分局罚款、警告等。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	540,549.04
2	应收证券清算款	36,128,679.66
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	25,183,133.24
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	61,852,361.94

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§6 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
报告期期初基金份额总额	2,123,725,391.74	304,848,120.73	632,305,800.32
报告期期间基金总申购份额	1,635,030,814.11	25,926,048.06	4,749,258,896.61
减：报告期期间基金总赎回份额	235,953,455.85	190,488,275.04	2,785,791,178.16
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	3,522,802,750.00	140,285,893.75	2,595,773,518.77

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人持有本基金份额未发生变化。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20260701 - 20260930	1,896,452,683.48	-	-	1,896,452,683.48	30.30%
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》的约定决定部分延期赎回,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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 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。

9.3 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

二〇二六年十月二十七日