

国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:上海国泰海通证券资产管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14

§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	58

§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	61
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	62
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	64
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金	
基金简称	国泰海通稳债增利债券发起	
基金主代码	020175	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 02 月 06 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	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	160,400,717.83 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰海通稳债增利债券发起 A	国泰海通稳债增利债券发起 C
下属分级基金的交易代码	020175	020176
报告期末下属分级基金的份 额总额	105,432,863.42 份	54,967,854.41 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。国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金由国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金变更而来。国泰海通稳债增利债券型发起式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	本基金在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金将采取自上而下的投资策略对各种投资工具进行合理的配置。在风险与收益的匹配方面，力求降低信用风险，并在良好控制利率风险与市场风险的基础上力争为投资者获取稳定的收益。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率×87%+中证 800 指数收益率×5%+中证转债指数收益率×3%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上海国泰海通证券资产管理有限公司	招商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	吕巍	张姗
	联系电话	95521	400-61-95555
	电子邮箱	zgxxpl@gtht.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95521	400-61-95555
传真		021-38871190	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 8 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200011	518040
法定代表人		陶耿	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.gthtzg.com
基金中期报告置备地点	上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上海国泰海通证券资产管理有限公司	上海市黄浦区中山南路 888 号 B 栋 2-6 层及 8 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	国泰海通稳债增利债券发起 A	国泰海通稳债增利债券发起 C
本期已实现收益	2,355,149.80	1,191,198.46
本期利润	3,154,426.14	1,497,196.16
加权平均基金份额本期利润	0.0292	0.0250
本期加权平均净值利润率	2.72%	2.35%
本期基金份额净值增长率	2.80%	2.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	9,378,791.69	4,324,390.27
期末可供分配基金份额利润	0.0890	0.0787
期末基金资产净值	114,811,655.11	59,292,244.68

期末基金份额净值	1.0890	1.0787
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	8.90%	7.87%

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

国泰海通稳债增利债券发起 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	2.34%	0.15%	1.33%	0.10%	1.01%	0.05%
过去六个月	2.80%	0.15%	1.46%	0.09%	1.34%	0.06%
过去一年	4.10%	0.12%	1.63%	0.09%	2.47%	0.03%
自基金合同生 效起至今	8.90%	0.10%	10.03%	0.16%	-1.13%	-0.06%

国泰海通稳债增利债券发起 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	2.24%	0.15%	1.33%	0.10%	0.91%	0.05%
过去六个月	2.60%	0.15%	1.46%	0.09%	1.14%	0.06%
过去一年	3.69%	0.12%	1.63%	0.09%	2.06%	0.03%
自基金合同生 效起至今	7.87%	0.10%	10.03%	0.16%	-2.16%	-0.06%

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

国泰海通稳债增利债券发起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
(2024年02月06日-2026年06月30日)



国泰海通稳债增利债券发起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
(2024年02月06日-2026年06月30日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海国泰海通证券资产管理有限公司正式成立于 2010 年 10 月 18 日，经中国证监会证监许可【2010】631 号文批准，是业内首批券商系资产管理公司。公司注册资本金 20 亿元，注册地上海。

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理国泰海通现金管家货币市场基金、国泰海通 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰海通君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、国泰海通中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、国泰海通中证 500 指数增强型证券投资基金、国泰海通量化选股混合型发起式证券投资基金、国泰海通君得明混合型证券投资基金、国泰海通东久新经济产业园封闭式基础设施证券投资基金、国泰海通君得利短债债券型证券投资基金、国泰海通君得益三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、国泰海通 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰海通安弘六个月定期开放债券型证券投资基金、国泰海通中证 1000 指数增强型证券投资基金等 80 只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
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。	2024-02-06	-	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。
邓雅琨	国泰海通中证 500 指数增强基金经理，国泰海通中证香港科技指数发起（QDII）基金经理，国泰海通中证港股通高股息投资指数发起（QDII）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	2026-02-04	-	5 年	邓雅琨，卡耐基梅隆大学计算金融专业，硕士研究生。2021 年 3 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。

	证全指指数增强基金经理，国泰海通稳债增利债券发起基金经理，国泰海通君得盛债券基金经理，国泰海通港股优势精选股票发起（QDII）基金经理，国泰海通中证港股通科技指数发起基金经理。现任量化投资部（公募）基金经理。				
周予希	国泰海通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金经理助理，国泰海通 90 天滚动持有中短债发起基金经理助理，国泰海通 1 年定开债券发起式基金经理助理，国泰海通 30 天滚动持有中短债基金经理助理，国泰海通君得利短债基金经理助理，国泰海通现金管家货币基金经理助理，国泰海通 120 天持有债券发起基金经理助理，国泰海通安平一年定开债券发起基金经理助理，国泰海通稳债增利债券发起基金经理助理，国泰海通安弘六个月定开债券基金经理助理。现任固定收益投资部（公募）基金经理助理。	2025-12-16	—	8 年	周予希，美国波士顿学院金融硕士，2018 年 1 月起加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，先后担任中央交易室交易员、固定收益投资部（上海）助理，现任本公司固定收益投资部（公募）基金经理助理。
胡崇海	本基金基金经理（已于 2026 年 2 月 4 日离任）。	2024-02-06	2026-02-04	15 年	胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士。曾任香港科技大学人工智能实验室访问学者，其后加盟方正证券研究所、国泰君安证券咨询部及研究所从事量化对冲模型的研发工作，2014 年加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，先后在量化投资部、权益与衍生品部

					担任高级投资经理，从事量化投资和策略研发工作，在 Alpha 量化策略以及基于机器学习的投资方面有独到且深入的研究。现任本公司量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，中国经济延续了“新旧动能转换”的格局，整体呈现“外需强于内需、新动能强于旧动能”的 K 型分化特征。一季度经济实现“开门红”，主要指标回暖，工业增加值稳步抬

升，出口保持强劲，PMI 在 3 月回到荣枯线以上，二季度经济动能边际放缓，主要受房地产投资持续低迷、居民消费意愿修复缓慢以及外部贸易环境不确定性上升的影响。通胀方面受国际原油价格上行影响，PPI 同比明显走高。货币政策“适度宽松”基调未变，但二季度更加重视“精准调控”，财政支出则有所放缓。整体而言，经济复苏动能仍不均衡，内需修复依赖政策持续发力，外部地缘政治风险与大宗商品价格波动为宏观环境增添了不确定性。

A 股市场上半年整体震荡上行，月度节奏和结构显著分化。一季度初市场延续春季躁动，科技成长、资源品和部分顺周期方向轮动活跃，3 月受地缘扰动和海外流动性预期变化影响，市场风险偏好快速回落；二季度 4 月市场逐步修复，5 月成长风格占优，AI 算力、半导体、通信、电子、先进制造等方向持续活跃，6 月市场转为高位波动，资金进一步集中于 AI 硬件产业链、涨价品种和部分低位修复方向，科技成长显著领先，但主线拥挤度和市场波动也同步上升。可转债方面，2026 年上半年转债表现优于中证全债以及上证 50，但显著弱于科创 50、万得全 A 以及沪深 300 等宽基指数，转债弹性整体偏弱。债券市场方面，一季度资金面总体偏宽松，中短端收益率下行，收益率曲线趋于陡峭，信用利差有所压缩，超长债经历先强后弱的波动；二季度 4 月资金面极度宽松推动收益率下行，5 月至 6 月资金利率逐步向政策利率回归，债券市场出现短期调整，但由于信贷需求和内需偏弱，收益率整体仍呈震荡下行。

报告期内，本基金权益投资坚持采用量化投资策略，以全市场最大化 Alpha 为核心目标，针对市场结构性分化特征构建红利高股息低波与双创科技成长相结合的哑铃型量化配置体系。一方面，挖掘高股息、低波动的红利因子，构建相对稳健的价值底仓；另一方面，关注双创板块和科技成长赛道的动量与成长特征，提升组合进攻弹性。在运作层面，坚持基本面与量价信号相结合的多因子量化框架，严格控制行业与风格暴露，力求在不同风格之间保持动态平衡。报告期内，本基金整体维持可转债仓位在偏低水平，结构上主要集中在中低价位段信用资质较优品种。债券投资方面，组合主要配置信用债，以票息策略为主，优选中高等级信用债，并阶段性参与利率债交易机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰海通稳债增利债券发起 A 基金份额净值为 1.0890 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.80%，同期业绩比较基准收益率为 1.46%；截至报告期末国泰海通稳债增利债券发起 C 基金份额净值为 1.0787 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.60%，同期业绩比较基准收益率为 1.46%。

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 年下半年，预计中国经济将延续新旧动能转换的“K 型分化”格局，总体呈现温和复苏态势。权益市场的结构性行情可能延续，红利资产在低利率环境下仍具备一定配置价值，科技创新和双创方向则需要关注产业趋势、盈利兑现和估值匹配，量化策略将根据市场风格变化动态调

整分域配置。我们认为转债市场整体仍处于低平价+弱趋势动量+高溢价的组合环境中，转债指数层面绝对收益空间相对有限。现阶段对于弹性博弈交易相对谨慎，待风险端信号、交易状态和内部结构出现连续改善后，再考虑逐步提高组合进攻性，耐心把握低位板块和个券修复的波段机会。债券组合将以套息策略为主、波段操作为辅，优选高等级信用债进行配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用。

§ 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	6,337,338.08	15,273,229.76
结算备付金		4,992,984.87	6,959,166.35
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	180,024,360.96	182,845,922.02
其中：股票投资		14,421,495.96	10,133,689.74
基金投资		—	—
债券投资		165,602,865.00	172,712,232.28
资产支持证 券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产		—	—
买入返售金融资产	6.4.7.3	—	—
应收清算款		—	—
应收股利		—	—

应收申购款		3,300,191.89	3,666,815.89
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.4	—	—
资产总计		194,654,875.80	208,745,134.02
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债		—	—
卖出回购金融资产款		20,000,821.92	20,003,567.19
应付清算款		—	—
应付赎回款		199,957.87	566,888.61
应付管理人报酬		84,575.62	103,149.51
应付托管费		21,143.93	25,787.40
应付销售服务费		19,748.12	28,322.68
应付投资顾问费		—	—
应交税费		6,508.06	8,217.48
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.5	218,220.49	178,786.50
负债合计		20,550,976.01	20,914,719.37
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	160,400,717.83	177,840,933.24

未分配利润	6.4.7.7	13,703,181.96	9,989,481.41
净资产合计		174,103,899.79	187,830,414.65
负债和净资产总计		194,654,875.80	208,745,134.02

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 160,400,717.83 份。其中国泰海通稳债增利债券发起 A 基金份额净值 1.0890 元，基金份额总额 105,432,863.42 份；国泰海通稳债增利债券发起 C 基金份额净值 1.0787 元，基金份额总额 54,967,854.41 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		5,684,953.62	2,319,810.19
1. 利息收入		41,815.64	53,703.71
其中：存款利息收入	6.4.7.8	41,571.48	53,703.71
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		244.16	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,528,823.47	3,090,566.64
其中：股票投资收益	6.4.7.9	2,683,355.94	-66,274.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	1,758,291.49	3,196,905.50
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-93,879.21

股利收益	6.4.7.11	87,176.04	53,815.28
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	1,105,274.04	-840,446.53
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	9,040.47	15,986.37
减：二、营业总支出		1,033,331.32	789,589.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	536,942.41	329,181.36
2. 托管费	6.4.10.2.2	134,235.66	82,295.43
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	127,256.22	118,831.02
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		127,881.36	150,695.60
其中：卖出回购金融资产支出		127,881.36	150,695.60
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		4,589.16	267.91
8. 其他费用	6.4.7.14	102,426.51	108,318.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,651,622.30	1,530,220.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,651,622.30	1,530,220.63
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,651,622.30	1,530,220.63

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金

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

单位：人民币元

项 目	本期
-----	----

	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	177,840,933.24	9,989,481.41	187,830,414.65
二、本期期初净资产	177,840,933.24	9,989,481.41	187,830,414.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-17,440,215.41	3,713,700.55	-13,726,514.86
（一）、综合收益总额	-	4,651,622.30	4,651,622.30
（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）	-17,440,215.41	-937,921.75	-18,378,137.16
其中：1. 基金申购款	159,439,022.52	10,932,152.03	170,371,174.55
2. 基金赎回款	-176,879,237.93	-11,870,073.78	-188,749,311.71
（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	160,400,717.83	13,703,181.96	174,103,899.79
项 目	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	106,106,332.32	2,969,911.79	109,076,244.11
二、本期期初净资产	106,106,332.32	2,969,911.79	109,076,244.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	19,706,315.90	2,507,238.28	22,213,554.18
（一）、综合收益总额	-	1,530,220.63	1,530,220.63
（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）	19,706,315.90	977,017.65	20,683,333.55
其中：1. 基金申购款	152,412,314.47	5,031,702.37	157,444,016.84
2. 基金赎回款	-132,705,998.57	-4,054,684.72	-136,760,683.29
（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	125,812,648.22	5,477,150.07	131,289,798.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

叶明	叶明	王红莲
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）由国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金变更而来。国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金经中国证券监督管理委员会 2023 年 11 月 14 日证监许可[2023]2565 号文注册募集。《国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2024 年 2 月 6 日正式生效。本基金为契约型开放式。

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，国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金变更为国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金。《国泰海通稳债增利债券型发起式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《国泰君安稳债增利债券型发起式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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金基金合同》，本基金根据是否收取认购费、申购费、销售服务费，将基金份额分为不同的类别。投资人在认购、申购时收取认购费、申购费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；投资人在认购、申购时不收取认购费、申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、科创板、创业板以及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、国债期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。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：本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，本基金投资于股票和存托凭证、可交换债券、可转换债券（分离交易可转债的债券部分除外）的比例不高于基金资产的 20%。每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价(总值)指数收益率×88%+中证 500 指数收益率×6%+中证 1000 指数收益率×6%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会

计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	1,417,978.00
等于：本金	1,417,623.11
加：应计利息	354.89
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	4,919,360.08
等于：本金	4,919,289.87
加：应计利息	70.21
减：坏账准备	-
合计	6,337,338.08

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		14,286,328.75	-	14,421,495.96	135,167.21
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,131,844.16	5,290.34	1,078,999.69	-58,134.81
	银行间市场	162,336,329.97	1,481,345.31	164,523,865.31	706,190.03
	合计	163,468,174.13	1,486,635.65	165,602,865.00	648,055.22
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		177,754,502.88	1,486,635.65	180,024,360.96	783,222.43

6.4.7.3 买入返售金融资产

6.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	35.03
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	14,848.50
其中：交易所市场	-
银行间市场	14,848.50
应付利息	-
预提信息披露费	179,507.37
预提审计费	14,380.45
预提账户维护费	9,300.00
其他应付	149.14
合计	218,220.49

6.4.7.6 实收基金

国泰海通稳债增利债券发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	107,798,265.27	107,798,265.27
本期申购	78,011,365.08	78,011,365.08
本期赎回（以“-”号填列）	-80,376,766.93	-80,376,766.93
本期末	105,432,863.42	105,432,863.42

国泰海通稳债增利债券发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	70,042,667.97	70,042,667.97
本期申购	81,427,657.44	81,427,657.44
本期赎回（以“-”号填列）	-96,502,471.00	-96,502,471.00
本期末	54,967,854.41	54,967,854.41

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.7 未分配利润

国泰海通稳债增利债券发起 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	7,278,998.48	-886,232.59	6,392,765.89
本期期初	7,278,998.48	-886,232.59	6,392,765.89
本期利润	2,355,149.80	799,276.34	3,154,426.14
本期基金份额交易产生的变动数	-180,448.35	12,048.01	-168,400.34
其中：基金申购款	5,916,438.04	-343,570.28	5,572,867.76
基金赎回款	-6,096,886.39	355,618.29	-5,741,268.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,453,699.93	-74,908.24	9,378,791.69

国泰海通稳债增利债券发起 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	4,170,496.70	-573,781.18	3,596,715.52
本期期初	4,170,496.70	-573,781.18	3,596,715.52
本期利润	1,191,198.46	305,997.70	1,497,196.16
本期基金份额交易产生的变动数	-996,201.21	226,679.80	-769,521.41
其中：基金申购款	5,578,420.58	-219,136.31	5,359,284.27
基金赎回款	-6,574,621.79	445,816.11	-6,128,805.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,365,493.95	-41,103.68	4,324,390.27

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	6,826.66
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	926.30
结算备付金利息收入	33,818.52
其他	-
合计	41,571.48

6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	50,045,440.23
减：卖出股票成本总额	47,323,294.42
减：交易费用	38,789.87
买卖股票差价收入	2,683,355.94

6.4.7.10 债券投资收益

6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	1,951,977.37
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-193,685.88
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	1,758,291.49

6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	223,768,908.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	222,111,324.04
减：应计利息总额	1,842,926.13
减：交易费用	8,344.11
买卖债券差价收入	-193,685.88

6.4.7.11 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	87,176.04
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	87,176.04

6.4.7.12 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,105,274.04
——股票投资	1,775.04
——债券投资	1,103,499.00
——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	1,105,274.04

6.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	9,034.79
转换费收入	5.68
合计	9,040.47

6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	14,380.45
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行汇划费	9,938.69
账户维护费	18,600.00
合计	102,426.51

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海国泰海通证券资产管理有限公司 (以下简称“国泰海通资管”)	基金管理人
招商银行股份有限公司(以下简称 “招商银行”)	基金托管人、代销机构
国泰海通证券股份有限公司(以下简 称“国泰海通证券”)	基金管理人的股东、代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 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	101,654,765.83	100.00%	56,423,414.92	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 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	18,841,110.98	100.00%	34,947,492.09	100.00%

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券	7,311.76	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券	4,520.93	100.00%	-	-

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	536,942.41	329,181.36
其中：应支付销售机构的客户	206,030.55	134,201.30

维护费		
应支付基金管理人的净管理费	330,911.86	194,980.06

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H=E\times 0.60\%\div \text{当年天数}$

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。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	134,235.66	82,295.43

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰海通稳债增利债券发起 A	国泰海通稳债增利债券发起 C	合计
国泰海通资管	-	14,137.22	14,137.22
国泰海通证券	-	68,678.68	68,678.68
招商银行	-	28,203.78	28,203.78
合计	-	111,019.68	111,019.68
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	国泰海通稳债增利债券 发起 A	国泰海通稳债增利债券 发起 C	合计
招商银行	-	45,343.67	45,343.67
国泰海通资管	-	6.30	6.30
国泰海通证券	-	67,083.86	67,083.86
合计	-	112,433.83	112,433.83

注：销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，其中，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。

本基金 C 类基金份额的基金销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提 C 类基金份额的基金销售服务费，E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值。

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期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。

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

本基金本报告期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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国泰海通稳债增利债券发起 A

份额单位：份

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	10,009,450.45	10,009,450.45

报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	10,009,450.45	10,009,450.45
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.49%	14.22%

注：1. 基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。2. 报告期末持有的本基金份额占基金分类份额比例，比例的分母采用各自类别的份额计算。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行，本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	1,417,978.00	6,826.66	2,411,833.76	5,365.56
国泰海通证券	4,919,360.08	926.30	4,007,756.86	1,612.89

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金的其他存款由基金结算机构国泰海通证券保管，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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。

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
300332	天壕能源	2026-06-26	筹划发行股份及支付现金购买资产	4.30	2026-07-09	4.64	2,500	12,264.37	10,750.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 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 20,000,821.92 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
232580008	25 工行二级资本债 02BC	2026-07-01	101.22	64,000	6,478,020.03
232680003	26 中行二级资本债 01BC	2026-07-01	100.91	150,000	15,135,984.66
合计				214,000	21,614,004.69

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	20,257,315.07	32,322,429.92
合计	20,257,315.07	32,322,429.92

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政策性金融债、超短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	85,995,310.47	71,718,904.99
AAA 以下	811,556.24	3,135,762.19
未评级	58,538,683.22	65,535,135.18
合计	145,345,549.93	140,389,802.36

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、中期票据、政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2026 年 6 月 30 日除卖出回购金融资产款余额中有 20,000,821.92 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于

流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,337,338.08	-	-	-	6,337,338.08
结算备付金	4,992,984.87	-	-	-	4,992,984.87
交易性金融资产	31,553,759.96	95,973,585.92	38,075,519.12	14,421,495.96	180,024,360.96
应收申购款	-	-	-	3,300,191.89	3,300,191.89
资产总计	42,884,082.9	95,973,585.9	38,075,519.1	17,721,687.8	194,654,875.8

	1	2	2	5	0
负债					
卖出回购 金融资产 款	20,000,821.9 2	—	—	—	20,000,821.92
应付赎回 款	—	—	—	199,957.87	199,957.87
应付管理 人报酬	—	—	—	84,575.62	84,575.62
应付托管 费	—	—	—	21,143.93	21,143.93
应付销售 服务费	—	—	—	19,748.12	19,748.12
应交税费	—	—	—	6,508.06	6,508.06
其他负债	—	—	—	218,220.49	218,220.49
负债总计	20,000,821.9 2	—	—	550,154.09	20,550,976.01
利率敏感 度缺口	22,883,260.9 9	95,973,585.9 2	38,075,519.1 2	17,171,533.7 6	174,103,899.7 9
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	15,273,229.7 6	—	—	—	15,273,229.76
结算备付 金	6,959,166.35	—	—	—	6,959,166.35
交易性金 融资产	47,348,580.5 1	96,785,388.2 6	28,578,263.5 1	10,133,689.7 4	182,845,922.0 2
应收申购 款	—	—	—	3,666,815.89	3,666,815.89
资产总计	69,580,976.6 2	96,785,388.2 6	28,578,263.5 1	13,800,505.6 3	208,745,134.0 2
负债					
卖出回购 金融资产 款	20,003,567.1 9	—	—	—	20,003,567.19
应付赎回 款	—	—	—	566,888.61	566,888.61
应付管理 人报酬	—	—	—	103,149.51	103,149.51

应付托管费	-	-	-	25,787.40	25,787.40
应付销售服务费	-	-	-	28,322.68	28,322.68
应交税费	-	-	-	8,217.48	8,217.48
其他负债	-	-	-	178,786.50	178,786.50
负债总计	20,003,567.19	-	-	911,152.18	20,914,719.37
利率敏感度缺口	49,577,409.43	96,785,388.26	28,578,263.51	12,889,353.45	187,830,414.65

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日或行权日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	基准利率点利率增加 0.1%	-1,087,245.24	-683,092.61
	基准利率点利率减少 0.1%	1,107,838.41	693,469.10

注：上表反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	14,421,495.96	8.28	10,133,689.74	5.40
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	14,421,495.96	8.28	10,133,689.74	5.40

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 8.28%(2025 年 12 月 31 日:5.40%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	15,489,745.65	14,931,000.44
第二层次	164,534,615.31	167,914,921.58
第三层次	-	-
合计	180,024,360.96	182,845,922.02

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	14,421,495.96	7.41
	其中：股票	14,421,495.96	7.41
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	165,602,865.00	85.08
	其中：债券	165,602,865.00	85.08
	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	11,330,322.95	5.82
8	其他各项资产	3,300,191.89	1.70
9	合计	194,654,875.80	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 0.00 元，占期末净值的比例为 0.00%；通过转融通证券出借业务的证券公允价值为 0.00 元，占资产净值的比例为 0.00%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	139,651.00	0.08
B	采矿业	944,395.00	0.54
C	制造业	10,529,335.96	6.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	135,806.00	0.08
E	建筑业	58,486.00	0.03
F	批发和零售业	331,047.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	418,238.00	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	607,009.00	0.35
J	金融业	903,213.00	0.52
K	房地产业	10,400.00	0.01
L	租赁和商务服务业	80,363.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	169,541.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	48,788.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	34,342.00	0.02
S	综合	10,881.00	0.01
	合计	14,421,495.96	8.28

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	1,300	510,913.00	0.29
2	300489	光智科技	400	124,780.00	0.07
3	300223	北京君正	500	124,450.00	0.07
4	300260	新莱应材	1,200	120,552.00	0.07
5	300475	香农芯创	400	120,000.00	0.07
6	688559	海目星	1,300	109,096.00	0.06
7	688396	华润微	1,100	107,305.00	0.06
8	600546	山煤国际	9,400	102,742.00	0.06
9	688110	东芯股份	500	101,850.00	0.06
10	601225	陕西煤业	5,000	101,750.00	0.06
11	688499	利元亨	1,918	100,790.90	0.06
12	300408	三环集团	600	100,140.00	0.06
13	600150	中国船舶	2,900	97,991.00	0.06
14	688347	华虹宏力	286	96,181.80	0.06
15	601857	中国石油	11,000	95,480.00	0.05
16	300274	阳光电源	600	95,412.00	0.05
17	300863	卡倍亿	1,200	91,956.00	0.05
18	601398	工商银行	12,500	88,375.00	0.05
19	688469	芯联集成	8,200	87,002.00	0.05
20	601997	贵阳银行	16,900	86,697.00	0.05
21	300607	拓斯达	2,100	86,583.00	0.05
22	300661	圣邦股份	600	86,088.00	0.05
23	301021	英诺激光	700	85,330.00	0.05
24	688090	瑞松科技	780	83,031.00	0.05
25	688301	奕瑞科技	620	76,880.00	0.04
26	601009	南京银行	7,700	76,153.00	0.04
27	300438	鹏辉能源	900	74,565.00	0.04
28	688728	格科微	3,500	73,640.00	0.04
29	688456	有研粉材	500	69,800.00	0.04
30	300604	长川科技	200	68,284.00	0.04
31	300857	协创数据	200	67,980.00	0.04
32	688599	天合光能	4,800	67,776.00	0.04
33	600019	宝钢股份	12,400	67,332.00	0.04
34	601998	中信银行	9,700	67,221.00	0.04
35	000933	神火股份	3,100	65,720.00	0.04
36	000338	潍柴动力	2,400	65,400.00	0.04
37	688202	美迪西	800	64,568.00	0.04
38	301536	星宸科技	500	64,355.00	0.04

39	601699	潞安环能	4,500	64,260.00	0.04
40	600919	江苏银行	5,900	63,602.00	0.04
41	601077	渝农商行	10,300	62,933.00	0.04
42	000048	京基智农	2,800	61,852.00	0.04
43	688719	爱科赛博	800	61,600.00	0.04
44	601872	招商轮船	3,500	61,495.00	0.04
45	601988	中国银行	10,600	60,632.00	0.03
46	600018	上港集团	12,800	60,416.00	0.03
47	301369	联动科技	245	60,025.00	0.03
48	300136	信维通信	500	59,625.00	0.03
49	300672	国科微	200	59,000.00	0.03
50	600741	华域汽车	3,800	58,976.00	0.03
51	301511	德福科技	400	57,540.00	0.03
52	000519	中兵红箭	2,700	56,889.00	0.03
53	300319	麦捷科技	1,900	56,297.00	0.03
54	301526	国际复材	1,200	56,004.00	0.03
55	301310	鑫宏业	1,000	55,240.00	0.03
56	300715	凯伦股份	3,300	54,318.00	0.03
57	300121	阳谷华泰	4,200	52,920.00	0.03
58	603511	爱慕股份	4,600	52,900.00	0.03
59	002641	公元股份	13,700	52,882.00	0.03
60	300483	首华燃气	3,000	52,740.00	0.03
61	300400	劲拓股份	1,400	52,710.00	0.03
62	300191	潜能恒信	1,900	52,535.00	0.03
63	601777	千里科技	6,400	52,224.00	0.03
64	002966	苏州银行	7,500	52,200.00	0.03
65	601333	广深铁路	18,800	51,700.00	0.03
66	600938	中国海油	1,900	51,585.00	0.03
67	600188	兖矿能源	2,900	51,533.00	0.03
68	002399	海普瑞	5,700	51,186.00	0.03
69	601898	中煤能源	4,200	51,156.00	0.03
70	601939	建设银行	5,300	51,039.00	0.03
71	688275	万润新能	400	51,020.00	0.03
72	688323	瑞华泰	900	50,850.00	0.03
73	601919	中远海控	3,800	50,388.00	0.03
74	301086	鸿富瀚	240	50,227.20	0.03
75	002851	麦格米特	300	50,154.00	0.03
76	600320	振华重工	11,800	48,734.00	0.03
77	605123	派克新材	500	48,505.00	0.03
78	600153	建发股份	6,100	48,373.00	0.03
79	688231	隆达股份	1,310	48,116.30	0.03
80	688981	中芯国际	300	47,646.00	0.03
81	601665	齐鲁银行	8,200	47,314.00	0.03

82	300488	恒锋工具	1,000	46,830.00	0.03
83	000937	冀中能源	11,750	46,765.00	0.03
84	300124	汇川技术	700	46,431.00	0.03
85	300779	惠城环保	920	46,184.00	0.03
86	600893	航发动力	1,200	46,008.00	0.03
87	688012	中微公司	98	45,913.00	0.03
88	001696	宗申动力	2,200	45,782.00	0.03
89	002338	奥普光电	800	45,760.00	0.03
90	688107	安路科技	1,000	45,600.00	0.03
91	600598	北大荒	4,200	45,528.00	0.03
92	300820	英杰电气	500	45,115.00	0.03
93	300281	金明精机	7,400	44,622.00	0.03
94	603283	赛腾股份	550	44,539.00	0.03
95	000001	平安银行	4,400	44,220.00	0.03
96	301246	宏源药业	1,600	43,040.00	0.02
97	688609	九联科技	3,900	42,939.00	0.02
98	301297	富乐德	700	42,868.00	0.02
99	688001	华兴源创	500	42,850.00	0.02
100	603507	振江股份	1,300	42,757.00	0.02
101	603728	鸣志电器	700	42,644.00	0.02
102	600395	盘江股份	9,000	41,040.00	0.02
103	601766	中国中车	7,800	40,560.00	0.02
104	002594	比亚迪	500	39,850.00	0.02
105	600348	华阳股份	5,100	39,015.00	0.02
106	002419	天虹股份	9,200	38,916.00	0.02
107	600037	歌华有线	6,200	38,874.00	0.02
108	600827	百联股份	5,200	38,532.00	0.02
109	688350	富淼科技	1,100	37,983.00	0.02
110	300620	光库科技	100	37,820.00	0.02
111	300756	金马游乐	1,140	37,677.00	0.02
112	300199	翰宇药业	1,700	37,536.00	0.02
113	002245	蔚蓝锂芯	2,000	37,420.00	0.02
114	300346	南大光电	400	37,060.00	0.02
115	688428	诺诚健华	1,300	37,011.00	0.02
116	688175	高凌信息	1,470	36,970.50	0.02
117	688416	恒烁股份	260	36,400.00	0.02
118	688166	博瑞医药	1,000	35,010.00	0.02
119	688779	五矿新能	4,300	34,873.00	0.02
120	301389	隆扬电子	400	34,716.00	0.02
121	002028	思源电气	200	34,600.00	0.02
122	002521	齐峰新材	4,700	34,028.00	0.02
123	688678	福立旺	1,400	33,838.00	0.02
124	600008	首创环保	12,400	33,728.00	0.02

125	003016	欣贺股份	5,500	33,715.00	0.02
126	301248	杰创智能	400	33,572.00	0.02
127	688172	燕东微	400	33,464.00	0.02
128	600050	中国联通	8,300	33,200.00	0.02
129	301396	宏景科技	100	33,160.00	0.02
130	600814	杭州解百	5,400	32,940.00	0.02
131	688115	思林杰	400	32,900.00	0.02
132	300401	花园生物	1,500	32,835.00	0.02
133	688081	兴图新科	800	32,704.00	0.02
134	600810	神马股份	5,300	32,701.00	0.02
135	301571	国科天成	500	32,590.00	0.02
136	600585	海螺水泥	1,900	32,205.00	0.02
137	601658	邮储银行	6,500	32,045.00	0.02
138	605117	德业股份	300	31,854.00	0.02
139	600601	方正科技	2,300	31,832.00	0.02
140	300568	星源材质	1,700	31,824.00	0.02
141	603659	璞泰来	1,100	31,823.00	0.02
142	688387	信科移动	1,600	31,744.00	0.02
143	600971	恒源煤电	4,600	31,740.00	0.02
144	600717	天津港	8,000	31,120.00	0.02
145	688002	睿创微纳	200	30,938.00	0.02
146	300283	温州宏丰	1,500	30,825.00	0.02
147	600020	中原高速	8,300	30,627.00	0.02
148	002353	杰瑞股份	200	30,500.00	0.02
149	601279	英利汽车	10,000	30,500.00	0.02
150	688309	恒誉环保	500	30,440.00	0.02
151	300486	东杰智能	1,400	29,890.00	0.02
152	600375	汉马科技	8,100	29,889.00	0.02
153	301178	天亿马	600	29,850.00	0.02
154	688225	亚信安全	2,400	29,808.00	0.02
155	601985	中国核电	3,300	29,799.00	0.02
156	688135	利扬芯片	700	29,456.00	0.02
157	688216	气派科技	700	29,407.00	0.02
158	688680	海优新材	700	29,400.00	0.02
159	600104	上汽集团	3,000	29,280.00	0.02
160	601918	新集能源	3,400	29,206.00	0.02
161	603439	三力制药	2,300	29,003.00	0.02
162	002487	大金重工	500	28,985.00	0.02
163	301392	汇成真空	100	28,864.00	0.02
164	002952	亚世光电	1,300	28,639.00	0.02
165	002079	苏州固锝	1,900	28,557.00	0.02
166	000672	上峰材料	1,200	28,416.00	0.02
167	300751	迈为股份	100	28,246.00	0.02

168	600801	华新建材	1,800	28,080.00	0.02
169	300390	天华新能	300	28,053.00	0.02
170	002204	大连重工	5,300	27,984.00	0.02
171	002111	威海广泰	3,100	27,900.00	0.02
172	300548	长芯博创	100	27,800.00	0.02
173	000837	秦川机床	2,500	27,775.00	0.02
174	688620	安凯微	1,700	27,540.00	0.02
175	600999	招商证券	1,300	27,430.00	0.02
176	301116	益客食品	3,200	27,392.00	0.02
177	600460	士兰微	500	27,330.00	0.02
178	300315	掌趣科技	7,000	27,300.00	0.02
179	300579	数字认证	1,300	26,910.00	0.02
180	300953	震裕科技	200	26,740.00	0.02
181	300491	通合科技	700	26,733.00	0.02
182	600299	安迪苏	3,400	26,690.00	0.02
183	300617	安靠智电	500	26,495.00	0.02
184	688183	生益电子	200	26,480.00	0.02
185	688400	凌云光	400	26,480.00	0.02
186	002708	光洋股份	2,000	26,380.00	0.02
187	002169	智光电气	1,800	26,352.00	0.02
188	300014	亿纬锂能	400	26,012.00	0.01
189	002004	华邦健康	6,600	25,938.00	0.01
190	601700	风范股份	5,900	25,724.00	0.01
191	603158	腾龙股份	2,100	25,683.00	0.01
192	688772	珠海冠宇	1,300	25,519.00	0.01
193	002128	电投能源	1,100	25,432.00	0.01
194	601218	吉鑫科技	5,900	25,370.00	0.01
195	603950	长源东谷	300	25,329.00	0.01
196	601995	中金公司	700	25,305.00	0.01
197	601126	四方股份	400	25,280.00	0.01
198	688365	光云科技	1,600	25,232.00	0.01
199	600386	北巴传媒	8,000	24,960.00	0.01
200	301128	强瑞技术	160	24,944.00	0.01
201	603259	药明康德	200	24,902.00	0.01
202	603678	火炬电子	300	24,900.00	0.01
203	600681	百川能源	7,700	24,871.00	0.01
204	688320	禾川科技	600	24,870.00	0.01
205	688378	奥来德	400	24,800.00	0.01
206	688598	金博股份	500	24,725.00	0.01
207	301218	华是科技	600	24,720.00	0.01
208	001266	宏英智能	500	24,550.00	0.01
209	000969	安泰科技	1,000	24,540.00	0.01
210	688343	云天励飞	300	24,498.00	0.01

211	600884	杉杉股份	1,800	24,390.00	0.01
212	002625	光启技术	800	24,256.00	0.01
213	688045	必易微	300	24,234.00	0.01
214	688199	久日新材	700	24,171.00	0.01
215	300033	同花顺	100	24,100.00	0.01
216	300613	富瀚微	300	24,024.00	0.01
217	001389	广合科技	100	23,725.00	0.01
218	688249	晶合集成	400	23,612.00	0.01
219	688682	霍莱沃	600	23,340.00	0.01
220	688266	泽璟制药	200	23,332.00	0.01
221	300575	中旗股份	4,700	23,124.00	0.01
222	002218	拓日新能	6,000	23,040.00	0.01
223	600875	东方电气	800	23,016.00	0.01
224	600416	湘电股份	2,300	22,540.00	0.01
225	300623	捷捷微电	500	22,495.00	0.01
226	300733	西菱动力	1,840	21,988.00	0.01
227	688006	杭可科技	600	21,930.00	0.01
228	688390	固德威	200	21,702.00	0.01
229	300687	赛意信息	700	21,700.00	0.01
230	600727	鲁北化工	3,200	21,504.00	0.01
231	300776	帝尔激光	100	21,496.00	0.01
232	002518	科士达	400	21,436.00	0.01
233	600985	淮北矿业	1,500	21,075.00	0.01
234	688246	嘉和美康	1,000	20,550.00	0.01
235	600309	万华化学	300	20,523.00	0.01
236	300512	中亚股份	3,000	20,460.00	0.01
237	600015	华夏银行	3,200	20,448.00	0.01
238	600740	山西焦化	6,400	20,416.00	0.01
239	688108	赛诺医疗	1,100	20,383.00	0.01
240	688257	新锐股份	200	20,380.00	0.01
241	300031	宝通科技	700	19,999.00	0.01
242	601949	中国出版	4,300	19,995.00	0.01
243	601229	上海银行	2,300	19,964.00	0.01
244	603767	中马传动	1,400	19,908.00	0.01
245	300219	鸿利智汇	1,900	19,817.00	0.01
246	002645	华宏科技	720	19,807.20	0.01
247	301281	科源制药	400	19,720.00	0.01
248	688255	凯尔达	700	19,460.00	0.01
249	688689	银河微电	300	19,416.00	0.01
250	301265	华新科技	700	19,285.00	0.01
251	300339	润和软件	500	19,255.00	0.01
252	603985	恒润股份	800	19,216.00	0.01
253	600887	伊利股份	800	19,168.00	0.01

254	002265	建设工业	1,100	19,140.00	0.01
255	002850	科达利	100	18,930.00	0.01
256	688148	芳源股份	2,200	18,876.00	0.01
257	688716	中研股份	600	18,858.00	0.01
258	300034	钢研高纳	1,100	18,854.00	0.01
259	300414	中光防雷	1,700	18,734.00	0.01
260	301160	翔楼新材	400	18,660.00	0.01
261	603565	中谷物流	1,900	18,639.00	0.01
262	603396	金辰股份	700	18,550.00	0.01
263	002228	合兴包装	6,300	18,522.00	0.01
264	301071	力量钻石	200	18,500.00	0.01
265	000988	华工科技	100	18,461.00	0.01
266	688299	长阳科技	1,100	18,381.00	0.01
267	601127	赛力斯	300	18,375.00	0.01
268	600690	海尔智家	900	18,369.00	0.01
269	001337	四川黄金	500	18,330.00	0.01
270	601288	农业银行	3,000	18,210.00	0.01
271	002593	日上集团	4,500	17,955.00	0.01
272	002730	电光科技	600	17,946.00	0.01
273	605018	长华集团	1,200	17,892.00	0.01
274	688700	东威科技	200	17,880.00	0.01
275	301607	富特科技	340	17,765.00	0.01
276	688036	传音控股	300	17,685.00	0.01
277	002468	申通快递	1,200	17,472.00	0.01
278	002317	众生药业	700	17,199.00	0.01
279	002843	泰嘉股份	800	17,176.00	0.01
280	301391	卡莱特	300	17,130.00	0.01
281	603006	联明股份	1,200	17,100.00	0.01
282	603895	天永智能	600	17,034.00	0.01
283	000733	振华科技	300	16,992.00	0.01
284	600738	丽尚国潮	4,700	16,920.00	0.01
285	300726	宏达电子	200	16,914.00	0.01
286	000796	凯撒旅业	4,400	16,852.00	0.01
287	002746	仙坛股份	3,300	16,830.00	0.01
288	603390	通达电气	1,600	16,704.00	0.01
289	300087	ST 荃银	3,100	16,678.00	0.01
290	002009	天奇股份	800	16,544.00	0.01
291	688717	艾罗能源	200	16,514.00	0.01
292	301489	思泉新材	100	16,458.00	0.01
293	600482	中国动力	500	16,400.00	0.01
294	600256	广汇能源	3,300	16,302.00	0.01
295	300450	先导智能	400	16,288.00	0.01
296	688472	阿特斯	1,500	16,230.00	0.01

297	601882	海天精工	800	16,184.00	0.01
298	601117	中国化学	2,200	16,170.00	0.01
299	002364	中恒电气	300	16,140.00	0.01
300	301057	汇隆新材	700	16,100.00	0.01
301	300433	蓝思科技	300	16,098.00	0.01
302	300327	中颖电子	500	16,025.00	0.01
303	601827	三峰环境	2,200	15,994.00	0.01
304	300582	英飞特	1,300	15,834.00	0.01
305	688596	正帆科技	200	15,812.00	0.01
306	688230	芯导科技	200	15,762.00	0.01
307	600166	福田汽车	5,400	15,714.00	0.01
308	300511	雪榕生物	3,100	15,593.00	0.01
309	300049	福瑞医科	400	15,552.00	0.01
310	000690	宝新能源	3,300	15,510.00	0.01
311	601800	中国交建	2,700	15,417.00	0.01
312	301587	中瑞股份	700	15,365.00	0.01
313	603530	神马电力	300	15,270.00	0.01
314	600841	动力新科	2,500	15,250.00	0.01
315	688586	江航装备	1,300	15,197.00	0.01
316	300905	宝丽迪	300	15,180.00	0.01
317	002531	天顺风能	1,800	15,174.00	0.01
318	002446	盛路通信	1,400	15,036.00	0.01
319	002008	大族激光	100	15,011.00	0.01
320	002249	大洋电机	2,000	15,000.00	0.01
321	301517	陕西华达	300	14,889.00	0.01
322	002112	三变科技	900	14,751.00	0.01
323	301349	信德新材	200	14,720.00	0.01
324	688158	优刻得	400	14,704.00	0.01
325	603725	天安新材	1,300	14,690.00	0.01
326	603305	旭升集团	1,200	14,544.00	0.01
327	603076	乐惠国际	700	14,504.00	0.01
328	688382	益方生物	800	14,400.00	0.01
329	301603	乔锋智能	100	14,380.00	0.01
330	600026	中远海能	800	14,352.00	0.01
331	600269	赣粤高速	3,600	14,328.00	0.01
332	603085	天成自控	1,300	14,131.00	0.01
333	600858	银座股份	3,200	14,112.00	0.01
334	300342	天银机电	300	14,100.00	0.01
335	300432	富临精工	700	14,063.00	0.01
336	300381	溢多利	2,500	14,050.00	0.01
337	002863	今飞凯达	3,300	13,992.00	0.01
338	601600	中国铝业	1,700	13,974.00	0.01
339	688653	康希通信	800	13,904.00	0.01

340	600547	山东黄金	600	13,854.00	0.01
341	688168	安博通	200	13,750.00	0.01
342	002337	赛象科技	3,100	13,733.00	0.01
343	301360	荣旗科技	200	13,698.00	0.01
344	601000	唐山港	3,300	13,695.00	0.01
345	688500	慧辰股份	300	13,599.00	0.01
346	688117	圣诺生物	500	13,515.00	0.01
347	603516	淳中科技	100	13,461.00	0.01
348	688799	华纳药厂	300	13,461.00	0.01
349	603270	金帝股份	400	13,404.00	0.01
350	002812	恩捷股份	200	13,382.00	0.01
351	688690	纳微科技	300	13,230.00	0.01
352	300236	上海新阳	100	13,150.00	0.01
353	601186	中国铁建	2,200	13,090.00	0.01
354	300696	爱乐达	500	13,015.00	0.01
355	300284	苏交科	2,600	13,000.00	0.01
356	600787	中储股份	3,100	12,958.00	0.01
357	301393	昊帆生物	200	12,954.00	0.01
358	688226	威腾电气	300	12,849.00	0.01
359	301510	固高科技	400	12,772.00	0.01
360	600704	物产中大	2,700	12,744.00	0.01
361	600685	中船防务	500	12,720.00	0.01
362	600619	海立股份	800	12,680.00	0.01
363	300201	海伦哲	600	12,642.00	0.01
364	603758	秦安股份	1,400	12,516.00	0.01
365	300151	昌红科技	500	12,475.00	0.01
366	688220	翱捷科技	100	12,432.00	0.01
367	002090	金智科技	1,400	12,376.00	0.01
368	688005	容百科技	400	12,240.00	0.01
369	688373	盟科药业	2,700	12,231.00	0.01
370	301238	瑞泰新材	500	12,200.00	0.01
371	300473	德尔股份	400	12,160.00	0.01
372	301085	亚康股份	200	12,122.00	0.01
373	603308	应流股份	200	12,080.00	0.01
374	600028	中国石化	2,700	12,042.00	0.01
375	601139	深圳燃气	2,100	11,886.00	0.01
376	301095	广立微	100	11,805.00	0.01
377	300856	科思股份	1,100	11,726.00	0.01
378	688291	金橙子	200	11,696.00	0.01
379	603185	弘元绿能	700	11,683.00	0.01
380	002943	宇晶股份	260	11,499.80	0.01
381	603819	神力股份	1,000	11,450.00	0.01
382	600089	特变电工	500	11,250.00	0.01

383	002811	郑中设计	1,000	11,190.00	0.01
384	301568	思泰克	100	11,160.00	0.01
385	688786	悦安新材	238	10,967.04	0.01
386	300509	新美星	1,300	10,894.00	0.01
387	600805	悦达投资	2,700	10,881.00	0.01
388	603032	德新科技	400	10,760.00	0.01
389	300332	天壕能源	2,500	10,750.00	0.01
390	688360	德马科技	600	10,740.00	0.01
391	000887	中鼎股份	600	10,734.00	0.01
392	300464	星徽股份	1,500	10,695.00	0.01
393	688237	超卓航科	200	10,684.00	0.01
394	605299	舒华体育	800	10,680.00	0.01
395	002516	旷达科技	1,900	10,602.00	0.01
396	603063	禾望电气	200	10,578.00	0.01
397	688302	海创药业	300	10,551.00	0.01
398	300731	科创新源	180	10,504.80	0.01
399	601298	青岛港	1,300	10,465.00	0.01
400	002016	世荣兆业	2,600	10,400.00	0.01
401	600057	厦门象屿	1,900	10,298.00	0.01
402	300055	万邦达	1,600	10,288.00	0.01
403	600259	中稀有色	100	10,161.00	0.01
404	601399	国机重装	2,900	10,150.00	0.01
405	301662	宏工科技	100	10,132.00	0.01
406	603618	杭电股份	200	9,976.00	0.01
407	603179	新泉股份	200	9,930.00	0.01
408	002969	嘉美包装	700	9,856.00	0.01
409	003025	思进智能	700	9,856.00	0.01
410	600816	建元信托	4,000	9,760.00	0.01
411	300222	科大智能	700	9,695.00	0.01
412	605577	龙版传媒	1,100	9,691.00	0.01
413	600125	铁龙物流	1,900	9,633.00	0.01
414	688010	福光股份	198	9,628.74	0.01
415	300720	海川智能	100	9,620.00	0.01
416	688660	电气风电	1,114	9,602.68	0.01
417	301099	雅创电子	100	9,550.00	0.01
418	603025	大豪科技	700	9,548.00	0.01
419	002328	新朋股份	1,300	9,542.00	0.01
420	300854	中兰环保	500	9,540.00	0.01
421	300481	濮阳惠成	500	9,510.00	0.01
422	300872	天阳科技	600	9,480.00	0.01
423	000967	盈峰环境	900	9,477.00	0.01
424	688567	孚能科技	900	9,450.00	0.01
425	300817	双飞集团	600	9,360.00	0.01

426	605222	起帆电缆	400	9,328.00	0.01
427	601107	四川成渝	1,900	9,272.00	0.01
428	301216	万凯新材	400	9,196.00	0.01
429	300803	指南针	100	9,167.00	0.01
430	300213	佳讯飞鸿	1,500	9,090.00	0.01
431	600223	福瑞达	1,800	9,054.00	0.01
432	300763	锦浪科技	100	9,035.00	0.01
433	301210	金杨精密	300	9,000.00	0.01
434	603333	福华尚纬	1,100	8,866.00	0.01
435	601069	西部黄金	400	8,800.00	0.01
436	688595	芯海科技	200	8,772.00	0.01
437	688262	国芯科技	200	8,646.00	0.00
438	600030	中信证券	300	8,619.00	0.00
439	601106	中国一重	2,600	8,580.00	0.00
440	002284	亚太股份	900	8,541.00	0.00
441	688679	通源环境	200	8,418.00	0.00
442	300826	测绘股份	600	8,400.00	0.00
443	300442	润泽科技	100	8,307.00	0.00
444	600006	东风股份	1,600	8,208.00	0.00
445	688165	埃夫特	400	8,160.00	0.00
446	000868	安凯客车	2,500	8,150.00	0.00
447	600989	宝丰能源	400	8,132.00	0.00
448	300809	华辰装备	300	8,115.00	0.00
449	600590	泰豪科技	800	8,080.00	0.00
450	601156	东航物流	500	8,060.00	0.00
451	600066	宇通客车	300	8,043.00	0.00
452	300830	金现代	1,000	7,940.00	0.00
453	300691	联合光电	500	7,905.00	0.00
454	300107	建新股份	1,400	7,840.00	0.00
455	603876	鼎胜新材	300	7,803.00	0.00
456	603686	福龙马	600	7,752.00	0.00
457	605138	盛泰集团	1,400	7,728.00	0.00
458	603698	航天工程	200	7,712.00	0.00
459	002025	航天电器	100	7,622.00	0.00
460	002064	华峰化学	800	7,592.00	0.00
461	300407	凯发电气	700	7,560.00	0.00
462	000032	深桑达 A	300	7,485.00	0.00
463	002162	悦心健康	2,200	7,436.00	0.00
464	600498	烽火通信	100	7,360.00	0.00
465	600176	中国巨石	100	7,288.00	0.00
466	600426	华鲁恒升	300	7,176.00	0.00
467	603915	国茂股份	500	7,095.00	0.00
468	002266	浙富控股	1,400	7,084.00	0.00

469	300724	捷佳伟创	100	7,060.00	0.00
470	603681	永冠新材	300	6,855.00	0.00
471	002125	湘潭电化	500	6,830.00	0.00
472	600177	雅戈尔	900	6,777.00	0.00
473	688180	君实生物	200	6,764.00	0.00
474	301260	格力博	500	6,755.00	0.00
475	000895	双汇发展	300	6,720.00	0.00
476	600391	航发科技	200	6,690.00	0.00
477	603587	地素时尚	600	6,666.00	0.00
478	300410	正业科技	600	6,642.00	0.00
479	603319	美湖股份	200	6,642.00	0.00
480	603119	浙江荣泰	100	6,634.00	0.00
481	002460	赣锋锂业	100	6,540.00	0.00
482	000505	京粮控股	1,300	6,539.00	0.00
483	000026	飞亚达	300	6,462.00	0.00
484	300801	泰和科技	200	6,460.00	0.00
485	002465	海格通信	500	6,385.00	0.00
486	300425	中建环能	1,700	6,358.00	0.00
487	300553	集智股份	100	6,139.00	0.00
488	002056	横店东磁	200	6,096.00	0.00
489	300933	中辰股份	1,000	6,080.00	0.00
490	300909	汇创达	100	5,822.00	0.00
491	601066	中信建投	200	5,814.00	0.00
492	002283	天润工业	600	5,790.00	0.00
493	301487	盟固利	300	5,745.00	0.00
494	300508	维宏股份	100	5,743.00	0.00
495	002886	沃特股份	200	5,618.00	0.00
496	601727	上海电气	800	5,600.00	0.00
497	300127	银河磁体	200	5,590.00	0.00
498	002979	雷赛智能	100	5,578.00	0.00
499	603178	圣龙股份	400	5,540.00	0.00
500	002752	昇兴股份	1,000	5,520.00	0.00
501	603010	万盛股份	300	5,436.00	0.00
502	002414	高德红外	400	5,304.00	0.00
503	301017	漱玉平民	400	5,216.00	0.00
504	301500	飞南资源	200	5,210.00	0.00
505	600872	中炬高新	300	5,208.00	0.00
506	300576	容大感光	100	5,122.00	0.00
507	603826	坤彩科技	200	5,112.00	0.00
508	002452	长高电气	400	5,108.00	0.00
509	603486	科沃斯	100	5,075.00	0.00
510	603806	福斯特	300	5,037.00	0.00
511	002810	山东赫达	200	4,940.00	0.00

512	001283	豪鹏科技	100	4,902.00	0.00
513	002027	分众传媒	1,000	4,840.00	0.00
514	001212	中旗新材	100	4,738.00	0.00
515	002648	卫星化学	200	4,698.00	0.00
516	603638	艾迪精密	200	4,690.00	0.00
517	301025	读客文化	600	4,656.00	0.00
518	002179	中航光电	100	4,620.00	0.00
519	300215	电科院	700	4,613.00	0.00
520	002406	远东传动	700	4,592.00	0.00
521	300735	光弘科技	200	4,548.00	0.00
522	603730	岱美股份	400	4,468.00	0.00
523	603990	麦迪科技	200	4,258.00	0.00
524	301055	张小泉	100	4,247.00	0.00
525	002451	摩恩电气	600	4,224.00	0.00
526	300445	康斯特	200	4,164.00	0.00
527	001282	三联锻造	200	4,076.00	0.00
528	605228	神通科技	300	4,029.00	0.00
529	688522	纳睿雷达	200	4,004.00	0.00
530	002761	浙江建投	600	3,978.00	0.00
531	601088	中国神华	100	3,904.00	0.00
532	002391	长青股份	800	3,896.00	0.00
533	688658	悦康药业	300	3,858.00	0.00
534	600114	东睦股份	100	3,776.00	0.00
535	000089	深圳机场	600	3,618.00	0.00
536	603926	铁流股份	200	3,538.00	0.00
537	000421	南京公用	700	3,472.00	0.00
538	603980	吉华集团	500	3,320.00	0.00
539	300263	隆华科技	200	3,260.00	0.00
540	688619	罗普特	200	3,246.00	0.00
541	003816	中国广核	800	3,128.00	0.00
542	600609	金杯汽车	1,000	3,120.00	0.00
543	603808	歌力思	400	3,028.00	0.00
544	300154	瑞凌股份	400	3,008.00	0.00
545	002590	万安科技	300	3,000.00	0.00
546	600508	上海能源	400	2,948.00	0.00
547	600577	精达股份	300	2,934.00	0.00
548	688209	英集芯	100	2,908.00	0.00
549	300998	宁波方正	100	2,783.00	0.00
550	002132	恒星科技	500	2,705.00	0.00
551	300253	卫宁健康	400	2,692.00	0.00
552	600886	国投电力	200	2,662.00	0.00
553	002136	安纳达	200	2,616.00	0.00
554	003022	联泓新科	100	2,590.00	0.00

555	000708	中信特钢	200	2,524.00	0.00
556	688327	云从科技	200	2,492.00	0.00
557	600496	精工钢构	800	2,480.00	0.00
558	600039	四川路桥	300	2,346.00	0.00
559	600295	鄂尔多斯	200	2,144.00	0.00
560	301179	泽宇智能	100	2,046.00	0.00
561	600061	国投资本	300	1,965.00	0.00
562	002927	泰永长征	100	1,945.00	0.00
563	603013	亚普股份	100	1,579.00	0.00
564	300997	欢乐家	100	1,355.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入 金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	540,793.00	0.29
2	300483	首华燃气	424,571.00	0.23
3	300189	神农种业	273,336.00	0.15
4	300394	天孚通信	257,031.00	0.14
5	300191	潜能恒信	245,844.00	0.13
6	300773	拉卡拉	245,799.00	0.13
7	300476	胜宏科技	242,324.00	0.13
8	300308	中际旭创	237,506.00	0.13
9	300274	阳光电源	230,933.00	0.12
10	601088	中国神华	216,725.00	0.12
11	300502	新易盛	206,328.00	0.11
12	688110	东芯股份	205,295.50	0.11
13	688469	芯联集成	197,989.00	0.11
14	688183	生益电子	190,773.73	0.10
15	300136	信维通信	189,344.00	0.10
16	301396	宏景科技	188,620.00	0.10
17	300620	光库科技	184,619.00	0.10
18	300395	菲利华	183,365.00	0.10
19	301246	宏源药业	176,207.00	0.09
20	300531	优博讯	174,551.00	0.09

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出 金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	556,340.00	0.30
2	300483	首华燃气	429,778.00	0.23
3	300394	天孚通信	416,295.40	0.22
4	300502	新易盛	360,237.00	0.19
5	300604	长川科技	288,652.00	0.15
6	601088	中国神华	288,051.00	0.15
7	300189	神农种业	282,779.00	0.15
8	300773	拉卡拉	262,873.00	0.14
9	688336	三生国健	252,895.81	0.13
10	300476	胜宏科技	250,142.00	0.13
11	300750	宁德时代	243,205.00	0.13
12	688031	星环科技	236,993.00	0.13
13	688008	澜起科技	236,579.38	0.13
14	300191	潜能恒信	217,611.00	0.12
15	688981	中芯国际	213,676.76	0.11
16	600188	兖矿能源	210,704.00	0.11
17	688135	利扬芯片	204,846.98	0.11
18	301396	宏景科技	203,599.00	0.11
19	688146	中船特气	202,269.67	0.11
20	300867	圣元环保	198,565.00	0.11

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	51,609,325.60
卖出股票收入（成交）总额	50,045,440.23

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	38,075,519.12	21.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	85,515,608.11	49.12
	其中：政策性金融债	20,257,315.07	11.64
4	企业债券	10,194,912.33	5.86

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	30,737,825.75	17.65
7	可转债(可交换债)	1,078,999.69	0.62
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	165,602,865.00	95.12

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	2500002	25 超长特别 国债 02	300,000	28,051,245.90	16.11
2	250211	25 国开 11	200,000	20,257,315.07	11.64
3	232580008	25 工行二级 资本债 02BC	150,000	15,182,859.45	8.72
4	232680003	26 中行二级 资本债 01BC	150,000	15,135,984.66	8.69
5	232680005	26 农行二级 资本债 01A(BC)	150,000	15,117,883.56	8.68

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可投资国债期货。若本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，综合考虑流动性、基差水平、与债券组合相关度等因素，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金持有的前十名证券发行主体广发银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局地方分局、中国银行间市场交易商协会调查、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 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行及分支行、国家外汇管理局地方分局警告、罚款等。

本基金持有的前十名证券发行主体宁波银行股份有限公司，及其分支行 2025 年 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行罚款。

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 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行及分支行、国家外汇管理局地方分局、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 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局地方分局、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 7 月至 2026 年 6 月多次因违规被国家金融监督管理总局及地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局地方分局、地方财政局、证监会分局、深圳证券交易所罚款、警告等。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,300,191.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,300,191.89

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113042	上银转债	47,365.02	0.03
2	118031	天 23 转债	47,320.14	0.03
3	110087	天业转债	46,497.97	0.03
4	123124	晶瑞转 2	45,581.35	0.03
5	127084	柳工转 2	45,375.86	0.03
6	113062	常银转债	38,041.03	0.02
7	118034	晶能转债	34,356.51	0.02
8	123149	通裕转债	33,200.10	0.02
9	113052	兴业转债	26,469.70	0.02
10	127050	麒麟转债	25,287.86	0.01
11	123216	科顺转债	22,970.43	0.01
12	127064	杭氧转债	21,320.41	0.01
13	113691	和邦转债	21,276.69	0.01
14	113696	伯 25 转债	20,800.16	0.01
15	110086	精工转债	20,060.20	0.01
16	127045	牧原转债	19,951.33	0.01
17	110076	华海转债	19,321.08	0.01
18	113652	伟 22 转债	19,288.94	0.01
19	123119	康泰转 2	19,115.16	0.01
20	123257	安克转债	19,097.02	0.01
21	127031	洋丰转债	18,647.61	0.01
22	127030	盛虹转债	18,476.76	0.01
23	123158	宙邦转债	17,879.46	0.01
24	127040	国泰转债	17,109.31	0.01
25	127089	晶澳转债	17,082.33	0.01
26	127110	广核转债	16,725.96	0.01
27	113070	渝水转债	16,094.22	0.01
28	113634	珀莱转债	16,027.15	0.01
29	123104	卫宁转债	15,648.68	0.01

30	110093	神马转债	15,274.67	0.01
31	113659	莱克转债	15,236.98	0.01
32	127049	希望转 2	15,204.02	0.01
33	110098	南药转债	14,538.46	0.01
34	113655	欧 22 转债	14,020.91	0.01
35	113647	禾丰转债	13,870.46	0.01
36	127108	太能转债	13,708.01	0.01
37	113605	大参转债	13,472.72	0.01
38	127038	国微转债	12,669.75	0.01
39	127046	百润转债	12,600.09	0.01
40	113661	福 22 转债	12,590.06	0.01
41	127111	金威转债	12,545.00	0.01
42	128134	鸿路转债	11,872.46	0.01
43	113673	岱美转债	11,629.96	0.01
44	123133	佩蒂转债	11,494.01	0.01
45	110077	洪城转债	11,435.25	0.01
46	113640	苏利转债	10,127.90	0.01
47	113616	韦尔转债	10,106.28	0.01
48	123107	温氏转债	9,992.07	0.01
49	127083	山路转债	9,200.04	0.01
50	118013	道通转债	8,268.30	0.00
51	113054	绿动转债	7,114.99	0.00
52	111002	特纸转债	6,781.69	0.00
53	113688	国检转债	6,707.72	0.00
54	113625	江山转债	5,723.98	0.00
55	113046	金田转债	5,335.35	0.00
56	118030	睿创转债	5,095.26	0.00
57	127069	小熊转债	5,073.39	0.00
58	113682	益丰转债	4,923.99	0.00
59	113627	太平转债	4,552.87	0.00
60	110075	南航转债	4,387.37	0.00
61	113656	嘉诚转债	3,476.79	0.00
62	128125	华阳转债	3,376.90	0.00
63	128128	齐翔转 2	3,301.79	0.00
64	127085	韵达转债	2,396.15	0.00
65	127056	中特转债	1,177.50	0.00
66	128135	洽洽转债	1,143.45	0.00
67	127027	能化转债	1,113.47	0.00
68	113049	长汽转债	1,071.19	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国泰海通稳债增利债券发起 A	459	229,701.23	34,708,851.20	32.92%	70,724,012.22	67.08%
国泰海通稳债增利债券发起 C	1,664	33,033.57	22,096,506.50	40.20%	32,871,347.91	59.80%
合计	2,123	75,553.80	56,805,357.70	35.41%	103,595,360.13	64.59%

注：分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国泰海通稳债增利债券发起 A	93,731.09	0.0889%
	国泰海通稳债增利债券发起 C	198,114.54	0.3604%
	合计	291,845.63	0.1819%

注：分类基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开 放式基金	国泰海通稳债增利债券发起 A	0~10
	国泰海通稳债增利债券发起 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式 基金	国泰海通稳债增利债券发起 A	0
	国泰海通稳债增利债券发起 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。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份额 比例	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有 资金	10,009,450.45	6.24%	10,009,450.45	6.24%	自基金合同 生效日起不 少于 3 年
基金管理人高级 管理人员	75,374.49	0.05%	—	—	—
基金经理等人员	122,025.45	0.08%	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	94,445.69	0.06%	—	—	—
合计	10,301,296.08	6.43%	10,009,450.45	6.24%	—

注：其他为公司普通员工持有份额，持有期限为不低于 6 个月。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰海通稳债增利债券 发起 A	国泰海通稳债增利债券 发起 C
基金合同生效日（2024 年 02 月 06 日）基金 份额总额	439,046,412.99	653,734,425.41
本报告期期初基金份额总额	107,798,265.27	70,042,667.97
本报告期基金总申购份额	78,011,365.08	81,427,657.44
减：本报告期基金总赎回份额	80,376,766.93	96,502,471.00
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	105,432,863.42	54,967,854.41

注：基金总申购份额含红利再投资及转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2026 年 3 月 24 日，本基金管理人发布了《上海国泰海通证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，陈颖同志担任公司首席信息官，叶明同志不再代为履行公司首席信息官职责，生效日期为 2026 年 3 月 23 日。

2026 年 6 月 13 日，本基金管理人发布了《上海国泰海通证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，叶明同志担任公司总裁、财务负责人，陶耿同志不再兼任公司总裁、财务负责人职务，生效日期为 2026 年 6 月 12 日。

2、本报告期内本基金托管人专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人受稽查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人相关从业人员受稽查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰海通证券股份有限公司	2	101,654,765.83	100.00%	7,311.76	100.00%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰海通证券股份有限公司	18,841,110.98	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-01-22
2	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基	上海证券报、中国	2026-01-22

	金 2025 年 4 季度报告提示性公告	证券报、证券时报、证券日报	
3	国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金基金经理变更	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2026-02-04
4	国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2026 年第 1 号）	证监会指定网站、公司官网	2026-02-05
5	国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2026-02-05
6	国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2026-02-05
7	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	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	2026-03-24
8	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	证监会指定网站、公司官网	2026-03-28
9	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2026-03-31
10	国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金 2025 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-03-31
11	国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2026-04-22
12	上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2026-04-22
13	关于上海国泰海通证券资产管理有限公司吸收合并上海海通证券资产管理有限公司重要事项的公告	证监会指定网站、公司官网	2026-04-30
14	关于上海国泰海通证券资产管理有限公司吸收合并上海海通证券资产管理有限公司重要事项的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2026-05-06
15	上海国泰海通证券资产管理有限公司关于旗下公募基金产品在直销平台实施认购及申购费率优惠的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网	2026-05-22
16	在本报告期内刊登的其他公告	—	—

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰海通稳债增利债券型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、法律意见书；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站
<https://www.gthtzg.com>。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

上海国泰海通证券资产管理有限公司
二〇二六年八月三十一日