

国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金
(FOF)

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 08 月 30 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董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08月23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2024年01月01日起至2024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 | 8 |
| 2.4 信息披露方式 | 8 |
| 2.5 其他相关资料 | 9 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 9 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 9 |
| 3.2 基金净值表现 | 9 |
| § 4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 11 |
| 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 | 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..... | 15 |
| 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..... | 19 |
| 6.4 报表附注..... | 19 |
| § 7 投资组合报告 | 42 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 42 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 43 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 43 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... | 44 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 44 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 44 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 44 |
| 7.12 本报告期投资基金情况..... | 44 |

| | |
|---|-----------|
| 7.13 投资组合报告附注 | 46 |
| § 8 基金份额持有人信息..... | 47 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 47 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 48 |
| 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 | 48 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 | 48 |
| § 9 开放式基金份额变动..... | 49 |
| § 10 重大事件揭示 | 49 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 49 |
| 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..... | 49 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 49 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 50 |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 | 50 |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 50 |
| 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 50 |
| 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 50 |
| 10.9 其他重大事件..... | 51 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 51 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 51 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 52 |
| § 12 备查文件目录 | 52 |
| 12.1 备查文件目录..... | 52 |

| | |
|-----------------|----|
| 12.2 存放地点 | 53 |
| 12.3 查阅方式 | 53 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------|
| 基金名称 | 国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF） | |
| 基金简称 | 国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起（FOF） | |
| 基金主代码 | 019419 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2023 年 12 月 08 日 | |
| 基金管理人 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 10,009,000.00 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起（FOF）A | 国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起（FOF）C |
| 下属分级基金的交易代码 | 019419 | 019420 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 8,009,000.00 份 | 2,000,000.00 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 在合理控制风险的前提下，通过稳定的资产配置和精细化优选基金，力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 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>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>1) 在基金公司维度，主要考虑的因素有：基金公司的股东背景、公司治理、核心管理团队的综合素质和稳定性、基金经理与投研团队的综合素质和稳定性、公司管理的资产规模和盈利能力、管理层的管理风格、投资决策程序的科学性和执行度、公司风险控制制度健全性和执行力度、公司基金的类型和收益情况、公司基金交叉持股情况、基金公司产品创新能力及客户服务水平等。评价方式主要来自</p> |

| | |
|--|--|
| | <p>于实地调研、公司刊物和公开信息。</p> <p>2) 基金经理维度，对基金经理的从业经验、业绩表现、风险控制、业绩归因、风格特征等多个层面全方位地进行分析，定量和定性相结合，并通过持续跟踪保持更新。该体系从多种维度对基金经理的风格特征加以剖析，包括但不限于：组合构建思路、选股偏好、擅长投资领域、投资集中度、换手率情况等。</p> <p>3) 基金产品维度，重点考量首先根据基金的历史业绩情况，挑选出业绩持续优秀的基金，根据基金的风险收益特征，构建合适的基金投资组合。通过风险收益综合评价方法挖掘持续稳定的基金品种，主要包括选股能力、择时能力、风险控制能力等指标。</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>3、股票的投资策略</p> <p>通过分析宏观经济、产业政策和行业景气程度，以证监会行业分类标准为基础，挑选出增长前景持续向好的行业或周期景气复苏或上升的行业。通过定性和定量分析精选个股。定量分析使用的指标包括成长指标、价值指标和盈利指标，针对不同行业采取相应的估值方法；定性分析对精选公司进行“波特五力模型”分析，结合行业估值模型进行数量化的辅助投资决策。</p> <p>4、债券的投资策略</p> <p>本基金将采取久期偏离、收益率曲线配置和类属配置、无风险套利、杠杆策略和个券选择策略等投资策略，发现、确认并利用市场失衡实现组合增值。在综合考虑流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上，评估债券投资价值，选择定价合理或者价值被低估的债券构建投资组合，并根据市场变化情况对组合进行优化。</p> <p>5、资产支持证券等品种投资策略</p> <p>资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将深入分析上述基本面因素，并辅助数量化定价模型，评估其内在价值。</p> <p>6、存托凭证投资策略</p> <p>在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> |
|--|--|

| | |
|--------|--|
| | <p>7、可转换债券、可交换债券的投资策略</p> <p>本基金将对可转换债券、可交换债券对应的基础股票进行深入分析与研究，重点选择有较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转换债券、可交换债券，并在对应可转换债券、可交换债券估值合理的前提下进行投资，以分享正股上涨带来的收益。同时，本基金还将密切跟踪上市公司的经营状况，从财务压力、融资安排、未来的投资计划等方面推测、并通过实地调研等方式确认上市公司对转股价的修正和转股意愿。</p> <p>8、未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债新综合指数（财富）收益率*90%+中证 800 指数收益率*10% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金中基金，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，低于混合型基金、混合型基金中基金、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 | | 上海国泰君安证券资产管理有限公司 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 吕巍 | 张立学 |
| | 联系电话 | 021-38676022 | 010-68858113 |
| | 电子邮箱 | zgxxpl@gtjas.com | zhanglixue@psbcoa.com.cn |
| 客户服务电话 | | 95521 | 95580 |
| 传真 | | 021-38871190 | 010-68858120 |
| 注册地址 | | 上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室 | 北京市西城区金融大街 3 号 |
| 办公地址 | | 上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层 | 北京市西城区金融大街 3 号 A 座 |
| 邮政编码 | | 200120 | 100808 |
| 法定代表人 | | 陶耿 | 刘建军 |

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》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.gtjazg.com |

| | |
|------------|-----------------------------------|
| 基金中期报告备置地点 | 上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层 |
|------------|-----------------------------------|

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------------|---------------------------------------|
| 注册登记机构 | 上海国泰君安证券资产管理有限 公司 | 上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22- 23 层及 25 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（2024 年 01 月 01 日-2024 年 06 月 30 日） | |
|---------------|--|-------------------------------|
| | 国泰君安善怡稳健六个月 持有债券发起 (FOF) A | 国泰君安善怡稳健六个月持 有债券发起 (FOF) C |
| 本期已实现收益 | 41,353.87 | 7,301.00 |
| 本期利润 | 131,941.13 | 29,904.40 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0165 | 0.0150 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.63% | 1.48% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.65% | 1.50% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2024 年 06 月 30 日） | |
| 期末可供分配利润 | 45,292.52 | 7,906.21 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0057 | 0.0040 |
| 期末基金资产净值 | 8,162,484.47 | 2,034,905.13 |
| 期末基金份额净值 | 1.0192 | 1.0175 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末（2024 年 06 月 30 日） | |
| 基金份额累计净值增长率 | 1.92% | 1.75% |

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

国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起 (FOF) A 净值表现

| 阶段 | 份额净值 | 份额净值 | 业绩比较 | 业绩比较 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|------|------|------|-----|-----|
|----|------|------|------|------|-----|-----|

| | 增长率① | 增长率标准差② | 基准收益率③ | 基准收益率标准差④ | | |
|------------|-------|---------|--------|-----------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.14% | 0.03% | 0.35% | 0.06% | -0.21% | -0.03% |
| 过去三个月 | 0.83% | 0.04% | 1.24% | 0.08% | -0.41% | -0.04% |
| 过去六个月 | 1.65% | 0.03% | 3.25% | 0.10% | -1.60% | -0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.92% | 0.03% | 4.25% | 0.10% | -2.33% | -0.07% |

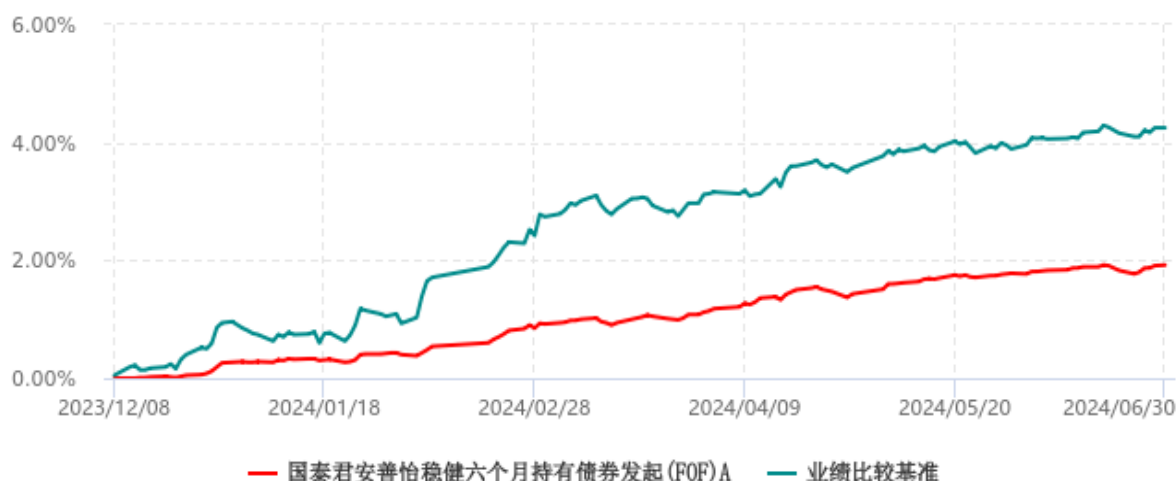
国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)C 净值表现

| 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.12% | 0.03% | 0.35% | 0.06% | -0.23% | -0.03% |
| 过去三个月 | 0.76% | 0.04% | 1.24% | 0.08% | -0.48% | -0.04% |
| 过去六个月 | 1.50% | 0.03% | 3.25% | 0.10% | -1.75% | -0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.75% | 0.03% | 4.25% | 0.10% | -2.50% | -0.07% |

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

国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(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

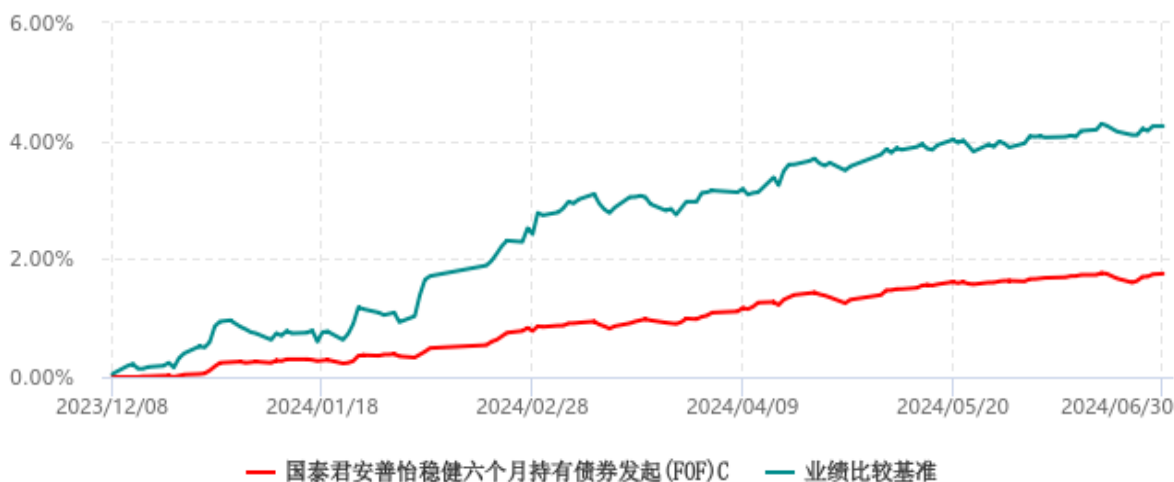
(2023年12月08日-2024年06月30日)



注：1、本基金于 2023 年 12 月 08 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(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
(2023年12月08日-2024年06月30日)



注：1、本基金于 2023 年 12 月 08 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

上海国泰君安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 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理国泰君安现金管家货币市场基金、国泰君安 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、国泰君安中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金、国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金、国泰君安君得明混合型证券投资基金、国泰君安东久新经济产业园封闭式基础设施证券投资基金、国泰君安君得利短债债券型证券投资基金、国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)、国泰君安 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安安弘六个月定期开放债券型证券投资基金、国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金等 53 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 | 国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金经理，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，国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)基金经理。现任基金投资部（公募）基金经理。 | 2023-12-08 | - | 14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。 |

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 2 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

海外方面，美国经济基本面仍保持韧性，降息预期持续延后，宏观数据波动对资产表现影响较大，AI 在上半年仍引领市场热点。从资产表现来看，纳指、标普 500 上行，美债利率震荡、美元相对保持强势、黄金/铜创历史新高、原油震荡上行。

国内方面，从 GDP 和 PMI 数据来看，经济增速稳定。这是我国新旧动能转换下的增长，传统动能下降，新动能上升。因此数据看虽有反复，但是仍能呈现增长。以前的房地产和基建投资高度依赖金融流动性，而随着新动能的增长，未来的依赖性相对减弱。同时我国居民部门杠杆率较高，再提升的空间有限。尤其在房子的金融属性减弱之后，未来的居民部门杠杆率有望下降，体现在 M1、M2 的增速上就是下降的趋势。

权益市场方面，因国内经济整体复苏情况偏弱，海外不确定性也有所抬升，多种因素影响下，股票市场在上半年走势较为震荡。年初市场快速回调，成长风格及小微盘股票弱于市场。2 月初至 5 月底，资金面好转，叠加资本市场及地产政策持续优化，市场震荡上行。5 月底至年中，政策效果进入观察期，资金观望氛围浓厚，市场走势震荡。从行业端的表现来看，受市场整体走势较为波动以及经济弱复苏的影响，高股息方向表现较好，而成长及消费方向表现则不佳，市场分化十分明显。

债券市场方面，债券收益率、利差持续下行。一季度，30 年利率债下行幅度较大，考虑到久期因素，表现最好；二季度，长期利率债震荡，机构转向压缩信用利差，尤其是长期信用债。综合来看，上半年信用加久期收益颇丰。

善怡：组合 80%以上资产投资于固收类基金，主要以纯债基金+中短债基金为主，少量配置权益类资产及黄金资产，在控制回撤的前提下追求相对稳定收益。主要操作为阶段性调整各类债基间的持仓比例，略扩大一级债投资比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)A 基金份额净值为 1.0192 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.65%，同期业绩比较基准收益率为 3.25%；截至报告期末国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)C 基金份额净值为 1.0175 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.50%，同期业绩比较基准收益率为 3.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年为选举大年，地缘政治或带来诸多不确定性。随着就业数据走弱及通胀回落，美联储年内降息概率大增。由于日本央行超预期加息，日元套息交易回落，海外市场波动性有所放大。鉴于美国家庭资产负债表较金融危机时更为健康，预计本轮经济增长回落幅度不会太大。黄金、白银等商品及美债、美股、新兴市场都有一定机会，适当分散配置仍将起到较好的平衡作用。

债市方面，我们对债市持中性态度。在央行干预下，资金中枢短期难有大幅下行的可能，未来利率或继续处于窄幅波动区间。短期适当降低长久期债券的配置比例，增加有利率波段能力的基金。转债方面，供需格局维持利好，估值性价比仍较高，在调整后可适度超配。

权益方面，在保持定力和高质量发展的前提下，我们认为国内经济在未来较长时间内都是结构性复苏，对应行情也将是结构性的。长期来看，在存量市场下，偏质量、龙头属性的资产有望持续跑赢。中短期配置结构上重点关注以下方向：1) 经济弱复苏阶段，在组合保持相对均衡前提下，保持科技和红利的哑铃策略，包括港股互联网和港股红利；2) 选取基本面改善、景气度较高的方向，特别是盈利稳定、经营现金流较好的质量风格，相关板块包括公用事业、交运、造船、周期资源品、出口链和半导体等。3) 卫星仓位阶段性增持具有弹性的核心资产和新质生产力中调整幅度较大的主题方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，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

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国泰君安善怡稳健六

个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律、法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。中国邮政储蓄银行股份有限公司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，中国邮政储蓄银行股份有限公司在履行托管职责中，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律、法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 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：国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|----------------------|-----------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 628,794.62 | 1,189,569.83 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 9,585,711.26 | 8,848,789.65 |
| 其中：股票投资 | | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|-----------------------------|------------------------------|
| 基金投资 | | 9,585,711.26 | 8,848,789.65 |
| 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | 1,207.19 |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.4 | 192.22 | 1.11 |
| 资产总计 | | 10,214,698.10 | 10,039,567.78 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 | 上年度末 2023 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 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 3,369.78 | 3,015.25 |

| | | | |
|-------------|---------|---------------|---------------|
| 应付托管费 | | 827.54 | 630.19 |
| 应付销售服务费 | | 500.11 | 378.27 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 178.65 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.5 | 12,432.42 | - |
| 负债合计 | | 17,308.50 | 4,023.71 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.6 | 10,009,000.00 | 10,009,000.00 |
| 未分配利润 | 6.4.7.7 | 188,389.60 | 26,544.07 |
| 净资产合计 | | 10,197,389.60 | 10,035,544.07 |
| 负债和净资产总计 | | 10,214,698.10 | 10,039,567.78 |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 10,009,000.00 份。其中国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)A 基金份额净值 1.0192 元，基金份额总额 8,009,000.00 份；国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)C 基金份额净值 1.0175 元，基金份额总额 2,000,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|-----------|---------|--|
| 一、营业总收入 | | 203,681.95 |
| 1. 利息收入 | | 1,283.85 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.8 | 1,283.85 |
| 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 | | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 89,016.33 |
| 其中：股票投资收益 | | - |
| 基金投资收益 | 6.4.7.9 | 18,180.50 |
| 债券投资收益 | | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - |
| 贵金属投资收益 | | - |
| 衍生工具收益 | | - |
| 股利收益 | 6.4.7.10 | 70,835.83 |
| 其他投资收益 | | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.11 | 113,190.66 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.12 | 191.11 |
| 减：二、营业总支出 | | 41,836.42 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 21,405.71 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 4,984.15 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 3,014.14 |
| 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 | | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.14 | 12,432.42 |

| | | |
|---------------------|--|------------|
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 161,845.53 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 161,845.53 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - |
| 六、综合收益总额 | | 161,845.53 |

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 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 | 10,009,000.00 | 26,544.07 | 10,035,544.07 |
| 二、本期期初净资产 | 10,009,000.00 | 26,544.07 | 10,035,544.07 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | - | 161,845.53 | 161,845.53 |
| （一）、综合收益总额 | - | 161,845.53 | 161,845.53 |
| （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） | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| （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 | 10,009,000.00 | 188,389.60 | 10,197,389.60 |

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：

| | | |
|----------|-----------|---------|
| 陶耿 | 陶耿 | 茹建江 |
| ----- | ----- | ----- |
| 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

国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2023] 1742 号《关于准予国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）注册的批复》核准，由上海国泰君安证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 10,009,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字(2023)第 0624 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）基金合同》于 2023 年 12 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,009,000.00 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

本基金对于每份基金份额设置六个月的最短持有期，在最短持有期内基金份额持有人不能提出赎回申请，最短持有期届满后可以提出赎回申请。根据《国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）基金合同》，本基金根据所收取费用的差异，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购费用、申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的份额类别，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购时不收取认购费用、申购费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的份额类别，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）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 基金和香港互认基金），国内依法发行上市的股票（包括创业板以及其他依法上市的股票，存托凭证），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，公开发行的次级债券，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。本基金投资于经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，投资于债券型证券投资基金（包括债券指数基金）的比例不低于本基金资产的 80%；投资于 QDII 基金和香港互认基金的比例合计不超过基金资产的 20%。本基金投资于货币市场基金的资产占基金资产的比例不高于 15%。本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中债新综合指数（财富）收益率*90%+中证 800 指数收益率*10%。

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》、《国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以

公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

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

(2) 金融负债

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金

融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金

额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、基金投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

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

（3）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外），按照中证指数有限公司所独

立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

(4)对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引(试行)〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》，按采用如下方法估值：(A)对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；(b)对于境内上市开放式基金(LOF)及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；(c)对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份(百份)收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益；(d)对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份收益计提估值日基金收益。如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：(A)以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值；(b)以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值；(c)如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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》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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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 2024 年 06 月 30 日 |
|--------|----------------------|
| 活期存款 | 198,118.11 |
| 等于：本金 | 198,079.67 |
| 加：应计利息 | 38.44 |
| 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 | 430,676.51 |
| 等于：本金 | 430,652.61 |
| 加：应计利息 | 23.90 |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 628,794.62 |

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 2024 年 06 月 30 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 | 9,450,341.74 | - | 9,585,711.26 | 135,369.52 |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 9,450,341.74 | - | 9,585,711.26 | 135,369.52 |

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 |
|------|----------------------|
| 应收利息 | - |

| | |
|-------|--------|
| 其他应收款 | 192.22 |
| 待摊费用 | - |
| 合计 | 192.22 |

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 |
|-------------|----------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | - |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提审计费 | 12,432.42 |
| 合计 | 12,432.42 |

6.4.7.6 实收基金

国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|--------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 8,009,000.00 | 8,009,000.00 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 8,009,000.00 | 8,009,000.00 |

国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|--------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 2,000,000.00 | 2,000,000.00 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 2,000,000.00 | 2,000,000.00 |

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

国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(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 | 3,938.65 | 17,604.69 | 21,543.34 |
| 本期期初 | 3,938.65 | 17,604.69 | 21,543.34 |
| 本期利润 | 41,353.87 | 90,587.26 | 131,941.13 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 45,292.52 | 108,191.95 | 153,484.47 |

国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(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 | 605.21 | 4,395.52 | 5,000.73 |
| 本期期初 | 605.21 | 4,395.52 | 5,000.73 |
| 本期利润 | 7,301.00 | 22,603.40 | 29,904.40 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 7,906.21 | 26,998.92 | 34,905.13 |

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 794.59 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | 489.26 |
| 结算备付金利息收入 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 1,283.85 |

6.4.7.9 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额 | 2,723,080.24 |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 2,703,535.22 |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增 | - |

| | |
|--------|-----------|
| 值税额 | |
| 减：交易费用 | 1,364.52 |
| 基金投资收益 | 18,180.50 |

6.4.7.10 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 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 | 70,835.83 |
| 合计 | 70,835.83 |

6.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 113,369.31 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | 113,369.31 |
| ——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 | 178.65 |
| 合计 | 113,190.66 |

6.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | - |
| 销售服务费返还收入 | 191.11 |
| 合计 | 191.11 |

6.4.7.13 持有基金产生的费用

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

| | |
|----------------------|-----------|
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 653.13 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 14,636.83 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 4,314.58 |

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。

6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 12,432.42 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 合计 | 12,432.42 |

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 |
|------------------|---------|
| 上海国泰君安证券资产管理有限公司 | 基金管理人 |

| | |
|--------------------------------|----------|
| (以下简称“国泰君安资管”) | |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称“中国邮政储蓄银行”) | 基金托管人 |
| 国泰君安证券股份有限公司(以下简称“国泰君安证券”) | 基金管理人的股东 |

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

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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 | |
|--------------|---------------------------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 69,860.00 | 100.00% |

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 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 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 7.68 | 100.00% | 0.00 | 0.00% |

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 21,405.71 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 0.00 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 21,405.71 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提，但本基金投资于基金管理人所管理的其他基金的部分不收取管理费。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,984.15 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 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：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 | | |
|----------------|---------------------------------------|---------------------------|----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起 (FOF) A | 国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起 (FOF) C | 合计 |
| 国君资管直销 | - | 3,013.74 | 3,013.74 |
| 合计 | - | 3,013.74 | 3,013.74 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)A

份额单位：份

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|----------------------------------|---------------------------------------|
| 基金合同生效日（2023 年 12 月 08 日）持有的基金份额 | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 8,009,000.00 |
| 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 | 8,009,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 100.00% |

国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)C

份额单位：份

| 项目 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|----------------------------------|---------------------------------------|
| 基金合同生效日（2023 年 12 月 08 日）持有的基金份额 | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 2,000,000.00 |
| 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 | 2,000,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 100.00% |

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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 | |
|----------------|---------------------------------------|--------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 198,118.11 | 794.59 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 430,676.51 | 489.26 |

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄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君安证券保管，按协议约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有基金管理人国泰君安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 2,428,502.67 元，占本基金资产净值的比例为 23.81%（2023 年 12 月 31 日，本基金持有基金管理人国泰君安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 1,456,802.64 元，占本基金资产净值的比例为 14.52%。）

6.4.10.7.2 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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 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） | - |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 190.82 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 2,987.14 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 650.25 |
| 当期交易基金产生的交易费（元） | - |

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款存放在本基金的托管行中国邮政储蓄银行股份有限公司，其他银行存款为国泰君安证券券商保证金，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。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2023 年 12 月 31 日：本基金未持有信用类债券）。

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在基金最短持有到期日起（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 2024 年 6 月 30 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。

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上市，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 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。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。

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等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2024 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 | 628,794.62 | - | - | - | 628,794.62 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 9,585,711.26 | 9,585,711.26 |
| 其他资产 | - | - | - | 192.22 | 192.22 |
| 资产总计 | 628,794.62 | - | - | 9,585,903.48 | 10,214,698.10 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 3,369.78 | 3,369.78 |
| 应付托管费 | - | - | - | 827.54 | 827.54 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 500.11 | 500.11 |
| 应交税费 | - | - | - | 178.65 | 178.65 |
| 其他负债 | - | - | - | 12,432.42 | 12,432.42 |
| 负债总计 | - | - | - | 17,308.50 | 17,308.50 |
| 利率敏感度缺 | 628,794.62 | - | - | 9,568,594.98 | 10,197,389.6 |

| 口 | | | | | 0 |
|-----------------------------|--------------|-------|-------|--------------|---------------|
| 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 1,189,569.83 | - | - | - | 1,189,569.83 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 8,848,789.65 | 8,848,789.65 |
| 应收股利 | - | - | - | 1,207.19 | 1,207.19 |
| 其他资产 | - | - | - | 1.11 | 1.11 |
| 资产总计 | 1,189,569.83 | - | - | 8,849,997.95 | 10,039,567.78 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 3,015.25 | 3,015.25 |
| 应付托管费 | - | - | - | 630.19 | 630.19 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 378.27 | 378.27 |
| 负债总计 | - | - | - | 4,023.71 | 4,023.71 |
| 利率敏感度缺口 | 1,189,569.83 | - | - | 8,845,974.24 | 10,035,544.07 |

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

于 2024 年 06 月 30 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% (2023 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 (2023 年 12 月 31 日: 同)。

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。

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 2024 年 06 月 30 日 | | 上年度末 2023 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 | 9,585,711.26 | 94.00 | 8,848,789.65 | 88.17 |
| 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 | 9,585,711.26 | 94.00 | 8,848,789.65 | 88.17 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2024 年 06 月 30 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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 2024 年 06 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------------|-----------------------|
|---------------|----------------------|-----------------------|

| | | |
|------|--------------|--------------|
| 第一层次 | 9,585,711.26 | 8,848,789.65 |
| 第二层次 | - | - |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 9,585,711.26 | 8,848,789.65 |

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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 9,585,711.26 | 93.84 |
| 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 | 628,794.62 | 6.16 |
| 8 | 其他各项资产 | 192.22 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 10,214,698.10 | 100.00 |

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未进行股票投资。

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

本基金本报告期末未进行股票投资。

7.4.3 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。

7.5 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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 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。

7.12.2 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 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方 | 持有份额 | 公允价值 | 占基金 | 是否属于基 |
|---|------|------|-----|------|------|-----|-------|
|---|------|------|-----|------|------|-----|-------|

| 号 | | | 式 | (份) | (元) | 资产净 值比例 (%) | 金管理人及 管理人关联 方所管理的 基金 |
|----|--------|-------------------------------|------------|----------------|----------------|-------------------|-------------------------------|
| 1 | 952001 | 国泰君安 君得利短 债 A | 契约型 开放式 | 715,468.1 9 | 752,672.5 4 | 7.38 | 是 |
| 2 | 013281 | 国泰君安 30 天滚动 持有中短 债 A | 契约型 开放式 | 601,330.3 7 | 661,403.2 7 | 6.49 | 是 |
| 3 | 008207 | 国泰合融 纯债债券 A | 契约型 开放式 | 418,548.3 1 | 462,621.4 5 | 4.54 | 否 |
| 4 | 015809 | 国泰君安 君添利中 短债发起 A | 契约型 开放式 | 429,621.2 5 | 462,186.5 4 | 4.53 | 是 |
| 5 | 530021 | 建信纯债 债券 A | 契约型 开放式 | 283,255.8 2 | 461,282.1 0 | 4.52 | 否 |
| 6 | 270044 | 广发双债 添利债券 A | 契约型 开放式 | 373,208.1 0 | 460,613.4 4 | 4.52 | 否 |
| 7 | 003949 | 兴全稳泰 债券 A | 契约型 开放式 | 390,899.7 4 | 460,597.1 6 | 4.52 | 否 |
| 8 | 003847 | 华安鼎丰 债券发起 式 A | 契约型 开放式 | 396,228.6 7 | 459,902.6 2 | 4.51 | 是 |
| 9 | 003265 | 招商招坤 纯债 A | 契约型 开放式 | 345,160.2 7 | 459,477.3 5 | 4.51 | 否 |
| 10 | 700006 | 平安添利 债券 C | 契约型 开放式 | 406,863.6 1 | 459,145.5 8 | 4.50 | 否 |
| 11 | 008204 | 交银稳利 中短债债 券 A | 契约型 开放式 | 397,936.4 2 | 457,825.8 5 | 4.49 | 否 |
| 12 | 003078 | 泰康安惠 纯债债券 A | 契约型 开放式 | 386,533.8 0 | 455,646.0 4 | 4.47 | 否 |
| 13 | 590009 | 中邮稳定 收益债券 A | 契约型 开放式 | 409,634.5 6 | 455,513.6 3 | 4.47 | 否 |
| 14 | 100066 | 富国纯债 债券发起 式 A/B | 契约型 开放式 | 404,534.6 7 | 454,899.2 4 | 4.46 | 否 |
| 15 | 006989 | 建信中短 债纯债债 券 A | 契约型 开放式 | 429,504.5 1 | 453,728.5 6 | 4.45 | 否 |
| 16 | 270048 | 广发纯债 债券 A | 契约型 开放式 | 363,316.3 3 | 453,382.4 5 | 4.45 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|---|------------|----------------|----------------|------|---|
| 17 | 010092 | 永赢华嘉 信用债 A | 契约型 开放式 | 387,587.1 4 | 449,872.3 9 | 4.41 | 否 |
| 18 | 004388 | 鹏华丰享 债券 | 契约型 开放式 | 330,918.7 8 | 408,122.1 3 | 4.00 | 否 |
| 19 | 007562 | 景顺长城 景泰纯利 债券 A | 契约型 开放式 | 268,680.6 7 | 304,092.7 8 | 2.98 | 否 |
| 20 | 110007 | 易方达稳 健收益债 券 A | 契约型 开放式 | 151,538.4 2 | 202,819.0 2 | 1.99 | 否 |
| 21 | 007360 | 易方达中 短期美元 债债券 (QDII)A(人民币份 额) | 契约型 开放式 | 108,106.8 2 | 121,749.9 0 | 1.19 | 否 |
| 22 | 100050 | 富国全球 债券 (QDII)人 民币 A | 契约型 开放式 | 77,158.35 | 100,483.3 2 | 0.99 | 否 |
| 23 | 018963 | 国泰君安 量化选股 混合发起 D | 契约型 开放式 | 100,030.0 1 | 92,337.70 | 0.91 | 是 |
| 24 | 159937 | 博时黄金 ETF | 契约型 开放式 | 12,700.00 | 67,233.80 | 0.66 | 否 |
| 25 | 512200 | 南方中证 全指房地 产 ETF | 契约型 开放式 | 19,200.00 | 8,102.40 | 0.08 | 否 |

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.13.2 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。

7.13.3 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 | - |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | 192.22 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 192.22 |

7.13.4 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。

7.13.5 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。

§ 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 |
| 国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)A | 1 | 8,009,000.00 | 8,009,000.00 | 100.00% | 0.00 | 0.00% |
| 国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)C | 1 | 2,000,000.00 | 2,000,000.00 | 100.00% | 0.00 | 0.00% |
| 合计 | 2 | 5,004,500.00 | 10,009,000.00 | 100.00% | 0.00 | 0.00% |

| | | | | | |
|--|--|---|---|--|--|
| | | 0 | 0 | | |
|--|--|---|---|--|--|

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

本报告期末本公司所有从业人员均未持有本基金份额。

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 | 国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)A | 0 |
| | 国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)A | 0 |
| | 国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)C | 0 |
| | 合计 | 0 |

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人以及本基金基金经理均未持有本基金份额。

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 | 10,009,000.00 | 100.00% | 10,009,000.00 | 100.00% | 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 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,009,000.00 | 100.00% | 10,009,000.00 | 100.00% | - |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)A | 国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)C |
|---------------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 基金合同生效日（2023 年 12 月 08 日）基金份额总额 | 8,009,000.00 | 2,000,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 8,009,000.00 | 2,000,000.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | - | - |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | - | - |
| 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 | 8,009,000.00 | 2,000,000.00 |

§ 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：

2024 年 2 月 28 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高级管理人员变更公告》。自 2024 年 2 月 26 日起叶明同志代为履行公司首席信息官，朱晓力同志不再担任公司首席信息官职务。

2024 年 3 月 20 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》。自 2024 年 3 月 18 日起陶耿同志兼任公司财务负责人，叶明同志不再兼任公司财务负责人职务。

2024 年 3 月 20 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》。自 2024 年 3 月 18 日起吕巍同志兼任公司首席风险官，叶明同志不再兼任公司首席风险官职务。

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。

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金无涉及托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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 | |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 2 | - | - | 7.68 | 100.00% | - |

10.8.2 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 | 成交金额 | 占当期债券回 | 成交金额 | 占当期权证成 | 成交金额 | 占当期基金成 |

| | | 交总额的 比例 | | 购成交 总额的 比例 | | 交总额的 比例 | | 交总额的 比例 |
|----------------------|---|------------|---|------------------|---|------------|---------------|------------|
| 国泰君安 证券股份 有限公司 | - | - | - | - | - | - | 69,860.0 0 | 100.00% |

10.9 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 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司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 | 2024-02-28 |
| 2 | 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 | 2024-03-20 |
| 3 | 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 | 2024-03-20 |
| 4 | 国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）2024 年第 1 季度报告 | 证监会指定网站、公司官网 | 2024-04-22 |
| 5 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2024 年第 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 | 2024-04-22 |
| 6 | 国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）开放日常申购、赎回和定期定额投资业务的公告 | 上海证券报、证监会指定网站、公司官网 | 2024-06-11 |
| 7 | 国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）（A 类份额）基金产品资料概要 | 证监会指定网站、公司官网 | 2024-06-28 |
| 8 | 国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）（C 类份额）基金产品资料概要 | 证监会指定网站、公司官网 | 2024-06-28 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|--|----------------|-------------------------|---------------|------|------|---------------|---------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20240101-20240630 | 10,009,000.00 | - | - | 10,009,000.00 | 100.00% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>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：</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；</p> <p>(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；</p> <p>(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p> | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）募集注册的文件；

- 2、《国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）托管协议》；
- 4、《国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（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。

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
<http://www.gtjazg.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。

上海国泰君安证券资产管理有限公司
二〇二四年八月三十日