

# 国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金

## 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:招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08月28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02月06日起至2024年06月30日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>6</b>
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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

<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b> .....	<b>15</b>
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
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	43
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 .....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	52
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 .....	52
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 .....	53
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 .....	53
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 .....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
7.12 投资组合报告附注 .....	54

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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 .....	57
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	57
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>58</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
10.4 基金投资策略的改变 .....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
10.8 其他重大事件.....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>61</b>
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.....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>61</b>
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金	
基金简称	国泰君安稳债增利债券发起	
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	上海国泰君安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	332,626,821.34 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安稳债增利债券发起 A	国泰君安稳债增利债券发起 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	179,884,696.78 份	152,742,124.56 份

### 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×88%+中证 500 指数收益率×6%+中证 1000 指数收益率×6%
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		上海国泰君安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	021-38676022	400-61-95555
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.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	上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	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 02 月 06 日（基金合同生效日）-2024 年 06 月 30 日）	
	国泰君安稳债增利债券发起 A	国泰君安稳债增利债券发起 C
本期已实现收益	2,581,881.91	3,279,739.88
本期利润	3,029,224.14	4,124,667.35
加权平均基金份额本期利润	0.0088	0.0090
本期加权平均净值利润率	0.87%	0.89%
本期基金份额净值增长率	0.62%	0.46%
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	941,304.91	550,701.93
期末可供分配基金份额利润	0.0052	0.0036
期末基金资产净值	181,001,289.07	153,438,649.50
期末基金份额净值	1.0062	1.0046
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	0.62%	0.46%
-------------	-------	-------

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

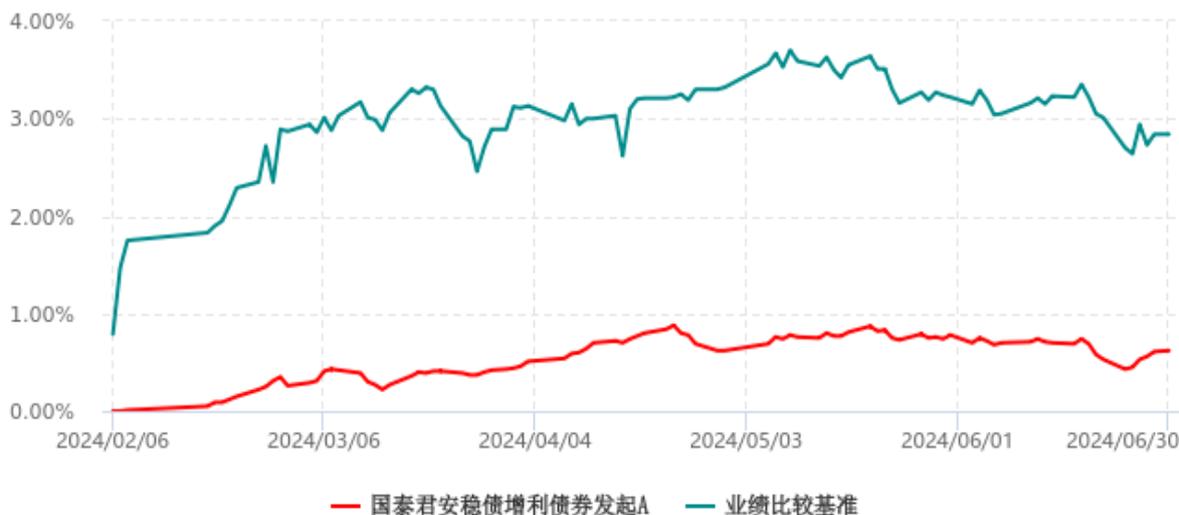
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.16%	0.05%	-0.37%	0.14%	0.21%	-0.09%
过去三个月	0.19%	0.05%	-0.05%	0.14%	0.24%	-0.09%
自基金合同生效起至今	0.62%	0.04%	2.84%	0.19%	-2.22%	-0.15%

##### 国泰君安稳债增利债券发起 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
过去一个月	-0.19%	0.05%	-0.37%	0.14%	0.18%	-0.09%
过去三个月	0.09%	0.05%	-0.05%	0.14%	0.14%	-0.09%
自基金合同生效起至今	0.46%	0.04%	2.84%	0.19%	-2.38%	-0.15%

#### 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-2024年06月30日)



注：1、本基金于 2024 年 02 月 06 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，截止本报告期末基金成立未满六个月。

国泰君安稳债增利债券发起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-2024年06月30日)



注：1、本基金于 2024 年 02 月 06 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，截止本报告期末基金成立未满六个月。

#### § 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、国泰君安君得利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		
胡崇海	国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安稳债增利	2024-02-06	-	13 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。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。

	债券型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。				
朱莹	国泰君安 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安安弘六个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，国泰君安安平一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安君得盛债券型证券投资基金基金经理，国泰君安安裕纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，国泰君安君增利 60 天滚动持有债券型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金基金经理，国泰君安债增利债券型发起式证券投资基金基金经理。现任固定收益投资部（公募）基金经理。	2024-02-06	-	4 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，现任公司固定收益投资部（公募）基金经理，主要从事债券投资研究工作。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

## 4.3 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% 的次數为 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

基本面从上半年数据看，整体呈现一季度较好二季度回落的趋势，总体保持平稳运行。但从结构上来看宏观基本面呈分化状态，外需有支撑而国内有效需求不足。地产仍然偏弱，4 月政治局会议之后虽出台一系列稳地产政策，但效果比较有限，居民信贷需求疲软。货币政策维持稳健，央行在 2 月降准 50bp，银行间流动性合理充裕。财政政策方面，明确了特别国债的发行规模和节奏，但地方债的发行上半年偏慢。债券市场上半年大幅走牛，一季度以 30 年国债为代表的长债利率大幅下行，二季度在央行频繁提示长债风险的情况下，长债利率先上后下，信用债在二季度央行禁止“手工补息”带来的“存款搬家”效应下收益率下行，信用利差创历史新低。上半年，市场风险偏好降至冰点，投资者在不确定性笼罩下寻求避风港，红利及大型垄断性国企成为资金青睐的对象，展现出显著的超额收益。这不仅反映了投资者对确定性资产的强烈需求，也揭示了市场在动荡时期的价值回归趋势。同时，今年两市跑赢沪深 300 指数的公司不足 15%，而跑赢中证 500 的公司也不到 1/4，整体市场平均涨跌幅超过 20%，显示出明显的亏钱效应，这对以分散化持股为主要投资风格的量化策略并不友好。

报告期内本产品严格按照投资目标和投资范围，纯债方面主要投资于高等级信用债，保持一定的杠杆水平，阶段性参与利率债交易机会，实现账户的稳健增值。权益方面自五月以来，鉴于海外资金对中国资产配置兴趣的增强以及财报季后业绩不确定性的减弱，本基金适时小幅增加了权益类资产的配置。然而，市场从五月下旬开始在强监管与经济基本面疲软的双重压力下出现超预期调整，尤其是对中小市值公司财务状况的担忧加剧了对业绩稳定公司资产的集中追捧，管理人从提升投资者持有体验的角度又适时优化了大类资产配置，在市场波动较大期间严格控制了股票投资的头寸。本基金的股票投资部分采用了量化投资组合进行配置，以全市场最大化 Alpha 为目标，均衡配

置大中小市值股票。鉴于今年市场环境的复杂性，我们特别重视提升业绩稳定性，从投研的角度重点强化了中证 800 成分股内的 Alpha 挖掘能力，并适时增加了中证 800 内股票的持仓比例。可转债方面，中证转债指数 2024 年上半年下跌 0.07%，可转债经历了一波跟随权益的 V 型走势，在二季度转债又表现出整体明显强于股市的状态。报告期内，本基金通过少量而分散的转债组合积极参与权益市场的修复行情，6 月份受到转债正股走弱和信用冲击的双重影响盈利有所回吐。我们适时地调整了转债部分的持仓结构，提升了转债组合中高等级绩优品种的占比，减少转债尾部风险暴露。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安稳债增利债券发起 A 基金份额净值为 1.0062 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.62%，同期业绩比较基准收益率为 2.84%；截至报告期末国泰君安稳债增利债券发起 C 基金份额净值为 1.0046 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.46%，同期业绩比较基准收益率为 2.84%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前外部环境变化带来的不利影响增多，国内有效需求不足，经济运行出现分化。三中全会上强调今年要坚定不移完成全年经济社会发展目标任务，这意味着下半年需要出台更多更有效的稳增长政策。稳健的货币政策将继续为债券牛市创造稳定的背景，财政政策的发力情况或将对债券市场造成阶段性的扰动，尤其是在季末等时点市场波动存在放大的可能性。外部环境的变化对于政策的实施节奏也会造成一定影响。在低利率和低利差的环境下，债券市场的盈利空间和策略实施难度加大，下半年债券投资预期收益料难以复制上半年的行情，但久期的摆布对于业绩提升仍然具有重要意义。

监管层面对股票市场的非常态波动采取了积极行动，“国九条”的实施与打击财务造假举措的不断推进，短期内对中小市值公司确实造成一定情绪面的冲击，但长远来看，这些措施犹如“刮骨疗伤”，短期的阵痛反而有利于资本市场中长期的健康发展，在提升上市公司质量和注重投资者回报的同时，为投资者创造更加透明和公平的投资环境。审视当下的行情，诚然目前市场依然处于风险偏好较低的缩量博弈阶段，市场信心的恢复尚需时日，但是我们认为大多数股票的市场化“出清”较为彻底，过去多年的下跌对当下复杂经济环境和国际政治形势的估值消化已经较为充分，“磨底”的煎熬并不妨碍我们对于下半年主要股票宽基指数的行情变得积极乐观起来。风格上来看，2019 年以来纯粹的价值因子回报率经历了先抑后扬的过山车行情，目前已经修正到 2018 年底的位置，价值股在 2019 年和 2020 年景气度投资期间的压抑在之后的三年半时间里彻底逆转，而当下的成长股投资则进入了“至暗时刻”。我们认为，上半年的大盘价值股独领风骚的行情体现了市场极致的低风险偏好，但是历史来看价值和成长两种基本对立的投资风格在财政货币政策和经济环境等多重因素的影响下体现出很强的周期属性，在这两种风格各自走出极致行情期间往往伴随着令众人折服的“宏大叙事”和越来越小范围的“机构抱团”。当下值得关注的是，随着美元降息预期提升、“科创板八条”和创新药等行业性支持政策以及二十届三中全会深化科技体制改革举措的逐

步落地均有望提升成长股的投资情绪，而成长股的复苏一般可以有效带动市场情绪回暖，中小盘股的相对劣势也有望同步得到改善。

展望未来，管理人将通过不断提升投研能力，加强管理人内部的沟通协调，继续密切关注各类资产的市场变化，通过优化大类资产配置来灵活调整本基金的股票投资比例，耐心等待股票端 Alpha 和 Beta 的双重催化，并通过量化投资的方式来捕捉股票市场上涨带来的业绩增厚，致力于为投资者创造稳健且可持续的回报。可转债方面多项估值指标均指向可转债当前定价水平处于历史上性价比相对较高的阶段，但股票市场向上的动能和空间较为有限，转债市场对于信用风险的担忧也仍将持续并深远地影响转债的弹性表现。下半年转债投资机会可能更多来自于对前期错杀的部分偏债和平衡型转债的重新定价，在排除正股退市风险等实质性信用瑕疵后，把握长久期转债转股期权的估值修复机会。

#### 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

招商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，招商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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行股份有限公司根据法律法规、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。

招商银行股份有限公司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：国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
货币资金	6.4.7.1	15,444,671.87
结算备付金		19,469,467.01
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	412,203,373.02
其中：股票投资		6,917,130.08
基金投资		-
债券投资		405,286,242.94
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		61,788.48
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.4	-
资产总计		447,179,300.38
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 06 月 30 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		100,023,013.70
应付清算款		-
应付赎回款		12,275,920.06
应付管理人报酬		196,911.61
应付托管费		49,227.90
应付销售服务费		60,081.27
应付投资顾问费		-
应交税费		17,658.53
应付利润		-
递延所得税负债		-

其他负债	6.4.7.5	116,548.74
负债合计		112,739,361.81
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.6	332,626,821.34
未分配利润	6.4.7.7	1,813,117.23
净资产合计		334,439,938.57
负债和净资产总计		447,179,300.38

注：1、报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 332,626,821.34 份。其中国泰君安稳债增利债券发起 A 基金份额净值 1.0062 元，基金份额总额 179,884,696.78 份；国泰君安稳债增利债券发起 C 基金份额净值 1.0046 元，基金份额总额 152,742,124.56 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2024 年 2 月 6 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日止期间。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		10,763,245.48
1. 利息收入		902,446.65
其中：存款利息收入	6.4.7.8	376,573.63
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		525,873.02
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,549,351.27
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-1,492,726.67
基金投资收益		-

债券投资收益	6.4.7.10	10,700,483.92
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.11	-810,340.55
股利收益	6.4.7.12	151,934.57
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	1,292,269.70
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	19,177.86
<b>减：二、营业总支出</b>		3,609,353.99
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,945,375.66
2. 托管费	6.4.10.2.2	486,343.93
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	740,624.13
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		326,514.53
其中：卖出回购金融资产支出		326,514.53
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		8,074.67
8. 其他费用	6.4.7.15	102,421.07
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		7,153,891.49
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		7,153,891.49
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		7,153,891.49

注：本基金合同生效日为 2024 年 2 月 6 日，无上年度同期对比数据。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	1,092,780,838.40	-	1,092,780,838.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-760,154,017.06	1,813,117.23	-758,340,899.83
（一）、综合收益总额	-	7,153,891.49	7,153,891.49
（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）	-760,154,017.06	-5,340,774.26	-765,494,791.32
其中：1. 基金申购款	89,540,957.42	617,771.88	90,158,729.30
2. 基金赎回款	-849,694,974.48	-5,958,546.14	-855,653,520.62
（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	332,626,821.34	1,813,117.23	334,439,938.57

注：本基金合同生效日为 2024 年 2 月 6 日，无上年度同期对比数据。

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

国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金(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] 2565 号《关于准予国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金注册的批复》注册，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《国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，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 1,092,161,669.75 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(2024)第 0044 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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，基金合同生效日的基金份额总额为 1,092,780,838.40

份基金份额，认购资金利息折合基金份额为 619,168.65 元。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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,009,450.45 基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金基金合同》，本基金根据认购费用、申购费用、销售服务费等收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购基金时收取认购费、申购费，而不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购、申购基金时不收取认购费、申购费，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安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。如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，待履行适当程序后，以变更后的规定为准。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》、《国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列表的中国证监会、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 02 月 06 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 02 月 06 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。本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 02 月 06 日(基金合同生效日)至 2024 年 06 月 30 日。

#### 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商业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商业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和资产支持证

券投资，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。

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

#### 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、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。

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。

#### 6.4.5 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[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，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 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	14,500,854.16
等于：本金	14,499,807.34
加：应计利息	1,046.82
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	943,817.71
等于：本金	943,502.98
加：应计利息	314.73
减：坏账准备	-
合计	15,444,671.87

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	7,193,265.08	-	6,917,130.08	-276,135.00	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,945,437.74	9,970.54	2,972,074.29	16,666.01
	银行间市场	396,132,261.31	4,630,168.65	402,314,168.65	1,551,738.69
	合计	399,077,699.05	4,640,139.19	405,286,242.94	1,568,404.70
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	406,270,964.13	4,640,139.19	412,203,373.02	1,292,269.70	

#### 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 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	32,035.38
其中：交易所市场	-
银行间市场	32,035.38
应付利息	-
预提信息披露费	53,091.44
预提审计费	22,121.92
预提账户维护费	9,300.00
合计	116,548.74

6.4.7.6 实收基金

国泰君安稳债增利债券发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	439,046,412.99	439,046,412.99
本期申购	42,622,362.42	42,622,362.42
本期赎回（以“-”号填列）	-301,784,078.63	-301,784,078.63
本期末	179,884,696.78	179,884,696.78

国泰君安稳债增利债券发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	653,734,425.41	653,734,425.41
本期申购	46,918,595.00	46,918,595.00

本期赎回（以“-”号填列）	-547,910,895.85	-547,910,895.85
本期末	152,742,124.56	152,742,124.56

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	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,581,881.91	447,342.23	3,029,224.14
本期基金份额交易产生的变动数	-1,640,577.00	-272,054.85	-
			1,912,631.85
其中：基金申购款	321,448.56	-2,312.89	319,135.67
基金赎回款	-1,962,025.56	-269,741.96	-
			2,231,767.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	941,304.91	175,287.38	1,116,592.29

##### 国泰君安稳债增利债券发起 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	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,279,739.88	844,927.47	4,124,667.35
本期基金份额交易产生的变动数	-2,729,037.95	-699,104.46	-
			3,428,142.41
其中：基金申购款	285,160.77	13,475.44	298,636.21
基金赎回款	-3,014,198.72	-712,579.90	-
			3,726,778.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	550,701.93	145,823.01	696,524.94

#### 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	80,378.07
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	16,388.00
结算备付金利息收入	279,807.56
其他	-
合计	376,573.63

#### 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 2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	82,287,915.69
减：卖出股票成本总额	83,476,894.89
减：交易费用	303,747.47
买卖股票差价收入	-1,492,726.67

#### 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 2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	7,896,993.91
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,803,490.01
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	10,700,483.92

##### 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 2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,822,004,247.66
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,784,223,591.69
减：应计利息总额	34,934,216.81
减：交易费用	42,949.15
买卖债券差价收入	2,803,490.01

#### 6.4.7.11 衍生工具收益

##### 6.4.7.11.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
国债期货投资收益	-808,550.00
减：交易费用	1,790.55
合计	-810,340.55

#### 6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	151,934.57
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	151,934.57

#### 6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,292,269.70
——股票投资	-276,135.00
——债券投资	1,568,404.70
——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	1,292,269.70

#### 6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	19,177.86

合计	19,177.86
----	-----------

#### 6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	22,121.92
信息披露费	53,091.44
证券出借违约金	-
银行汇划费	14,807.71
账户维护费	12,400.00
合计	102,421.07

#### 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 (以下简称“国泰君安资管”)	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、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 2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券	172,958,075.66	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 2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安证券	1,299,691,742.88	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰君安证券	1,190,000,000.00	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 02 月 06 日（基金合同生效日）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	254,078.08	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 02 月 06 日（基金合同生效日） 至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,945,375.66
其中：应支付销售机构的客户维护费	841,121.99
应支付基金管理人的净管理费	1,104,253.67

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 2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日） 至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	486,343.93

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 2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安稳债增利债券 发起 A	国泰君安稳债增利债券 发起 C	合计
国泰君安证券	-	241,740.10	241,740.10
国泰君安资管	-	69,357.13	69,357.13
招商银行	-	403,770.69	403,770.69
合计	-	714,867.92	714,867.92

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

##### 国泰君安稳债增利债券发起 A

份额单位：份

项目	本期 2024 年 02 月 06 日（基金合同生效日） 至 2024 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2024 年 02 月 06 日）持有的基金份额	10,009,450.45
报告期初持有的基金份额	-
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
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.56%

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，本基金本报告期内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 02 月 06 日（基金合同生效日）至 2024 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	14,500,854.16	80,378.07
国泰君安证券	943,817.71	16,388.00

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

本基金本报告期无须做说明的其他关联方交易事项。

#### 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

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 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 2024 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 100,023,013.70 元，是以如下债券作为质押：

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
012384261	23 鄂联投 SCP004	2024-07-01	101.72	300,000	30,514,934.43
102101119	21 九龙江 MTN002(绿色)	2024-07-01	104.17	200,000	20,834,818.63

102281960	22 泉州城建 MTN002A	2024-07-01	103.23	150,000	15,483,862.30
210218	21 国开 18	2024-07-01	102.17	200,000	20,433,590.16
220220	22 国开 20	2024-07-01	105.46	12,000	1,265,515.74
2400002	24 特别国债 02	2024-07-01	102.27	130,000	13,295,145.92
240006	24 付息国债 06	2024-07-01	101.71	30,000	3,051,364.93
2428002	24 平安银行 三农债 01	2024-07-01	102.00	40,000	4,079,986.89
合计				1,062,000	108,959,219.00

#### 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。

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 2024 年 06 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	30,514,934.43
合计	30,514,934.43

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 2024 年 06 月 30 日
AAA	167,064,547.05
AAA 以下	1,285,705.48
未评级	206,421,055.98
合计	374,771,308.51

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、本基金持有的未评级债券包括国债、政策性金融债、中期票据。

#### 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 2024 年 6 月 30 日除卖出回购金融资产款余额中有 100,023,013.70 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期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 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	15,444,671.87	-	-	-	15,444,671.87
结算备付金	19,469,467.01	-	-	-	19,469,467.01
交易性金融资产	114,704,542.44	218,091,484.64	72,490,215.86	6,917,130.08	412,203,373.02
应收申购款	-	-	-	61,788.48	61,788.48
资产总计	149,618,681.32	218,091,484.64	72,490,215.86	6,978,918.56	447,179,300.38
负债					
卖出回购金融资产款	100,023,013.70	-	-	-	100,023,013.70
应付赎回款	-	-	-	12,275,920.06	12,275,920.06
应付管理人报酬	-	-	-	196,911.61	196,911.61
应付托管费	-	-	-	49,227.90	49,227.90
应付销售服务费	-	-	-	60,081.27	60,081.27
应交税费	-	-	-	17,658.53	17,658.53
其他负债	-	-	-	116,548.74	116,548.74
负债总计	100,023,013.70	-	-	12,716,348.11	112,739,361.81
利率敏感度缺口	49,595,667.62	218,091,484.64	72,490,215.86	-5,737,429.55	334,439,938.57

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 2024 年 06 月 30 日
	基准利率点利率增加 0.1%	-1,329,252.33
	基准利率点利率减少 0.1%	1,342,576.46

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 2024 年 06 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	6,917,130.08	2.07
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	6,917,130.08	2.07

#### 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 2.07%,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。

#### 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
第一层次	9,889,204.37
第二层次	402,314,168.65
第三层次	-
合计	412,203,373.02

###### 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	6,917,130.08	1.55
	其中：股票	6,917,130.08	1.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	405,286,242.94	90.63
	其中：债券	405,286,242.94	90.63
	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	34,914,138.88	7.81
8	其他各项资产	61,788.48	0.01
9	合计	447,179,300.38	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

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	17,320.00	0.01
B	采矿业	215,011.00	0.06
C	制造业	4,383,441.36	1.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	436,248.00	0.13
E	建筑业	190,470.60	0.06

F	批发和零售业	73,388.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	127,640.00	0.04
H	住宿和餐饮业	13,585.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	616,159.12	0.18
J	金融业	545,092.00	0.16
K	房地产业	140,643.00	0.04
L	租赁和商务服务业	125,703.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	29,447.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	2,982.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	6,917,130.08	2.07

### 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	600519	贵州茅台	100	146,739.00	0.04
2	601229	上海银行	13,300	96,558.00	0.03
3	601888	中国中免	1,500	93,735.00	0.03
4	300408	三环集团	3,100	90,489.00	0.03
5	600015	华夏银行	14,000	89,600.00	0.03
6	603501	韦尔股份	900	89,433.00	0.03
7	601877	正泰电器	4,500	85,770.00	0.03
8	000930	中粮科技	16,300	81,989.00	0.02
9	000830	鲁西化工	7,000	81,130.00	0.02
10	601669	中国电建	13,800	77,142.00	0.02
11	002241	歌尔股份	3,900	76,089.00	0.02
12	000725	京东方 A	18,100	74,029.00	0.02
13	601633	长城汽车	2,900	73,370.00	0.02
14	600183	生益科技	3,100	65,286.00	0.02
15	002245	蔚蓝锂芯	8,400	65,100.00	0.02
16	600096	云天化	3,200	62,144.00	0.02

17	688088	虹软科技	2,142	61,818.12	0.02
18	002601	龙佰集团	3,300	61,281.00	0.02
19	600596	新安股份	7,900	60,040.00	0.02
20	600406	国电南瑞	2,400	59,904.00	0.02
21	600011	华能国际	6,100	58,682.00	0.02
22	601336	新华保险	1,900	57,057.00	0.02
23	600050	中国联通	11,700	54,990.00	0.02
24	300229	拓尔思	4,000	53,720.00	0.02
25	600489	中金黄金	3,600	53,280.00	0.02
26	000063	中兴通讯	1,900	53,143.00	0.02
27	601668	中国建筑	10,000	53,100.00	0.02
28	603328	依顿电子	6,700	52,662.00	0.02
29	002120	韵达股份	6,800	52,632.00	0.02
30	002422	科伦药业	1,700	51,561.00	0.02
31	600141	兴发集团	2,700	51,516.00	0.02
32	600031	三一重工	3,100	51,150.00	0.02
33	601600	中国铝业	6,600	50,358.00	0.02
34	688586	江航装备	5,404	50,257.20	0.02
35	000738	航发控制	2,500	50,175.00	0.02
36	600027	华电国际	7,200	49,968.00	0.01
37	600048	保利发展	5,700	49,932.00	0.01
38	300034	钢研高纳	3,100	49,259.00	0.01
39	600795	国电电力	8,200	49,118.00	0.01
40	002399	海普瑞	5,600	48,552.00	0.01
41	600602	云赛智联	4,300	47,472.00	0.01
42	300821	东岳硅材	6,900	47,196.00	0.01
43	002423	中粮资本	6,100	45,689.00	0.01
44	688111	金山办公	200	45,500.00	0.01
45	600517	国网英大	10,400	45,032.00	0.01
46	600760	中航沈飞	1,100	44,110.00	0.01
47	600018	上港集团	7,600	43,928.00	0.01
48	600023	浙能电力	6,100	43,371.00	0.01
49	601319	中国人保	8,400	43,260.00	0.01
50	000568	泸州老窖	300	43,047.00	0.01
51	002906	华阳集团	1,600	42,816.00	0.01
52	688249	晶合集成	2,900	42,543.00	0.01
53	600809	山西汾酒	200	42,176.00	0.01
54	600578	京能电力	12,700	41,148.00	0.01
55	000538	云南白药	800	40,920.00	0.01
56	601231	环旭电子	2,400	38,520.00	0.01
57	301260	格力博	2,800	38,136.00	0.01
58	601168	西部矿业	2,100	37,695.00	0.01
59	600699	均胜电子	2,500	37,050.00	0.01

60	000066	中国长城	4,200	36,750.00	0.01
61	601169	北京银行	6,200	36,208.00	0.01
62	603025	大豪科技	2,600	35,932.00	0.01
63	002519	银河电子	7,300	35,843.00	0.01
64	300233	金城医药	2,400	35,808.00	0.01
65	002340	格林美	5,600	35,672.00	0.01
66	300747	锐科激光	2,000	35,500.00	0.01
67	300674	宇信科技	3,200	35,456.00	0.01
68	601016	节能风电	11,800	35,282.00	0.01
69	000913	钱江摩托	2,200	34,672.00	0.01
70	300357	我武生物	1,700	34,374.00	0.01
71	600335	国机汽车	5,900	34,043.00	0.01
72	600021	上海电力	3,400	33,626.00	0.01
73	601186	中国铁建	3,900	33,423.00	0.01
74	600019	宝钢股份	5,000	33,250.00	0.01
75	002046	国机精工	3,200	32,544.00	0.01
76	000960	锡业股份	2,100	32,529.00	0.01
77	001979	招商蛇口	3,700	32,523.00	0.01
78	002020	京新药业	3,100	32,457.00	0.01
79	000060	中金岭南	7,500	31,800.00	0.01
80	002468	申通快递	3,700	31,080.00	0.01
81	300433	蓝思科技	1,700	31,025.00	0.01
82	601225	陕西煤业	1,200	30,924.00	0.01
83	600480	凌云股份	3,100	30,473.00	0.01
84	300634	彩讯股份	1,800	30,294.00	0.01
85	002897	意华股份	800	30,128.00	0.01
86	000636	风华高科	2,300	30,038.00	0.01
87	600325	华发股份	4,600	29,900.00	0.01
88	601216	君正集团	8,100	29,889.00	0.01
89	000786	北新建材	1,000	29,660.00	0.01
90	300725	药石科技	1,100	29,447.00	0.01
91	002449	国星光电	4,100	29,192.00	0.01
92	600559	老白干酒	1,600	29,088.00	0.01
93	002907	华森制药	2,300	29,026.00	0.01
94	603198	迎驾贡酒	500	28,750.00	0.01
95	300442	润泽科技	1,200	28,740.00	0.01
96	601898	中煤能源	2,300	28,704.00	0.01
97	601198	东兴证券	3,600	28,656.00	0.01
98	600765	中航重机	1,400	28,560.00	0.01
99	002284	亚太股份	4,200	28,392.00	0.01
100	600736	苏州高新	6,800	28,288.00	0.01
101	603896	寿仙谷	1,200	28,164.00	0.01
102	688378	奥来德	1,200	28,152.00	0.01

103	300047	天源迪科	4,300	28,122.00	0.01
104	605018	长华集团	3,100	28,086.00	0.01
105	605369	拱东医疗	700	27,930.00	0.01
106	600814	杭州解百	4,700	27,730.00	0.01
107	002100	天康生物	4,000	27,720.00	0.01
108	003021	兆威机电	600	27,690.00	0.01
109	600468	百利电气	6,400	27,584.00	0.01
110	000807	云铝股份	2,000	27,020.00	0.01
111	002185	华天科技	3,300	26,895.00	0.01
112	601390	中国中铁	4,100	26,732.00	0.01
113	688313	仕佳光子	2,800	26,656.00	0.01
114	600886	国投电力	1,400	25,536.00	0.01
115	002106	莱宝高科	2,300	25,070.00	0.01
116	300463	迈克生物	2,200	25,036.00	0.01
117	000157	中联重科	3,200	24,576.00	0.01
118	002536	飞龙股份	2,500	23,800.00	0.01
119	600617	国新能源	9,480	23,700.00	0.01
120	002010	传化智联	5,800	22,272.00	0.01
121	600863	内蒙华电	4,800	22,272.00	0.01
122	300035	中科电气	2,600	22,126.00	0.01
123	688590	新致软件	1,700	21,930.00	0.01
124	688138	清溢光电	1,000	21,500.00	0.01
125	002378	章源钨业	3,700	21,238.00	0.01
126	002001	新和成	1,100	21,120.00	0.01
127	300772	运达股份	2,200	21,120.00	0.01
128	300003	乐普医疗	1,400	20,776.00	0.01
129	300481	濮阳惠成	1,500	20,700.00	0.01
130	603633	徕木股份	2,600	20,566.00	0.01
131	002757	南兴股份	1,700	20,485.00	0.01
132	300396	迪瑞医疗	1,000	20,310.00	0.01
133	603823	百合花	2,100	20,307.00	0.01
134	002539	云图控股	2,800	19,964.00	0.01
135	003816	中国广核	4,300	19,909.00	0.01
136	300973	立高食品	700	19,663.00	0.01
137	603258	电魂网络	1,200	19,380.00	0.01
138	601238	广汽集团	2,500	19,350.00	0.01
139	002179	中航光电	500	19,025.00	0.01
140	600703	三安光电	1,600	18,752.00	0.01
141	601100	恒立液压	400	18,632.00	0.01
142	603517	绝味食品	1,200	18,480.00	0.01
143	000969	安泰科技	2,300	18,239.00	0.01
144	002036	联创电子	2,700	18,225.00	0.01
145	601222	林洋能源	2,900	18,183.00	0.01

146	300278	华昌达	6,300	18,081.00	0.01
147	601991	大唐发电	6,000	18,060.00	0.01
148	002558	巨人网络	1,900	17,936.00	0.01
149	601997	贵阳银行	3,400	17,918.00	0.01
150	000559	万向钱潮	4,000	17,840.00	0.01
151	601881	中国银河	1,600	17,376.00	0.01
152	000630	铜陵有色	4,800	17,328.00	0.01
153	000735	罗牛山	4,000	17,320.00	0.01
154	601698	中国卫通	1,200	16,908.00	0.01
155	002128	电投能源	800	16,880.00	0.01
156	300188	国投智能	1,500	16,665.00	0.00
157	300768	迪普科技	1,400	16,590.00	0.00
158	603203	快克智能	700	16,506.00	0.00
159	603229	奥翔药业	1,600	16,080.00	0.00
160	002534	西子洁能	1,600	16,016.00	0.00
161	300624	万兴科技	300	15,921.00	0.00
162	601628	中国人寿	500	15,525.00	0.00
163	688150	莱特光电	800	15,520.00	0.00
164	603195	公牛集团	200	15,424.00	0.00
165	300403	汉宇集团	2,200	15,026.00	0.00
166	600420	国药现代	1,400	14,952.00	0.00
167	600497	驰宏锌锗	2,800	14,952.00	0.00
168	601688	华泰证券	1,200	14,868.00	0.00
169	600332	白云山	500	14,665.00	0.00
170	000758	中色股份	2,800	14,224.00	0.00
171	600362	江西铜业	600	14,208.00	0.00
172	601615	明阳智能	1,500	14,160.00	0.00
173	603486	科沃斯	300	14,154.00	0.00
174	002206	海利得	3,700	14,134.00	0.00
175	002635	安洁科技	900	13,896.00	0.00
176	300341	麦克奥迪	1,600	13,728.00	0.00
177	300741	华宝股份	900	13,716.00	0.00
178	600562	国睿科技	1,000	13,660.00	0.00
179	600258	首旅酒店	1,100	13,585.00	0.00
180	688233	神工股份	700	13,489.00	0.00
181	301171	易点天下	900	13,230.00	0.00
182	600372	中航机载	1,100	13,167.00	0.00
183	300286	安科瑞	600	12,984.00	0.00
184	600875	东方电气	700	12,915.00	0.00
185	603786	科博达	200	12,830.00	0.00
186	600566	济川药业	400	12,684.00	0.00
187	603308	应流股份	1,000	12,420.00	0.00
188	601636	旗滨集团	1,900	12,255.00	0.00

189	002500	山西证券	2,500	11,750.00	0.00
190	600707	彩虹股份	1,700	11,577.00	0.00
191	600862	中航高科	600	11,268.00	0.00
192	301071	力量钻石	400	11,084.00	0.00
193	603212	赛伍技术	1,000	11,040.00	0.00
194	002249	大洋电机	2,300	10,879.00	0.00
195	002957	科瑞技术	800	10,848.00	0.00
196	603897	长城科技	600	10,530.00	0.00
197	300113	顺网科技	1,000	10,240.00	0.00
198	300088	长信科技	2,100	9,870.00	0.00
199	300482	万孚生物	400	9,760.00	0.00
200	688389	普门科技	600	9,756.00	0.00
201	000776	广发证券	800	9,736.00	0.00
202	002027	分众传媒	1,600	9,696.00	0.00
203	002419	天虹股份	2,300	9,614.00	0.00
204	603806	福斯特	640	9,408.00	0.00
205	002845	同兴达	700	9,254.00	0.00
206	600623	华谊集团	1,600	9,248.00	0.00
207	603658	安图生物	200	9,214.00	0.00
208	002004	华邦健康	2,400	9,120.00	0.00
209	601121	宝地矿业	1,600	9,104.00	0.00
210	688093	世华科技	500	9,085.00	0.00
211	002035	华帝股份	1,400	8,722.00	0.00
212	000987	越秀资本	1,700	8,432.00	0.00
213	300661	圣邦股份	100	8,278.00	0.00
214	600742	一汽富维	1,100	8,195.00	0.00
215	600409	三友化工	1,600	8,032.00	0.00
216	000027	深圳能源	1,100	8,030.00	0.00
217	000050	深天马 A	1,100	8,008.00	0.00
218	300014	亿纬锂能	200	7,984.00	0.00
219	300595	欧普康视	500	7,840.00	0.00
220	300307	慈星股份	1,300	7,735.00	0.00
221	600025	华能水电	700	7,546.00	0.00
222	603496	恒为科技	300	7,335.00	0.00
223	600893	航发动力	200	7,310.00	0.00
224	002642	荣联科技	1,400	7,224.00	0.00
225	300258	精锻科技	800	6,504.00	0.00
226	300349	金卡智能	500	5,960.00	0.00
227	601717	郑煤机	400	5,920.00	0.00
228	600718	东软集团	700	5,789.00	0.00
229	688363	华熙生物	100	5,657.00	0.00
230	300724	捷佳伟创	100	5,401.00	0.00
231	002202	金风科技	800	5,376.00	0.00

232	300193	佳士科技	700	5,194.00	0.00
233	600549	厦门钨业	300	5,175.00	0.00
234	300660	江苏雷利	200	5,104.00	0.00
235	300068	南都电源	600	4,968.00	0.00
236	600219	南山铝业	1,300	4,953.00	0.00
237	603676	卫信康	600	4,806.00	0.00
238	601375	中原证券	1,400	4,774.00	0.00
239	301330	熵基科技	200	4,496.00	0.00
240	688055	龙腾光电	1,400	4,438.00	0.00
241	300048	合康新能	900	4,167.00	0.00
242	600727	鲁北化工	600	3,780.00	0.00
243	601808	中海油服	200	3,440.00	0.00
244	000975	山金国际	200	3,258.00	0.00
245	603305	旭升集团	300	3,168.00	0.00
246	300291	百纳千成	700	2,982.00	0.00
247	002841	视源股份	100	2,953.00	0.00
248	001338	永顺泰	300	2,940.00	0.00
249	601890	亚星锚链	400	2,820.00	0.00
250	688550	瑞联新材	120	2,782.80	0.00
251	300596	利安隆	100	2,713.00	0.00
252	300708	聚灿光电	300	2,700.00	0.00
253	603013	亚普股份	200	2,694.00	0.00
254	002294	信立泰	100	2,663.00	0.00
255	600016	民生银行	700	2,653.00	0.00
256	603993	洛阳钼业	300	2,550.00	0.00
257	002292	奥飞娱乐	400	2,392.00	0.00
258	300017	网宿科技	300	2,370.00	0.00
259	002446	盛路通信	400	2,260.00	0.00
260	002706	良信股份	300	2,058.00	0.00
261	000501	武商集团	300	2,001.00	0.00
262	601966	玲珑轮胎	100	1,837.00	0.00
263	000551	创元科技	200	1,746.00	0.00
264	603158	腾龙股份	200	1,408.00	0.00
265	603296	华勤技术	20	1,104.60	0.00
266	000534	万泽股份	100	993.00	0.00
267	002617	露笑科技	200	960.00	0.00
268	002946	新乳业	100	876.00	0.00
269	601700	风范股份	50	219.50	0.00
270	002892	科力尔	20	192.00	0.00
271	688219	会通股份	18	139.86	0.00
272	300134	大富科技	20	136.40	0.00
273	601789	宁波建工	20	73.60	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601633	长城汽车	474,793.00	0.14
2	601318	中国平安	413,454.00	0.12
3	000830	鲁西化工	391,613.00	0.12
4	000725	京东方 A	387,108.00	0.12
5	601888	中国中免	382,416.00	0.11
6	000568	泸州老窖	333,756.00	0.10
7	601877	正泰电器	333,741.00	0.10
8	002237	恒邦股份	332,952.00	0.10
9	600027	华电国际	329,644.00	0.10
10	000807	云铝股份	328,160.00	0.10
11	300442	润泽科技	325,907.00	0.10
12	002241	歌尔股份	322,543.00	0.10
13	601628	中国人寿	321,050.00	0.10
14	600519	贵州茅台	313,723.00	0.09
15	603296	华勤技术	310,738.00	0.09
16	603228	景旺电子	310,191.00	0.09
17	002245	蔚蓝锂芯	306,080.00	0.09
18	002001	新和成	302,435.00	0.09
19	600578	京能电力	293,320.00	0.09
20	300229	拓尔思	292,812.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	409,324.00	0.12
2	601633	长城汽车	406,112.00	0.12
3	002237	恒邦股份	339,529.00	0.10
4	603228	景旺电子	338,092.00	0.10
5	300442	润泽科技	319,819.00	0.10
6	000830	鲁西化工	311,795.00	0.09
7	603296	华勤技术	307,453.00	0.09
8	601628	中国人寿	304,725.00	0.09

9	000725	京东方 A	303,813.00	0.09
10	000807	云铝股份	298,677.00	0.09
11	600027	华电国际	296,436.00	0.09
12	002001	新和成	285,987.00	0.09
13	688009	中国通号	275,789.00	0.08
14	603595	东尼电子	274,663.00	0.08
15	000568	泸州老窖	274,430.00	0.08
16	002938	鹏鼎控股	273,841.00	0.08
17	001965	招商公路	273,595.00	0.08
18	300832	新产业	267,162.00	0.08
19	600026	中远海能	263,989.00	0.08
20	600776	东方通信	261,399.00	0.08

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	90,670,159.97
卖出股票收入（成交）总额	82,287,915.69

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	40,852,322.42	12.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	186,943,386.77	55.90
	其中：政策性金融债	52,071,483.60	15.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,514,934.43	9.12
6	中期票据	144,003,525.03	43.06
7	可转债(可交换债)	2,972,074.29	0.89
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	405,286,242.94	121.18

#### 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	220220	22 国开 20	300,000	31,637,893.44	9.46
2	212380021	23 交行债 02	300,000	31,060,967.21	9.29
3	2400002	24 特别国债 02	300,000	30,681,105.98	9.17
4	2428002	24 平安银行 三农债 01	300,000	30,599,901.64	9.15
5	012384261	23 鄂联投 SCP004	300,000	30,514,934.43	9.12

### 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国家开发银行，2023 年 12 月因不正当方式影响市场价格，被银行间市场交易商协会启动自律调查。

本基金持有的前十名证券发行主体交通银行股份有限公司，2024 年 6 月因安全措施不足，被国家金融监督管理总局地方监管局罚款。

本基金持有的前十名证券发行主体平安银行股份有限公司，2023 年 7 月由于违反账户管理规定等，被中国人民银行处以罚款，2023 年 12 月因贷款业务，被国家金融监督管理总局地方监管局处以罚款的处罚，2024 年 5 月因信贷业务、同业业务等违规，被国家金融监督管理总局没收违法所得/违法财物。

本基金持有的前十名证券发行主体中国建设银行股份有限公司，2023 年 7 月至 2024 年 6 月期间，其分支行多次因业务违规、报送违规等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、国家外汇管理局罚款、警示等。

本基金持有的前十名证券发行主体上海新长宁(集团)有限公司，2024 年 3 月因信披违规，被证监会分局书面警示。

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规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

### 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	61,788.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	61,788.48

### 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	113044	大秦转债	144,316.92	0.04
2	127018	本钢转债	139,330.46	0.04
3	110079	杭银转债	132,845.06	0.04
4	113050	南银转债	125,415.08	0.04
5	113042	上银转债	125,041.96	0.04
6	113056	重银转债	119,308.40	0.04
7	113052	兴业转债	119,036.14	0.04
8	127083	山路转债	117,481.97	0.04
9	128129	青农转债	117,072.28	0.04
10	113065	齐鲁转债	113,996.62	0.03
11	113033	利群转债	80,310.62	0.02
12	118031	天 23 转债	75,210.31	0.02
13	128138	侨银转债	66,241.04	0.02
14	113632	鹤 21 转债	47,201.74	0.01
15	113634	珀莱转债	45,988.17	0.01
16	110075	南航转债	45,875.61	0.01
17	113067	燃 23 转债	45,724.82	0.01
18	127040	国泰转债	45,401.24	0.01
19	113652	伟 22 转债	45,245.44	0.01
20	123119	康泰转 2	42,736.60	0.01
21	123063	大禹转债	42,607.68	0.01
22	113647	禾丰转债	41,697.77	0.01
23	127049	希望转 2	41,401.43	0.01
24	118022	锂科转债	39,684.49	0.01
25	111009	盛泰转债	39,136.40	0.01
26	113048	晶科转债	37,803.94	0.01
27	110086	精工转债	35,653.37	0.01
28	127084	柳工转 2	29,900.43	0.01
29	123114	三角转债	26,216.93	0.01
30	113055	成银转债	25,188.82	0.01
31	127086	恒邦转债	24,836.33	0.01
32	113062	常银转债	24,470.27	0.01
33	113060	浙 22 转债	23,769.26	0.01
34	113045	环旭转债	23,758.41	0.01
35	111002	特纸转债	23,746.06	0.01
36	113061	拓普转债	23,739.12	0.01
37	127045	牧原转债	23,670.67	0.01
38	110062	烽火转债	23,501.09	0.01
39	123104	卫宁转债	22,955.76	0.01
40	128141	旺能转债	22,905.28	0.01
41	118013	道通转债	22,840.47	0.01

42	127016	鲁泰转债	22,651.49	0.01
43	123133	佩蒂转债	22,600.53	0.01
44	127030	盛虹转债	22,534.27	0.01
45	113066	平煤转债	22,513.17	0.01
46	110089	兴发转债	22,475.41	0.01
47	113659	莱克转债	22,432.59	0.01
48	113049	长汽转债	22,360.56	0.01
49	128117	道恩转债	22,201.54	0.01
50	111010	立昂转债	22,133.99	0.01
51	110093	神马转债	22,101.16	0.01
52	127056	中特转债	21,867.71	0.01
53	110076	华海转债	21,721.27	0.01
54	113625	江山转债	21,703.35	0.01
55	110073	国投转债	21,648.73	0.01
56	113059	福莱转债	21,362.01	0.01
57	113584	家悦转债	21,241.32	0.01
58	110085	通 22 转债	21,153.80	0.01
59	113054	绿动转债	21,127.14	0.01
60	113657	再 22 转债	21,008.69	0.01
61	127025	冀东转债	20,696.99	0.01
62	118034	晶能转债	20,500.86	0.01
63	128135	洽洽转债	20,433.97	0.01
64	113053	隆 22 转债	20,350.07	0.01
65	113641	华友转债	20,293.60	0.01
66	110087	天业转债	20,235.50	0.01
67	127089	晶澳转债	19,460.11	0.01

### 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
国泰君安稳债	349	515,428.93	51,250,570.36	28.49%	128,634,126.42	71.51%

增利债券发起 A						
国泰君安稳债增利债券发起 C	785	194,575.95	20,978,465.00	13.73%	131,763,659.56	86.27%
合计	1,134	293,321.71	72,229,035.36	21.71%	260,397,785.98	78.29%

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

### 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	国泰君安稳债增利债券发起 A	1,009,432.37	0.5612%
	国泰君安稳债增利债券发起 C	2,989.88	0.0020%
	合计	1,012,422.25	0.3044%

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	国泰君安稳债增利债券发起 A	50~100
	国泰君安稳债增利债券发起 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安稳债增利债券发起 A	0
	国泰君安稳债增利债券发起 C	0~10
	合计	0~10

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	发起份额总数	发起份额占	发起份额承
----	--------	-------	--------	-------	-------

		基金总份额 比例		基金总份额 比例	诺持有期限
基金管理人固有 资金	10,009,450.4 5	3.01%	10,009,450.4 5	3.01%	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	997,324.97	0.30%	-	-	-
基金经理等人员	2,989.88	0.00%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	12,107.40	0.00%	-	-	-
合计	11,021,872.7 0	3.31%	10,009,450.4 5	3.01%	-

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

	国泰君安稳债增利债券 发起 A	国泰君安稳债增利债券 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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购 份额	42,622,362.42	46,918,595.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总 赎回份额	301,784,078.63	547,910,895.85
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变 动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	179,884,696.78	152,742,124.56

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：

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 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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 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。

#### 10.6.2 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			比例			
国泰君安证券	2	172,958,075.66	100.00%	254,078.08	100.00%	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安证券	1,299,691,742.88	100.00%	1,190,000,000.00	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	国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金托管协议	证监会指定网站、公司官网	2024-01-08
2	国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金基金合同	证监会指定网站、公司官网	2024-01-08
3	国泰君安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	2024-01-08
4	国泰君安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	2024-01-08
5	国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金招募说明书	证监会指定网站、公司官网	2024-01-08
6	国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证券报	2024-01-08
7	国泰君安稳债增利债券型发起	中国证券报、证监会指定网	2024-01-08

	式证券投资基金基金份额发售公告	站、公司官网	
8	国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2024-02-07
9	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
10	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
11	上海国泰君安证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网、上交所	2024-03-20
12	国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回和定期定额投资业务的公告	中国证券报、证监会指定网站、公司官网	2024-04-19
13	国泰君安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	2024-06-28
14	国泰君安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	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

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、《国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金基金合同》；

- 3、《国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安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  
<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