

国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

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 07 月 19 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年07月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年04月01日起至2024年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

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	
报告期末基金份额总额	332,626,821.34 份	
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。	
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	
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 04 月 01 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
1. 本期已实现收益	764,405.33	960,935.14
2. 本期利润	1,131,082.72	1,685,694.96
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0039	0.0048
4. 期末基金资产净值	181,001,289.07	153,438,649.50
5. 期末基金份额净值	1.0062	1.0046

注：1. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰君安稳债增利债券发起 A 净值表现

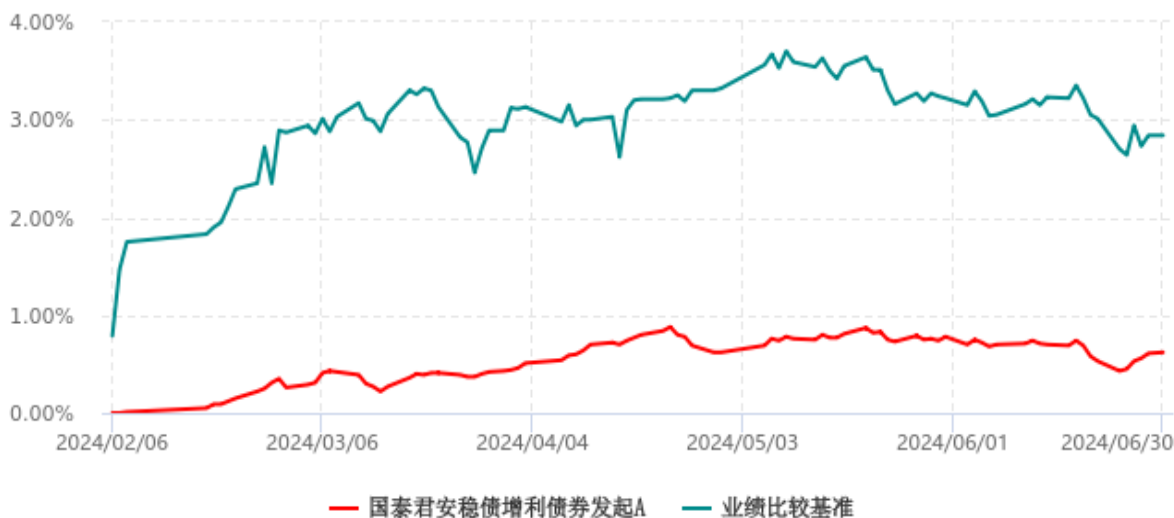
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.19%	0.05%	-0.05%	0.14%	0.24%	-0.09%
自基金合同 生效起至今	0.62%	0.04%	2.84%	0.19%	-2.22%	-0.15%

国泰君安稳债增利债券发起 C 净值表现

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	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%

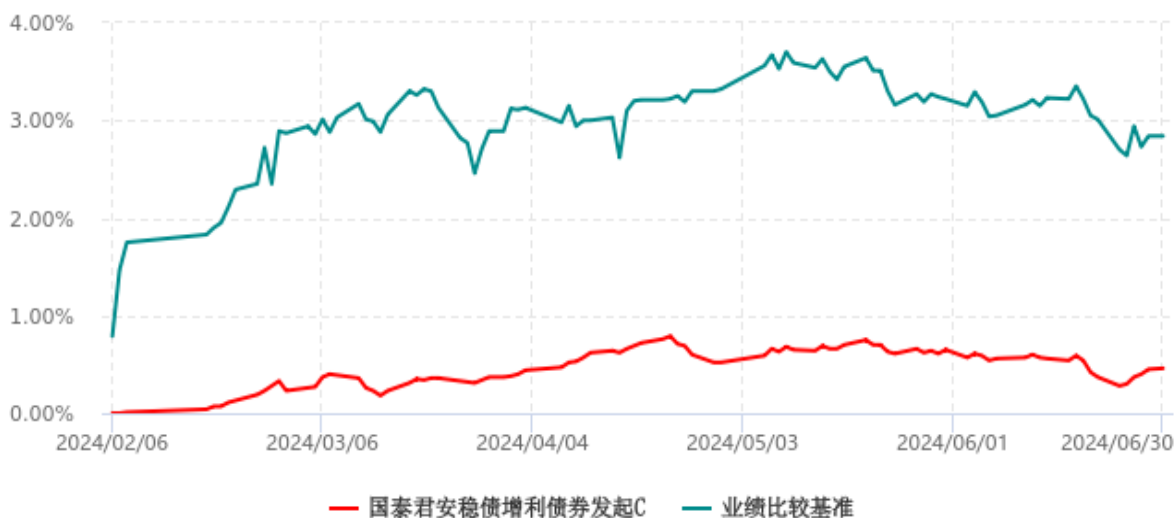
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡崇海	<p>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。</p>	2024-02-06	-	13 年	<p>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。</p>

朱莹	<p>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，国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金基金经理，国泰君安稳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。</p>	2024-02-06	-	4 年	<p>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。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益投资部（公募）基金经理，历任固定收益部研究员、投资经理助理；东证期货衍生品研究院高级金融工程分析师。主要从事债券投资研究。</p>
----	---	------------	---	-----	---

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度宏观基本面修复进程有所放缓，制造业 PMI 在 5 月和 6 月回落至荣枯线以下，从结构上来看宏观基本面仍然呈分化状态，外需有支撑而内需偏弱。二季度地产政策进一步加码，成交回暖，但预期的扭转仍需时日。货币政策方面保持稳健，除了月末等时间点性扰动外资金价格整体保持平稳。财政政策方面，特别国债发行计划落地，但在项目制约下地方债发行进度相较于往年偏慢。

债券市场延续牛市趋势，影响市场的重要因素之一是央行禁止“手工补息”带来的“存款搬家”效应，非银机构固收类产品规模大幅扩张，带动了信用债收益率的下行，加剧了债券市场“资产荒”，也导致非银的资金面分层效应几乎消失。利率债方面主要围绕央行关注长期利率债风险而波动，

央行从 3 月起多次提示市场关注长期利率债风险，并在 4 月底导致了债券市场出现调整。

权益市场方面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。

监管层面对市场采取了积极行动，“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造成一定情绪面的冲击，但长远来看，这些措施就如“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，为投资者创造更为透明和公平的投资环境。从 2019 年以来，价值因子的回报率经历了过山车行情，目前几乎修正到 2018 年底的位置。我们认为，下半年价值相对于成长的碾压式行情不可持续，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均有望提升成长股的投资情绪，成长和价值两种风格有望分庭抗礼，成长股的复苏将带动市场情绪回暖，中小盘股的相对劣势也有望同步得到改善。

债券投资方面本基金优选高等级信用债进行投资配置，阶段性参与利率债交易机会，由于央行频繁提示长期利率债风险，二季度产品久期策略整体较为均衡，保持中性久期和一定的杠杆水平。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，相较于产品成立前期的极低权益仓位本基金适时适度增加了权益类资产的配置。然而，市场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。在当前风险偏好受限的环境中，大盘股表现优于中小盘股，本基金通过优化量化投资组合，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，自五月起，重点强化了中证 800 内的 Alpha 挖掘能力，并计划逐步增加中证 800 内股票的持仓比例。在增量资金的驱动下二季度可转债表现较为亮眼，中证转债指数+0.75%，明显好于各大权益宽基指数。但 4 月和 6 月末在正股行情转弱和信用冲击扩散的双重压力影响下，转债市场估值压降明显。报告期内，组合可转债仓位基本保持稳定，以 AAA 银行转债作为转债部分底仓品种，可转债行业配置较为均衡，通过分散个券配置减少转债尾部风险暴露。

展望三季度，对债市而言核心仍然需要关注基本面，尤其是地产和居民信贷修复的情况。货币政策预计延续宽松取向，政策利率的变化节奏关注美联储的动向。此外未来央行可能一方面在二级市场买卖国债，另一方面增加了临时正、逆回购操作工具，预计债券市场的波动区间收窄。权益市场方面，政策面的积极信号与市场“优等生”的长期赚钱效应相结合，加之主要宽基指数的估值吸引力，我们坚信股市下半年的机会大于挑战。本基金将通过深化投研能力，耐心等待 alpha 和 beta 的双重催化作用，致力于为投资者创造稳健且可持续的回报。我们将继续密切关注市场变化，灵活

调整本基金的股票投资比例，力求在复杂多变的 market 环境中实现资产增值。转债方面，当前估值定价仍处于性价比较高的区间，向下回撤有限，向上有较大的弹性，我们相信，适当比例的转债仓位配置能够优化组合的风险收益指标，为投资者带来更加稳健的投资回报。

4.5 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 0.19%，同期业绩比较基准收益率为-0.05%；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 0.09%，同期业绩比较基准收益率为-0.05%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	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	其他资产	61,788.48	0.01
9	合计	447,179,300.38	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	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

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	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

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	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

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	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

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)					-
国债期货投资本期收益(元)					-528,415.60
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-

5.11 投资组合报告附注

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

本基金持有的前十名证券发行主体国家开发银行，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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
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	其他	-
8	合计	61,788.48

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	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

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安稳债增利债券发起 A	国泰君安稳债增利债券发起 C
报告期期初基金份额总额	439,046,412.99	653,734,425.41
报告期期间基金总申购份额	42,622,362.42	46,918,595.00
减：报告期期间基金总赎回份 额	301,784,078.63	547,910,895.85
报告期期间基金拆分变动份 额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,009,450.45	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,009,450.45	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	5.56	-

注：本报告期内基金管理人持有本基金份额未发生变化。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,009,450.45	3.01%	10,009,450.45	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	11,021,872.70	3.31%	10,010,450.68	3.01%	-

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 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。

10.2 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>。

10.3 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
二〇二四年七月十九日