

## 国泰君安君享多元稳健 ALPHA7 号集合资产管理计划

## 2023 年年度报告

## 重要提示

集合计划管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述，并对其内容的真实性、准确性承担个别及连带责任。

集合计划托管人根据本集合计划合同规定，于 2024 年 03 月 18 日复核了本报告中的主要财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## 一、集合资产管理计划简介

## (一) 基本资料

集合计划名称	国泰君安君享多元稳健 ALPHA7 号集合资产管理计划
成立日期	2022 年 07 月 22 日
成立规模	11,241,011.60
集合计划管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司
集合计划托管人	交通银行股份有限公司上海市分行

## (二) 管理人

法定名称：上海国泰君安证券资产管理有限公司

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

法定代表人：陶耿

电话：021-38676022

传真：021-38871190

联系人：吕巍

## (三) 托管人

名称：交通银行股份有限公司上海市分行

办公地址：上海市黄浦区中山南路 99 号

法定代表人：涂宏

电话：021-63111000

信息披露人：童人鹤

## 二、主要财务指标

### （一）主要财务指标

下述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

期间数据和指标	本期 2023 年 01 月 01 日 - 2023 年 12 月 31 日
本期利润	12,687,701.72
本期基金份额净值增长率	7.18%
期末数据和指标	2023 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	12,416,303.82
期末可供分配基金份额利润	0.0577
期末基金资产净值	229,797,228.77
期末基金份额净值	1.0684
累计期末指标	2023 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	6.84%

### （二）财务指标的计算公式

- 1、期末单位集合计划资产净值=期末集合计划资产净值÷集合计划份额
- 2、累计单位集合计划资产净值=期末单位集合计划资产净值+单位集合计划已分红收益
- 3、本期单位基金净值增长率=(本期第一次分红或扩募前单位基金资产净值÷期初单位基金资产净值)×(本期第二次分红或扩募前单位基金资产净值÷本期第一次分红或扩募后单位基金资产净值)×……×(期末单位基金资产净值÷本期最后一次分红或扩募后单位基金资产净值)-1
- 4、单位基金累计净值增长率=(第一年度单位基金资产净值增长率+1)×(第二年度单位基金资产净值增长率+1)×(第三年度单位基金资产净值增长率+1)×……×(上年度单位基金资产净值增长率+1)×(本期单位基金资产净值增长率+1)-1

## 三、价值变动情况

### （一）自集合计划合同生效以来集合计划份额净值的变动情况

国泰君安君享多元稳健ALPHA7号集合资产管理计划累计净值增长率走势图  
(2022年07月22日-2023年12月31日)



#### 四、报告期内资产运作情况

##### (一) 业绩表现

截止 2023 年 12 月 31 日，集合计划单位净值为 1.0684 元，本期净值增长率为 7.18%，集合计划累计净值增长率为 6.84%。

##### (二) 投资经理简介

孙东航, 4 年证券从业经验, 复旦大学理学学士、运筹学与控制论硕士, 现任上海国泰君安证券资产管理有限公司多资产策略投资部投资经理, 曾任职于国泰君安证券 FICC 投资业务部从事投资交易工作。取得基金从业资格, 最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚, 无外部兼职。

薛磊荣, 12 年证券投研经历, 复旦大学金融学硕士。现任国泰君安证券资产管理公司多资产策略投资部总经理。历任国泰君安证券 FICC 部门固定收益自营投资助理、投资经理、量化投资主管、境内固定收益投资主管、国泰君安证券交易投资业务线宏观对冲策略研究和投资负责人、国泰君安证券资产管理公司固定收益投资部副总经理。擅长自上而下的大类资产配置和多资产多策略的投资研究, 尤其精通各类场内外衍生品的量化投资交易策略, 在利率债、国债期货、利率互换、利率期权及中高等级信用债、股指期货和期权等品种上积累较为丰富的投资交易经验。

赵博阳, 香港城市大学数学系本科, 香港科技大学金融工程硕士。12 年证券期货从业经验, 8 年固定收益投资经验。现任国泰君安证券资产管理公司固定收益部(私募)副总经理、高级投资经理。投资风格稳健, 历史业绩优异, 关注长期稳定的绝对收益。2015 年加入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、(私募)副总经理。已取得基金从业资格, 无外部兼职, 最

近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

连冰洁, 6 年证券从业经历, 上海财经大学管理学学士、复旦大学金融学硕士。17 年从业, 从业时间 6 年。历任博时基金固定收益投资部, 研究员、高级研究员、基金经理助理。21 年 7 月加入国君资管, 现任固定收益部投资经理。有丰富的信用债自下而上的研究、调研经验。擅长信用债挖掘和流动性定价。风格稳健, 回撤控制能力及流动性管理能力良好。

### (三) 投资经理工作报告

展望 2024 年, 权益市场全年或以震荡为主。2024 年的权益市场或许仍然由宏观因素主导: 国内的核心关注点是通胀的变化。CPI 和 PPI 与企业盈利关联密切, 当前国内的实际利率仍然较高, 对于企业盈利抑制明显, 需要积极的财政政策抬升价格、扭转预期。我们预计今年全年通胀或先下后上, 但绝对水位可能仍然较低, 这也意味着权益市场或许仍然以结构性机会为主; 海外的核心关注点是美联储的降息路径, 在降息发生之前, 市场会在“过度预期-不及预期”中反复震荡, 但今年内发生降息的概率较大, 这对于国内高企的实际利率和极致压缩的利率曲线会有所缓解。操作上, 我们会密切关注基本面和流动性的变化, 灵活配置权益资产, 努力把握结构性机会和超跌反弹机会。

信用债市场在上半年结构性“资产荒”与下半年“一揽子化债”政策驱动下走出结构牛市, 期间“宽信用”预期与机构赎回短暂扰动。1 月, 2022 年末理财赎回潮影响余温仍在, 信用利差 V 型波动; 2 月至 4 月, 信用债供需失衡下结构性“资产荒”行情重演, 信用利差大幅收窄; 5 月至 6 月, 宏观经济修复斜率放缓逐步得到数据验证, 无风险利率快速下行, 叠加部分区域信用舆情事件与机构止盈操作增加影响, 信用利差被动走阔; 7 月初至 8 月 25 日, 政治局会议提出“一揽子化债方案”, 同时理财配置需求加大, 信用利差主动收窄; 8 月 25 日至 10 月末, “宽信用”政策加码, 机构赎回再现, 信用利差被动走阔; 11 月至 12 月, 资金面偏紧叠加“宽信用”预期升温, 随后存款利率再度调降, 无风险利率先上后下, 伴随着化债行情持续演绎, 信用利差整体收窄。全年来看, 3 年期 AAA、AA+、AA 级信用债收益率分别下行 46BP、72BP、91BP, 信用利差分别收窄 26BP、52BP、71BP。

制造业 PMI 持续回落, 市场需求仍显不足。12 月官方制造业 PMI 为 49.0%, 前值 49.4%, 连续 3 个月下降。新订单指数连续三月下滑, 现阶段需求仍未充分恢复。原材料购进价格和出厂价格指数的差距扩大, 中游制造业企业利润或受到一定程度的影响。新出口订单延续下滑, 许多企业反映海外订单减少, 外需依然偏弱。总的来看, 现阶段需求端仍未充分恢复, 对企业生产形成了一定制约, 制造业基本面的持续改善仍需等待内外需的实质性好转。

票息资产收益率下行, 城投债短端下沉的择券空间愈发逼仄。8 月以来化债政策驱动的城投行情超出市场预期, 聚焦短端做下沉的策略成为多数机构的共识, 反映到当前的城投债估值上, 短端城投债的等级利差已经所剩无几, 近期略有反弹, 但依然处于极低的历史分位数。同时也应留意在发债端收紧的背景下, 地方政府和城投的现金流压力并未缓解。倘若现金流不够或者腾挪空间受限, 将意味着潜在风险升温。此外, 符合“高息+短期”特点的城投债余额会越来越少, 一方面是存续债的滚动到期, 再融资后的到期期限大概率超出 2024 年底。另一方面, 当前新发的城投债也多在试图拉长期限, 2024 年发行且当年到期的高息城投债供给不会太多。

债市在基本面、政策面以及机构行为等方面迎来共振，年末在宽货币预期和年末配置力量的推动下，短期内或维持偏强震荡。11 月份经济金融数据偏弱，年末各重大会议经济刺激预期下降，央行释放出友好的货币政策信号，存款降息，股市偏弱表现在风险偏好上利好债市，低风险资金配置债市需求加大。短端仍然受制于资金面，年末央行公开市场操作力度加大，资金维持紧平衡。当前债市各项资产收益率价处于较低位置，高收益固定收益资产几乎消失，债市配置难度加大。明年资本新规正式实施，或导致金融债券利差扩大，可以挖掘相关债券配置价值。

#### 1、市场回顾

4 季度债券市场经历了先跌后涨的趋势。10-11 月份由于特别国债 1 万亿和地方政府再融资债券的密集发行，导致资金面明显偏紧，收益率曲线平坦化。12 月利率债供给显著回落，央行呵护资金面态度明显，跨年资金利率平稳，收益率曲线重回陡峭化。4 季度 PMI、PPI 等经济数据持续回落，基本面预期仍然偏弱，债券调整幅度较小。由于 9 月底 35 号文的出台，10-12 月份信用债市场持续处于城投债供给状态，城投债资产荒行情较为极致。

#### 2、市场展望

资金角度，货币政策在维持流动性合理充裕、支撑社会融资规模可持续较快增长方面仍有诉求，不具备收紧基础。另一方面，防止资金淤积、维护货币市场平稳运行亦是央行重要关注点，短期内流动性也不具备大幅宽松基础。政策角度，1 季度包含春节长假和数据真空期，市场对于基本面表现仍处于观望期。目前 1 月长端利率的强势行情或源自三个因素：一是月初及月末市场对于降息预期的两次升温。1 月长端利率整体走出两段式行情，下行速度最快的 1 月 3-11 日及 29-31 日均有较强的博弈降息情绪作为支撑。二是混合型产品的意外入局。1 月风险资产表现欠佳，部分混合型产品为对冲权益端的业绩回撤，将部分仓位转投至长端利率债品种，为债市定价带来了更多的不确定因素。三是年初银行配置需求旺盛。信贷平滑后，2024 年 1 月银行贷款投放压力小于季节性规律，叠加政府债供给阶段性放缓，银行配置户“早投早收益”的需求较强。展望 2-3 月份，市场配置力量会有所减弱，利率在绝对低位处于震荡格局。

#### （四）投资经理变更情况

无

#### （五）资产管理计划收益分配情况

无

#### （六）托管人履职报告

详见附件。

## 五、 集合计划财务报表及投资组合报告

### (一) 集合计划财务报表

#### 1. 资产负债表

单位：人民币元

资 产	期末余额 2023 年 12 月 31 日	上年年末余额 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
货币资金	11,690,250.52	2,660,167.90
结算备付金	5,534,314.67	2,480,172.42
存出保证金	1,796,894.98	919,033.83
交易性金融资产	219,733,135.47	161,573,539.72
其中：股票投资	30,244,114.52	6,746,389.00
基金投资	99.64	-
债券投资	189,488,921.31	154,827,150.72
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他投资	-	-
衍生金融资产	41,780.00	-
买入返售金融资产	10,536,578.40	-
债权投资	-	-
其中：债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
其他投资	-	-
其他债权投资	-	-
其他权益工具投资	-	-
应收清算款	-	-
应收股利	-	-
应收申购款	3,050,000.00	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	252,382,954.04	167,632,913.87
<b>负债和净资产</b>	<b>期末余额 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年年末余额 2022 年 12 月 31 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	22,032,160.29	26,035,528.24
应付清算款	-	-
应付赎回款	400,884.17	-

应付管理人报酬	64,775.04	43,271.42
应付托管费	3,595.51	2,403.98
应付销售服务费	-	-
应付投资顾问费	-	-
应交税费	55,558.09	19,136.23
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	28,752.17	26,725.53
负债合计	22,585,725.27	26,127,065.40
<b>净资产：</b>		
实收基金	215,094,013.86	141,965,097.45
其他综合收益	-	-
未分配利润	14,703,214.91	-459,248.98
净资产合计	229,797,228.77	141,505,848.47
负债和净资产总计	252,382,954.04	167,632,913.87

本集合计划资产净值(暂估业绩报酬前)229,797,228.77元,暂估业绩报酬207,158.78元,集合计划资产净值(暂估业绩报酬后)229,590,069.99元。实际计提时的业绩报酬金额可能会与此处暂估业绩报酬金额有差异。其中,资产净值(暂估业绩报酬后)=资产净值(暂估业绩报酬前)-暂估业绩报酬金额。

## 2. 利润表

单位：人民币元

项目	本期金额 2023年01月01日至2023年12月31日	上期金额 2022年07月22日(资产管理计划合同生效日)至2022年12月31日
<b>一、营业总收入</b>	14,574,718.56	-745,983.24
1. 利息收入	90,962.58	55,699.74
其中：存款利息收入	70,116.95	19,774.82
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	20,845.63	35,924.92
证券出借利息收入	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)	9,290,719.16	1,716,526.96
其中：股票投资收益	-769,451.02	-15,684.31
基金投资收益	-0.60	18,995.42
债券投资收益	9,672,864.23	1,982,854.84
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-11,194.45	-278,435.79
股利收益	434,025.01	9,194.66
以摊余成本计量的金融资产	-	-

终止确认产生的收益		
其他投资收益	-	-
投资收益抵减-金融商品转让 增值税	-35,524.01	-397.86
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	5,193,036.82	-2,518,209.94
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>	<b>1,887,016.84</b>	<b>335,386.45</b>
1. 管理人报酬	699,768.75	144,498.87
2. 托管费	38,682.94	8,027.69
3. 销售服务费	-	-
4. 投资顾问费	-	-
5. 利息支出	1,051,905.73	153,052.46
其中：卖出回购金融资产支出	1,051,905.73	153,052.46
6. 信用减值损失	-	-
7. 税金及附加	38,693.36	6,563.60
8. 其他费用	57,966.06	23,243.83
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>12,687,701.72</b>	<b>-1,081,369.69</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>12,687,701.72</b>	<b>-1,081,369.69</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>	<b>12,687,701.72</b>	<b>-1,081,369.69</b>

### 3. 净资产变动表

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期金额 2023年01月01日至2023年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	141,965,097.45	-	-459,248.98	141,505,848.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	141,965,097.45	-	-459,248.98	141,505,848.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	73,128,916.41	-	15,162,463.89	88,291,380.30
（一）综合收益总额	-	-	12,687,701.72	12,687,701.72
（二）本期基金份额交易产生	73,128,916.41	-	2,474,762.17	75,603,678.58

的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)				
其中: 1. 基金申购款	168,288,744.71	-	6,937,055.29	175,225,800.00
2. 基金赎回款	-95,159,828.30	-	-4,462,293.12	-99,622,121.42
(三)本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	215,094,013.86	-	14,703,214.91	229,797,228.77
项 目	上期金额 2022 年 07 月 22 日(资产管理计划合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	11,241,011.60	-	-	11,241,011.60
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	130,724,085.85	-	-459,248.98	130,264,836.87
(一) 综合收益总额	-	-	-1,081,369.69	-1,081,369.69
(二)本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	130,724,085.85	-	622,120.71	131,346,206.56
其中: 1. 基金申购款	135,444,510.65	-	651,489.35	136,096,000.00
2. 基金赎回款	-4,720,424.80	-	-29,368.64	-4,749,793.44
(三)本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	141,965,097.45	-	-459,248.98	141,505,848.47

#### 4. 报表附注

##### 4.1 资产管理产品的基本情况

集合计划名称为国泰君安君享多元稳健 ALPHA7 号集合资产管理计划, 成立日期为 2022 年 07 月 22 日, 成立规模 11,241,011.60 元, 集合计划管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司, 集合计

划托管人交通银行股份有限公司。

#### 4.2 财务报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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》》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

#### 4.3 遵循企业会计准则的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划于2023年12月31日的财务状况以及自2023年01月01日起至2023年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

会计政策变更的说明：本集合计划本报告期无会计政策变更。

会计估计变更的说明：本集合计划本报告期无会计估计变更。

差错更正的说明：本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 4.6 报表重要项目的说明，如管理人报酬的确定方法、暂估管理人报酬与投资者实际承担的管理人报酬可能存在差异的事实，以及公允价值计量的相关信息等

暂估业绩报酬为假设本集合计划于本报告期末按照当日的集合计划份额净值（计提业绩报酬前）清算，根据集合计划委托人持有的集合计划份额（包括未到期份额）至该日止持有期间的收益情况估算的业绩报酬。该金额是各集合计划委托人的暂估业绩报酬的合计，各集合计划委托人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认。实际计提时的业绩报酬金额可能会与此处暂估业绩报酬金额有差异。

#### 4.7 或有和承诺事项、资产负债表日后非调整事项等需要说明的事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要披露的重大或有事项以及资产负债表日后事项。

#### 4.8 与金融工具相关的流动性风险、信用风险、市场风险的信息

##### 一：流动性风险

流动性风险是指集合计划在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于投资人赎回其持有的集合计划份额，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，管理人每日对申购赎回情况进行严密监控，保持投资本集合计划中的可用现金头寸与之相匹配。本集合计划的管理人在本集合计划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，有效保障本集合计划持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本集合计划管理人通过独立的风险管理部门对本集合计划持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及本集合计划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。

##### 二：信用风险

信用风险是指在集合计划交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划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。

本集合计划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。

##### 三：市场风险

市场风险是指集合计划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。

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。管理人定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资本集合计划的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

其他价格风险是指本集合计划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。本集合计划通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照本集合计划合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本集合计划的管理人定期运用多种定量方法对本集合计划进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本集合计划面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 4.9 资产管理产品启用侧袋机制的，应当披露扣除侧袋机制影响后的期末净资产金额及其计算方法，以及侧袋账户的有关情况

无

#### 4.10 应当披露的其他信息

无

### (二) 投资组合报告

#### 1. 报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名证券明细

序号	资产代码	资产名称	数量（股/张）	期末市值（元）	占净值比例
1	133445	23 荆开 G2	100,000.00	10,731,219.18	4.67%
2	102381041	23 黄石众邦 MTN001	100,000.00	10,702,907.10	4.66%
3	102381264	23 黄石城投 MTN002	100,000.00	10,594,994.54	4.61%
4	102381400	23 巩义国资 MTN002	100,000.00	10,525,639.34	4.58%
5	251096	23 豫宛 K1	100,000.00	10,500,178.08	4.57%
6	102381437	23 赣州建投 MTN002	100,000.00	10,432,497.27	4.54%
7	182676	22 咸阳 04	100,000.00	10,269,315.07	4.47%
8	032280803	22 港兴港投 PPN003	100,000.00	10,265,540.98	4.47%
9	182546	22 商古 04	100,000.00	10,213,539.73	4.44%
10	162370	19 蔡家 01	100,000.00	10,162,876.71	4.42%

#### 2. 报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的其他投资明细

序号	资产代码	资产名称	数量（份）	期末市值（元）	占净值比例
1	I02401-C-3450	沪深 300 股 指 2401-C-3450	7.00	33,740.00	0.01%
2	M02401-C-6100	中证 1000 股 指 2401-C-6100	3.00	8,040.00	0.00%

#### 3. 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	30,244,114.52	11.98
	其中：股票	30,244,114.52	11.98
2	基金投资	99.64	0.00
3	固定收益投资	189,488,921.31	75.08
	其中：债券	189,488,921.31	75.08
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	41,780.00	0.02
6	买入返售金融资产	10,536,578.40	4.17
	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	17,224,565.19	6.82
8	其他各项资产	4,846,894.98	1.92
9	合计	252,382,954.04	100.00

注：在以上表格中由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

#### 4. 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	1,796,894.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,050,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,846,894.98

#### 5. 投资组合报告附注

- 1、报告期内集合计划投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。
- 2、集合计划投资的前十名证券中，没有投资于超出集合计划合同规定可投资证券库之外的。

### （三）重大关联交易状况

#### 2023 年关联方持有本集合计划数据

产品代码	期间份额变动情况	期末持有份额
953646	-6,520,586.8	0

#### 关联方交易明细如下：

成交日期	基金名称	委托方向	证券代码	证券简称	成交数量	成交金额
2023-03-23	国泰君安君享多元稳健 ALPHA7 号	债券投标	250382	23 牟发 02	50,000	5,000,000
2023-06-19	国泰君安君享多元稳健 ALPHA7 号	卖出	600000	浦发银行	19,400	142,784

2023-12-25	国泰君安君享多元稳健 ALPHA7 号	开基申购	013272	国泰君安 1 年定开债券发起式	97.81	99.4
------------	---------------------	------	--------	-----------------	-------	------

#### (四) 两费及业绩报酬情况

项目	当前费率	计提方式	支付方式
管理费	0.3600%	每日计提	按月支付
托管费	0.0200%	每日计提	按月支付

项目	当前计提基准	计提比例	计提方式	支付方式
业绩报酬	以公告为准	$R \leq R_x$ 0, $R > R_x$ 50%	退出提取、分红提取	发生时支付

## 六、 集合计划份额变动

单位：份

期初集合计划份额总额	141,965,097.45
报告期间集合计划总申购份额	168,288,744.71
报告期间集合计划总赎回份额	95,159,828.30
报告期末集合计划份额总额	215,094,013.86

## 七、 重要事项提示

无

## 八、 备查文件目录

### (一) 本集合计划备查文件目录

- 1、中国证监会核准集合计划募集的无异议函；
- 2、《国泰君安君享多元稳健 ALPHA7 号集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《国泰君安君享多元稳健 ALPHA7 号集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《国泰君安君享多元稳健 ALPHA7 号集合资产管理计划说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、集合计划托管人业务资格批件、营业执照。

## （二）存放地点及查阅方式

投资者可于本集合计划管理人办公时间预约查阅，或登录集合计划管理人网站 [www.gtjazg.com](http://www.gtjazg.com) 查阅，还可拨打本公司客服电话（95521）查询相关信息。

上海国泰君安证券资产管理有限公司  
二〇二四年三月三十一日

