

国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金

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:上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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.....	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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	13

§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	34
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.....	35
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.....	35
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.....	35
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.....	36
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	36
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	36
7.12 投资组合报告附注.....	36

§ 8 基金份额持有人信息	37
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	37
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	37
§ 9 开放式基金份额变动	37
§ 10 重大事件揭示	38
10.1 基金份额持有人大会决议	38
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.....	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	38
10.4 基金投资策略的改变	38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	39
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	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	39
10.8 其他重大事件.....	39
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	40
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.....	40
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	41
§ 12 备查文件目录	41
12.1 备查文件目录.....	41
12.2 存放地点	41
12.3 查阅方式	41

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金
基金简称	国泰君安安睿纯债债券
基金主代码	019400
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 12 月 05 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	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,148,446,089.44 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以固定收益品种为投资对象，力争获取风险控制下的稳健收益。
投资策略	本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，结合定量分析方法，确定资产在非信用类固定收益类证券（国债、中央银行票据等）和信用类固定收益类证券之间的配置比例。
业绩比较基准	中债-国债及政策性银行债财富(1-3 年)指数收益率*95%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上海国泰君安证券资产管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍
	联系电话	021-38676022
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com
客户服务电话	95521	95528
传真	021-38871190	021-63602540
注册地址	上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室	上海市中山东一路 12 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	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码	200120	200126
法定代表人	陶耿	张为忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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）
本期已实现收益	51,579,913.76
本期利润	57,082,498.76
加权平均基金份额本期利润	0.0243
本期加权平均净值利润率	2.40%
本期基金份额净值增长率	2.57%
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	23,393,165.84
期末可供分配基金份额利润	0.0109
期末基金资产净值	2,188,690,389.91
期末基金份额净值	1.0187
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	3.19%

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)。

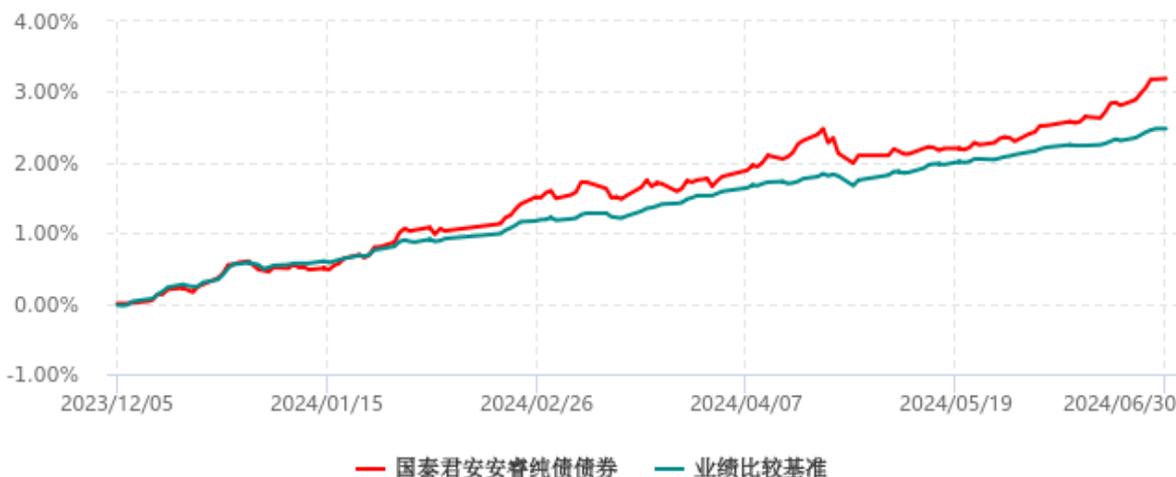
3.2 基金净值表现

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

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	0.87%	0.05%	0.36%	0.02%	0.51%	0.03%
过去三个月	1.39%	0.07%	0.94%	0.03%	0.45%	0.04%
过去六个月	2.57%	0.07%	1.89%	0.03%	0.68%	0.04%
自基金合同生效起至今	3.19%	0.06%	2.48%	0.03%	0.71%	0.03%

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

国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金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05日-2024年06月30日)



注: 1、本基金于 2023 年 12 月 05 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		
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	2023-12-05	-	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。

	债券型证券投资基金基金经理，国泰君安稳健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。				
杨勇	国泰君安稳健债双利 6 个月持有期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，国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金经理。现任固定收益投资部（公募）副总经理。	2023-12-08	-	8 年	杨勇，上海交通大学国际经济与贸易专业本科学士学位，历任中国银行股份有限公司上海人民币交易业务总部交易员，平安银行股份有限公司总行资金营运中心投资经理，国泰君安证券股份有限公司固定收益证券部投资经理，永赢基金管理有限公司固定收益投资部总监助理、副总监。2023 年 6 月加入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）担任副总经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本管理人因组合投资策略需要，除指数基金投资指数成份券以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 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

本基金积极投资于各类债券，重点以国债和政策性金融债为持仓，整体而言，上半年本基金债券组合久期保持中高位，并成功挖掘长期限国债的超额收益。在阶段性的市场回调中，本基金积极管理市场风险，规避了市场潜在的大幅波动，有效地提升了基金的总体收益水平，并呈现出较低波动的特征。

具体而言，本基金今年以来的投资运作主要可以分三个阶段：

第一阶段，即年初至 3 月初，其中，春季前，本基金的持仓结构以 3-5 年期政策性金融债为主，组合久期略高于中长期纯债型基金总体。春节后，本基金加大了 10 年期国债的持仓，并进一步提升了组合久期。随后，本基金又在 3 月初开始减仓，完全退出了 10 年和 30 年国债的交易，避免了潜在的大幅回撤。

第二阶段，即 3 月中旬至 5 月中旬。经过了前几日的回调，债市于 3 月中旬完成探底，本基金回补 10 年和 30 年国债持仓。并保持在 3-5 年、7-10 年和 30 年国债这三个期限段上平均地配置久期，以这样的持仓结构迎来新一轮行情，使得本基金继续平稳上涨，且涨跌幅始终较为平稳，并未出现大涨大跌的情况。4 月末的市场调整中，本基金比较及时地作出了减仓操作，因此本轮回撤相较市场同类还是更小。

第三阶段，即 5 月中旬至半年末。本基金此轮加仓小幅领先市场，随后公布的 5 月货币信贷数据承压，包括 PMI 数据再度回到枯荣线下方等，显示经济复苏动力有所减弱，因此本基金在 6 月内持续保持久期高配，本基金净值持续平稳增长。

总体而言，自成立以来，本基金投资收益率处于市场同类品种中等水平，整体波动性应该是低于同类水平，展现出较为平稳的风险收益特征。本基金将继续努力保持这种风格。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安安睿纯债债券基金份额净值为 1.0187 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 2.57%，同期业绩比较基准收益率为 1.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

去年下半年以来，国内宏观经济的突出特点，一是量价分化：产量、销量类指标表现较强，但价格类指标表现较弱，实体经济以降价换销量的特征非常明显；二是地产与非地产分化：直接与房

地产相关的领域普遍反弹乏力，而面向出口和居民基本消费的领域表现较好。

上述现象，都是经济转型过程中，新动能逐步接力旧动能时难免青黄不接的正常现象。今年以来，中国经济增速已经有所恢复，上半年，GDP 同比增速为 5%，其中一季度同比增速达到 5.3%，二季度为 4.7%。综合各项经济数据判断，今年全年完成 5%左右增速目标是有较大把握的，整体经济形势也处于恢复性企稳过程中。尤其是，今年已经逐步从过去的“总量放缓，结构改善”过渡到“总量企稳，结构进一步改善”的状态，经济结构转型加速，转型风险收敛，预计未来仍将继续改善。不过，考虑到二季度经济增速有所放缓，仍需要稳增长政策适度加力，好在去年下半年基数不高，因而今年下半年所需要的政策加力幅度也不用太大。而在高质量发展的时代命题之下，我们并不期待过往由房地产带来的那种极高的向上弹性，而是以平稳且高质量的增长为目标。

在经济转型过程中，债券市场作为中国投融资体系的重要组成部分，会更多地受到总量的影响，因此呈现出高收益优质资产难觅、广谱利率持续下行的特点，叠加期间每逢阶段性的波动，货币政策都会作一定的宽松以防范系统性风险，债券会间接受益，因此过往数年，债市整体处于长期牛市之中。

展望后市，我们认为经济转型过程仍在持续和加速，而随着新动能的持续发展，以及房地产市场，即旧动能的逐步见底，2024 年经济总体的增速有望企稳，后续进一步的债券投资，应聚焦观察实体经济融资需求的恢复情况。但总体而言，我们判断随着经济转型的深入、随着金融服务实体经济能力的增强，每单位经济增量所需的货币信贷资源投入是降低的，而重新寻找高收益（另一面对实体经济而言则是高成本）的资产难度仍将增大，存量相对高息的债券资产仍具有比价意义上突出的投资价值。本基金也将一如既往，积极挖掘市场尚未重视的价值来源，尽力获取合理的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金基金合同》及最新的招募说明书约定“在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可进行收益分配。”

本基金于 2024 年 3 月 15 日实施本年度第一次利润分配，每份基金份额分红 0.008 元；于 2024 年 5 月 17 日实施本年度第二次利润分配，每份基金份额分红 0.005 元。上述利润分配符合合同规定。

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

本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，由上海国泰君安证券资产管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金

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	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	6,918,991.84	294,657,385.75

结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,182,511,279.74	4,356,432,330.62
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,182,511,279.74	4,356,432,330.62
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		106,946.52	4,985.07
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.4	-	-
资产总计		2,189,537,218.10	4,651,094,701.44
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		-	70,028,287.12

应付清算款		-	-
应付赎回款		-	4,988.01
应付管理人报酬		504,776.10	515,131.89
应付托管费		168,258.68	171,710.63
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	173,793.41	36,705.66
负债合计		846,828.19	70,756,823.31
净资产：			
实收基金	6.4.7.6	2,148,446,089.44	4,553,180,838.88
未分配利润	6.4.7.7	40,244,300.47	27,157,039.25
净资产合计		2,188,690,389.91	4,580,337,878.13
负债和净资产总计		2,189,537,218.10	4,651,094,701.44

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0187 元，基金份额总额 2,148,446,089.44 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金

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		63,455,647.87

1. 利息收入		827,796.67
其中：存款利息收入	6.4.7.8	65,937.54
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		761,859.13
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		57,075,067.54
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.9	57,075,067.54
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		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.10	5,502,585.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.11	50,198.66
减：二、营业总支出		6,373,149.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,482,910.25
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,160,970.08
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		1,599,644.74

其中：卖出回购金融资产支出		1,599,644.74
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.12	129,624.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		57,082,498.76
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		57,082,498.76
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		57,082,498.76

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金

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	4,553,180,838.88	27,157,039.25	4,580,337,878.13
二、本期期初净资产	4,553,180,838.88	27,157,039.25	4,580,337,878.13
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	- 2,404,734,749.44	13,087,261.22	- 2,391,647,488.22
（一）、综合收益总额	-	57,082,498.76	57,082,498.76
（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）	- 2,404,734,749.44	-19,934,966.14	- 2,424,669,715.58
其中：1. 基金申购款	446,130,198.92	6,918,412.00	453,048,610.92
2. 基金赎回款	- 2,850,864,948.36	-26,853,378.14	- 2,877,718,326.50
（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）	-	-24,060,271.40	-24,060,271.40
四、本期期末净资产	2,148,446,089.44	40,244,300.47	2,188,690,389.91

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

国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金(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] 1881 号《关于准予国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金注册的批复》准予注册, 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《国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 551, 113, 436. 78 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 0621 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2023 年 12 月 5 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 551, 113, 711. 14 份基金份额, 认购资金利息折合基金份额为 274. 36。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, 基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的债券(国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、政府支持机构债、政府支持债券、可分离交易可转债的纯债部分、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具等法律法规或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的相关规定)。本基金不投资于股票, 也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。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。本基金的投资组合比例为: 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%; 本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%, 前述现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或者变更投资比例限制, 基金管理人在履行适当程序后, 可以相应调整本基金的投资范围和投资比例的规定。本基金的业绩比较基准为: 中债-国债及政策性银行债财富(1-3 年)指数收益率*95%+金融机构人民币活期存款利率(税后)*5%。

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》、《国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金基金合同》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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金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	6,918,983.45
等于：本金	6,918,583.80
加：应计利息	399.65
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	8.39
等于：本金	8.39
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	6,918,991.84

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	2,141,917,925.00	21,377,279.74	2,182,511,279.74
	合计	2,141,917,925.00	21,377,279.74	2,182,511,279.74
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,141,917,925.00	21,377,279.74	2,182,511,279.74	19,216,075.00

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	59,859.27
其中：交易所市场	-
银行间市场	59,859.27
应付利息	-
预提信息披露费	79,771.12

预提审计费	24,863.02
预提账户维护费	9,300.00
合计	173,793.41

6.4.7.6 实收基金

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	4,553,180,838.88	4,553,180,838.88
本期申购	446,130,198.92	446,130,198.92
本期赎回（以“-”号填列）	-2,850,864,948.36	-2,850,864,948.36
本期末	2,148,446,089.44	2,148,446,089.44

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

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,235,389.45	19,921,649.80	27,157,039.25
本期期初	7,235,389.45	19,921,649.80	27,157,039.25
本期利润	51,579,913.76	5,502,585.00	57,082,498.76
本期基金份额交易产生的变动数	-11,361,865.97	-8,573,100.17	-19,934,966.14
其中：基金申购款	4,725,485.86	2,192,926.14	6,918,412.00
基金赎回款	-16,087,351.83	-10,766,026.31	-26,853,378.14
本期已分配利润	-24,060,271.40	-	-24,060,271.40
本期末	23,393,165.84	16,851,134.63	40,244,300.47

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	65,937.55
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-0.01
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	65,937.54

6.4.7.9 债券投资收益

6.4.7.9.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	31,778,917.55
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	25,296,149.99
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	57,075,067.54

6.4.7.9.2 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 01 月 01 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	12,763,100,929.46
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,570,156,120.00
减：应计利息总额	167,526,134.47
减：交易费用	122,525.00
买卖债券差价收入	25,296,149.99

6.4.7.10 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	5,502,585.00
——股票投资	-
——债券投资	5,502,585.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	5,502,585.00

6.4.7.11 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	50,198.66
合计	50,198.66

6.4.7.12 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	24,863.02
信息披露费	69,465.76
证券出借违约金	-
银行汇划费	16,695.26
账户维护费	18,600.00
合计	129,624.04

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

本基金的基金管理人于 2024 年 8 月 17 日宣告 2024 年度第 3 次分红，向截至 2024 年 8 月 19 日止在本基金注册登记机构登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.080 元。

截至财务报表批准日，除上述利润分配事项外，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
上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦东发展银行”)	基金托管人
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
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。

6.4.10.2 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	3,482,910.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	83,723.06
应支付基金管理人的净管理费	3,399,187.19

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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。

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	1,160,970.08

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。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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 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自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
上海浦东发展银行总行	297,145,779.29	13.83%	1,357,145,279.29	29.81%

注：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。

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
浦东发展银行	6,918,983.45	65,937.55
国泰君安证券	8.39	-0.01

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展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

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

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2024-03-15	2024-03-15	0.080	12,917,684.09	1,037,709.84	13,955,393.93	-
2	2024-05-17	2024-05-17	0.050	9,553,697.42	551,180.05	10,104,877.47	-
合计			0.130	22,471,381.51	1,588,889.89	24,060,271.40	-

注：报告期内本资产管理计划利润分配合计：24,060,271.40 元

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上海浦东发展银行股份有限公司，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约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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持证券均在银行间市场交易，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	6,918,991.84	-	-	-	6,918,991.84
交易	121,989,114.7	1,093,840,753.5	966,681,411.4	-	2,182,511,279.7

金融资产	5	4	5		4
应收申购款	-	-	-	106,946.52	106,946.52
资产总计	128,908,106.59	1,093,840,753.54	966,681,411.45	106,946.52	2,189,537,218.10
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	504,776.10	504,776.10
应付托管费	-	-	-	168,258.68	168,258.68
其他负债	-	-	-	173,793.41	173,793.41
负债总计	-	-	-	846,828.19	846,828.19
利率敏感度缺口	128,908,106.59	1,093,840,753.54	966,681,411.45	-739,881.67	2,188,690,389.91
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	294,657,385.75	-	-	-	294,657,385.75
交易性金融资产	-	3,631,088,433.02	725,343,897.60	-	4,356,432,330.62
应收申购款	-	-	-	4,985.07	4,985.07
资产总计	294,657,385.75	3,631,088,433.02	725,343,897.60	4,985.07	4,651,094,701.44

负债					
卖出回购金融资产款	70,028,287.12	-	-	-	70,028,287.12
应付赎回款	-	-	-	4,988.01	4,988.01
应付管理人报酬	-	-	-	515,131.89	515,131.89
应付托管费	-	-	-	171,710.63	171,710.63
其他负债	-	-	-	36,705.66	36,705.66
负债总计	70,028,287.12	-	-	728,536.19	70,756,823.31
利率敏感度缺口	224,629,098.63	3,631,088,433.02	725,343,897.60	-723,551.12	4,580,337,878.13

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	基准利率点利率增加 0.1%	-12,737,104.44	-13,609,627.02
	基准利率点利率减少 0.1%	12,891,043.70	13,674,055.11

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币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

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此无其他的价格风险敞口（于 2023 年 12 月 31 日：同）。

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 0.00%（2023 年 12 月 31 日：0.00%），因此除市场利率和外币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（2023 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
---------------	----------------------	-----------------------

第一层次	-	-
第二层次	2,182,511,279.74	4,356,432,330.62
第三层次	-	-
合计	2,182,511,279.74	4,356,432,330.62

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	-	-
3	固定收益投资	2,182,511,279.74	99.68
	其中：债券	2,182,511,279.74	99.68

	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	6,918,991.84	0.32
8	其他各项资产	106,946.52	0.00
9	合计	2,189,537,218.10	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

本基金本报告期末进行股票投资。

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	697,906,767.95	31.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,484,604,511.79	67.83
	其中：政策性金融债	1,484,604,511.79	67.83
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,182,511,279.74	99.72

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	230203	23 国开 03	2,500,000	259,632,377.05	11.86
2	240006	24 付息国债 06	2,500,000	254,280,410.96	11.62
3	230415	23 农发 15	2,000,000	208,340,765.03	9.52
4	220208	22 国开 08	2,000,000	204,641,095.89	9.35
5	230018	23 付息国债 18	1,600,000	165,118,769.23	7.54

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。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	106,946.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	106,946.52

7.12.4 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。

7.12.5 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

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
353	6,086,249.55	2,147,355,076.12	99.95%	1,091,013.32	0.05%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	285,491.12	0.0133%

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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 12 月 05 日）基金份额总额	551,113,711.14
本报告期期初基金份额总额	4,553,180,838.88
本报告期基金总申购份额	446,130,198.92
减：本报告期基金总赎回份额	2,850,864,948.36
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	2,148,446,089.44

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、报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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	-	-	-	-	-

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	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	国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资）的公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2024-03-11
3	国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金分红公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2024-03-13
4	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
5	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

6	国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金 2023 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-03-29
7	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2024-03-29
8	国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2024-04-22
9	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
10	国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资）的公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2024-05-15
11	国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金分红公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2024-05-16
12	国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	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	20240101-20240201	1,357,145,279.29	-	1,059,999,500.00	297,145,779.29	13.83%
	2	20240123-20240205	798,572,140.19	-	500,000,000.00	298,572,140.19	13.90%
	3	20240426-20240630	299,340,949.91	295,449,576.52	-	594,790,526.43	27.68%
	4	20240206-20240630	498,901,915.79	-	-	498,901,915.79	23.22%
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</p>							

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;

(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;

(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;

(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;

(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。

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安睿纯债债券型证券投资基金募集注册的文件;
- 2、《国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金基金合同》;
- 3、《国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金托管协议》;
- 4、《国泰君安安睿纯债债券型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