

国泰君安君得盈债券型证券投资基金

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 03 月 29 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。本年度报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年03月15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。

本报告期自2023年01月01日起至2023年12月31日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	7
2.1 基金基本情况	7
2.2 基金产品说明	7
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 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	17
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	25
§ 8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
8.3 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	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
8.6 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	54
8.7 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	54

8.8 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	54
8.9 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	54
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
8.12 投资组合报告附注	55
§ 9 基金份额持有人信息	56
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
9.3 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
§ 10 开放式基金份额变动	57
§ 11 重大事件揭示	58
11.1 基金份额持有人大会决议	58
11.2 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
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
11.4 基金投资策略的改变	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8 其他重大事件	59
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	61
12.1 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
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	61

§ 13 备查文件目录	61
13.1 备查文件目录	62
13.2 存放地点	62
13.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰君安君得盈债券型证券投资基金	
基金简称	国泰君安君得盈债券	
基金主代码	952020	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 01 月 28 日	
基金管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	137,537,879.54 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰君安君得盈债券 A	国泰君安君得盈债券 C
下属分级基金的交易代码	952020	952320
报告期末下属分级基金的份额总额	85,292,685.10 份	52,245,194.44 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以固定收益品种为主要投资对象，在以资产安全性为优先考虑的前提下，力争获取风险控制下更高的稳健收益。
投资策略	<p>本基金将在资产配置策略的基础上，通过固定收益类品种投资策略构筑债券组合的平稳收益。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将研究与跟踪中国宏观经济运行状况和资本市场变动特征，依据定量分析和定性分析相结合的方法，考虑经济环境、政策取向、类别资产收益风险预期等因素，采取“自上而下”的方法将基金资产在债券与股票等资产类别之间进行动态资产配置。</p> <p>本基金将在稳健的资产配置策略基础上，根据股票的运行状况和收益预期，在严格控制风险的基础上，积极并适时适度地参与权益类资产配置，把握市场时机力争为基金资产获取增强型回报。</p> <p>2、固定收益品种投资策略</p> <p>本基金将采取利率策略、信用策略、债券选择策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，以实现组合增值的目标。</p> <p>本基金投资策略还包括：杠杆投资策略、国债期货投资策略、股票投资策略。</p>
业绩比较基准	中债综合财富指数收益率×70%+一年定期存款税后利率×20%+沪深 300 指数收益率×10%

风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金、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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕巍	王小飞
	联系电话	021-38676022	021-60637103
	电子邮箱	zgxxpl@gtjas.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		95521	021-60637228
传真		021-38871190	021-60635778
注册地址		上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22-23 层及 25 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		陶耿	田国立

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gtjazg.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.	2023 年	2022 年	2021 年 01 月 28 日（基金合同
------	--------	--------	-----------------------

1 期间数据和指标					生效日) -2021 年 12 月 31 日	
	国泰君安君得盈债券 A	国泰君安君得盈债券 C	国泰君安君得盈债券 A	国泰君安君得盈债券 C	国泰君安君得盈债券 A	国泰君安君得盈债券 C
本期已实现收益	-2,482,102.85	-1,781,477.57	-8,687,677.1	-4,458,874.05	11,526,090.18	5,753,673.98
本期利润	70,183.55	-115,689.41	-18,166,937.79	-7,340,871.51	17,281,122.63	8,566,280.25
加权平均基金份额本期利润	0.0008	-0.0019	-0.0901	-0.0739	0.0750	0.0592
本期加权平均净值利润率	0.08%	-0.19%	-8.73%	-7.20%	7.28%	5.77%
本期基金份额净值增长率	-0.26%	-0.66%	-6.08%	-6.46%	6.69%	6.39%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	59,570.33	-542,457.41	578,748.75	-171,897.31	20,105,099.95	7,640,911.91
期末可供分配基金份额利润	0.0007	-0.0104	0.0050	-0.0022	0.0673	0.0640
期末	85,498,514.	51,785,543.	115,312,645.	78,718,626.	319,633,598.	127,439,518.

基金资产净值	43	04	97	64	87	99
期末基金份额净值	1.0024	0.9912	1.0050	0.9978	1.0701	1.0667
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	-0.06%	-1.14%	0.20%	-0.48%	6.69%	6.39%

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）。

（4）国泰君安君得盈债券 C 类份额首次确认日为 2021 年 3 月 9 日。

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

国泰君安君得盈债券 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
过去三个月	-0.49%	0.16%	0.34%	0.09%	-0.83%	0.07%
过去六个月	-1.46%	0.15%	0.51%	0.09%	-1.97%	0.06%
过去一年	-0.26%	0.16%	2.47%	0.08%	-2.73%	0.08%
自基金合同生效起至今	-0.06%	0.22%	5.43%	0.11%	-5.49%	0.11%

国泰君安君得盈债券 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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

		②		④		
过去三个月	-0.59%	0.16%	0.34%	0.09%	-0.93%	0.07%
过去六个月	-1.66%	0.15%	0.51%	0.09%	-2.17%	0.06%
过去一年	-0.66%	0.16%	2.47%	0.08%	-3.13%	0.08%
自基金合同生效起至今	-1.14%	0.23%	6.15%	0.11%	-7.29%	0.12%

注：国泰君安君得盈债券 C 类份额首次确认日为 2021 年 3 月 9 日。

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

国泰君安君得盈债券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
(2021年01月28日-2023年12月31日)



国泰君安君得盈债券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
(2021年03月09日-2023年12月31日)



注：国泰君安君得盈债券 C 类份额首次确认日为 2021 年 3 月 9 日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：2021 年按实际存续期计算。



注：2021 年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金未进行利润分配。

§ 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 2023 年 12 月 31 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 48 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		
周一洋	国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金经理，国泰君安稳债双利 6 个月持有期债券型发起式证券投资基金基金经理。现任多资产策略投资部高级研究员、基金经理。	2022-11-14	-	7 年	周一洋，哥伦比亚大学统计学硕士，历任海通证券有限公司总部研究所证券分析师、高级分析师等职务，主要从事资产配置、行业轮动和权益策略研究。目前担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高级研究员、基金经理。
王海军	国泰君安君得盛债券型证券投资基金基金经理，国泰君安君得诚混合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。现任公募权益投资部基金经理。	2023-03-16	-	15 年	王海军，厦门大学工商管理硕士，具备证券业、基金业从业资格。历任中国中投证券有限公司研究所分析师；富国基金管理有限公司权益研究部高级研究员、权益投资部高级基金经理；长安基金管理有限公司研究部总监、投决会成员、

					基金经理；2021 年 9 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司私募权益投资部担任投资经理，现任公募权益投资部基金经理。
杨勇	国泰君安稳债双利 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。	2023-12-12	-	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。
杨坤	本基金基金经理（已于 2023 年 03 月 16 日离任）	2021-04-13	2023-03-16	11 年	杨坤，英国华威大学金融硕士，约克大学金融数学硕士，10 年以上债券从业经验。2017 年 4 月至 2023 年 7 月就职于上海国泰君安证券资产管理有限公司，担任基金经理、“固收+”投资组主管。曾就职于工银安盛人寿资产管理部、国泰君安证券研究所债券团队、平安养老固定收益部债券研究团队。
施纵舟	本基金基金经理（已于 2023 年 12 月 12 日离任）	2022-11-14	2023-12-12	11 年	施纵舟，清华大学经济系硕士，上海财经大学经济系学士。现任本公司固定收益投资部（公募）基金经理。2021 年 10 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司。2012 年 7 月至 2021 年 10 月任职于中信证券股份有限公司固定收益部，历任投资助理、投资经理，高级副总裁。主要负责固定收益类产品的投资研究工作。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《上海国泰君安证券资产管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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 27 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

回顾 2023 年，伴随宏观经济“强预期-弱现实”格局，债券市场走出牛市。一季度，在疫情防控转段后，市场普遍预期经济将企稳复苏，且复苏力度较强，因此国债收益率一度有所上行。但是，从 3 月开始，随着弱于预期的经济数据的陆续发布，债券市场迅速结束短期调整，展开新一轮上涨行情。在 3 至 8 月，由物价下跌带来的所谓“通缩”叙事占据主导，债市情绪高昂，连续 6 个月处

于牛市行情之中。7 月份开始，国家经济工作重点转向稳增长，9 月，债市确认后续将通过增发国债方式加大稳增长力度，旋即展开调整，这一轮调整持续至 10 月下旬结束。11 月，因为大量增发国债会在短期影响资金面，债券市场一度出现新一轮调整，但很快便确认资金面的影响仅限短期，债券市场迅速结束调整，并于 11 月底开启本轮岁末年初的较大行情。本基金于 12 月成立，在行情开启的早期就参与进去，获取了投资回报。

权益市场，则在各方面风险因素的影响下，全年大部分时候处于下行区间。年初在较强的预期下，外资大幅回流，带动股市春季躁动行情。但随着投资者意识到经济复苏的曲折性，市场开始进入震荡下行阶段，尤其是 8 月后，伴随着市场信心不足和外资的大幅流出，市场下行速度进一步加快。整体而言，市场饱受缺乏增量资金的困扰，存量博弈下全年小盘风格和红利价值风格占优。期间 AI 和中特估等板块也出现过阶段性行情，但整体波动较大。

债券组合部分，本基金全年维持了一定的久期，在获取基础票息收入的同时，进一步获取了一定的债券资本利得收入。权益组合部分，本基金维持了中等偏高的仓位，上半年以食品饮料、机械设备、家电等行业配置为主，下半年则进一步分散了风险暴露，通过更均衡和分散化的持仓配置来地抵御市场波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安君得盈债券 A 基金份额净值为 1.0024 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.26%，同期业绩比较基准收益率为 2.47%；截至报告期末国泰君安君得盈债券 C 基金份额净值为 0.9912 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.66%，同期业绩比较基准收益率为 2.47%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年，随着稳增长经济政策逐步见效，预期利率下降速度将放缓或停止。但是，经济运行中的不确定性仍然很多，政策面可能通过进一步引导贷款利率，尤其是影响房贷利率的 5 年期 LPR 下行来进一步提振经济，因此债券仍将具备比价意义下的投资价值。本基金也将继续维持一定的债券组合久期，在获取相对较高票息的基础上，进一步获取合理的资本利得。股票方面，A 股趋势性的上行可能仍需等待经济和企业盈利预期的实质性扭转，但我们也可以看到政策和监管对市场的呵护力度正在加强。内部看国内稳增长政策仍有加码空间，外部看美联储降息尽管推迟但仍大概率会落地，这都将影响权益市场投资者的风险偏好。伴随着连续三年下行，市场交易层面风险正在出清，预计权益市场在 2024 年会有更多结构性机会。本基金将紧密关注前期充分调整、筹码结构更优的板块与标的，提前做好布局。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从维护基金份额持有人利益、保障基金合规运作角度出发，在合规

文化建设、制度体系建设、合规审查及检查、反洗钱、员工执业行为规范等角度开展工作，不断深化员工的合规意识，推动公司合规文化和内部风险控制机制的完善和优化。

内部监察工作重点包括以下几个方面：

1、合规文化建设。管理人通过内外部合规培训、合规考试、法规解读、法律法规库维护更新、监管会议精神传达等多种形式推动公司合规文化建设，不断提高全体员工合规意识，为公司业务健康发展提供良好的文化土壤。

2、制度体系建设和完善。管理人根据法律法规变化，结合行业新动态，围绕新业务需要，不断优化和健全公司制度体系，并注重相关制度体系的落实和执行。通过制度体系的建设和完善，不断提升了业务管理流程的健全性、规范性、精细化和可操作性，为公司业务规范运营和合规管理进一步夯实了制度基础。

3、合规审查和检查。根据法律法规、监管要求和公司制度规定，做好对公司新业务、新产品、新投资品种及其他创新业务的法律合规及风险控制支持，定期对产品销售、投资、研究及交易等相关业务活动的日常合规性进行检查，查漏补缺。合规检查工作促进了内部控制管理的完善，防范了合规风险的进一步发生。

4、员工执业与投资行为管理。根据法律法规和公司制度要求，管理人不断加强员工执业行为管理。管理人要求新员工入职时需提供和完善个人信息并完成相关投资的申报工作，对投资、交易人员的通讯工具实行交易时间段集中管理，并对监控摄像、电子邮件、电话录音和即时通讯工具聊天记录定期进行合规检查。通过一系列常态化的员工执业和投资行为管理，促进员工执业和投资行为持续符合监管要求。

5、反洗钱合规管理。本报告期内，管理人持续加强反洗钱合规管理，制定反洗钱工作方案，并在年度内推进落实。持续做好日常可疑交易监控排查、客户风险等级划分、修订反洗钱内部控制管理制度、跟进反洗钱系统改造、完成各类反洗钱工作报告、反洗钱金融机构分类评级自评工作等。

管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部合规风控工作的科学性和有效性，努力防范和控制各类风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同的约定进行收益分配。

4.9 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 21322 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国泰君安君得盈债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了国泰君安君得盈债券型证券投资基金(以下简称“国泰君安君得盈债券基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p>

	<p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了国泰君安君得盈债券基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国泰君安君得盈债券基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>国泰君安君得盈债券基金的基金管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估国泰君安君得盈债券基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算国泰君安君得盈债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督国泰君安君得盈债券基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p>

	<p>(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对国泰君安君得盈债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国泰君安君得盈债券基金不能持续经营。</p> <p>(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	薛竞 段黄霖
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2024-03-25

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰君安君得盈债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	4,392,734.45	2,148,609.03
结算备付金		404,515.25	1,492,866.52
存出保证金		17,735.59	15,329.16
交易性金融资产	7.4.7.2	165,927,910.28	235,030,950.61
其中：股票投资		23,088,807.02	26,905,002.00

基金投资		-	0
债券投资		142,839,103.26	208,125,948.61
资产支持证券投资		-	0
贵金属投资		-	0
其他投资		-	0
衍生金融资产		-	0
买入返售金融资产	7.4.7.3	-	0
债权投资		-	0
其中：债券投资		-	0
资产支持证券投资		-	0
其他投资		-	0
应收清算款		-	1,788,209.46
应收股利		-	0
应收申购款		1,068.00	459.98
递延所得税资产		-	0
其他资产	7.4.7.4	-	-
资产总计		170,743,963.57	240,476,424.76
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	0
交易性金融负债		-	0
衍生金融负债		-	0

卖出回购金融资产款		32,032,222.36	45,927,249.57
应付清算款		961,241.47	0
应付赎回款		3,876.05	161,539.84
应付管理人报酬		70,404.15	100,028.64
应付托管费		11,734.07	16,671.45
应付销售服务费		17,709.67	26,434.80
应付投资顾问费		-	0
应交税费		13,930.49	22,339.91
应付利润		-	0
递延所得税负债		-	0
其他负债	7.4.7.5	348,787.84	190,887.94
负债合计		33,459,906.10	46,445,152.15
净资产：			
实收基金	7.4.7.6	137,537,879.54	193,624,421.17
未分配利润	7.4.7.7	-253,822.07	406,851.44
净资产合计		137,284,057.47	194,031,272.61
负债和净资产总计		170,743,963.57	240,476,424.76

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 137,537,879.54 份。其中国泰君安君得盈债券 A 基金份额净值 1.0024 元，基金份额总额 85,292,685.10 份；国泰君安君得盈债券 C 基金份额净值 0.9912 元，基金份额总额 52,245,194.44 份。

7.2 利润表

会计主体：国泰君安君得盈债券型证券投资基金

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	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022
----	-----	---------------------------------------	--------------------------------

		日	年 12 月 31 日
一、营业总收入		2,092,526.19	-21,383,042.10
1. 利息收入		12,918.37	92,073.21
其中：存款利息收入	7.4.7.8	12,918.37	92,073.21
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	0
买入返售金融资产收入		-	0
其他利息收入		-	0
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,146,506.25	-9,216,535.39
其中：股票投资收益	7.4.7.9	-5,639,354.29	-20,189,968.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.10	3,128,881.41	10,352,881.15
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	0
股利收益	7.4.7.11	363,966.63	620,552.25
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-	0
其他投资收益		-	0
3. 公允价值变动收益（损失以“-” 号填列）	7.4.7.12	4,218,074.56	-12,361,258.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	8,039.51	102,678.23
减：二、营业总支出		2,138,032.05	4,124,767.20
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	926,077.99	1,880,191.87
2. 托管费	7.4.10.2.2	154,346.50	313,365.31
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	244,933.77	410,152.74
4. 投资顾问费		-	0

5. 利息支出		599,351.66	1,293,540.66
其中：卖出回购金融资产支出		599,351.66	1,293,540.66
6. 信用减值损失		-	0
7. 税金及附加		20,123.89	34,850.42
8. 其他费用	7.4.7.14	193,198.24	192,666.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-45,505.86	-25,507,809.30
减：所得税费用		-	0
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-45,505.86	-25,507,809.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-45,505.86	-25,507,809.30

7.3 净资产变动表

会计主体：国泰君安君得盈债券型证券投资基金

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	193,624,421.17	406,851.44	194,031,272.61
二、本期期初净资产	193,624,421.17	406,851.44	194,031,272.61
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-56,086,541.63	-660,673.51	-56,747,215.14
（一）、综合收益总额	-	-45,505.86	-45,505.86
（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）	-56,086,541.63	-615,167.65	-56,701,709.28
其中：1. 基金申购款	31,338,498.16	439,754.09	31,778,252.25
2. 基金赎回款	-87,425,039.79	-1,054,921.74	-88,479,961.53
（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	137,537,879.54	-253,822.07	137,284,057.47
项 目	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	418,165,012.95	28,908,104.91	447,073,117.86
加：会计政策变更	-	0	0
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	418,165,012.95	28,908,104.91	447,073,117.86
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-224,540,591.78	-28,501,253.47	-253,041,845.25
(一)、综合收益总额	-	-25,507,809.30	-25,507,809.3
(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)	-224,540,591.78	-2,993,444.17	-227,534,035.95
其中：1. 基金申购款	126,409,003	5,780,639.48	132,189,642.48
2. 基金赎回款	-350,949,594.78	-8,774,083.65	-359,723,678.43
(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)	0	0	0
四、本期期末净资产	193,624,421.17	406,851.44	194,031,272.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

陶耿	庄严	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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国泰君安君得盈债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)由国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划变更而来,国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划由管理人依照《证券公司客户资产管理业务试行办法》(证监会令第17号)、《证券公司集合资产管理业务实施细则》(证监会公告[2008]26号)、《国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划集合资产管理合同》及其他有关规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准设立。

根据中国证监会于2018年11月30日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》(证监会公告〔2018〕39号)的规定,国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。经中国证监会批准,自2021年1月28日起,《国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效,原《国泰君安君得惠二号债券集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》(证监会公告[2018]39号)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等规定及中国证监会《关于准予国泰君

安君得盈债券型集合资产管理计划变更注册的批复》(证监许可[2021]4085号), 国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划于 2022 年 1 月 17 日起正式变更为国泰君安君得盈债券型证券投资基金。

本基金的基金管理人为上海国泰君安证券资产管理有限公司, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金合同》, 本基金根据申购费、销售服务费收取方式等不同, 将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用, 在赎回时根据持有期限收取赎回费用, 但不从本类别基金资产中计提销售服务费的份额类别, 称为 A 类份额; 在投资者申购时不收取申购费用, 在赎回时根据持有期限收取赎回费用, 且从本类别基金资产中计提销售服务费的份额类别, 称为 C 类份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金合同》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, 包括股票(包含主板、创业板及其他依法发行上市的股票)、债券(含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可转换债券、可交换债券、可分离交易债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等债券)、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、国债期货等, 以及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: 债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%; 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, 保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资的信用债评级 AA+(含 AA+) 以上, 其中投资于评级 AA+ 的信用债比例不超过基金信用债资产的 50%; 投资评级 AAA 的信用债比例不低于基金信用债资产的 50%。若无债项评级或者债项评级为 A-1 的, 则以主体评级为准。本产品投资的信用债需有评级满足上述要求。本基金投资于可转换债券、可交换债券、可分离交易债券的比例不超过基金资产的 20%。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制, 基金管理人在履行适当程序后, 可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为: 中债综合财富指数收益率×70%+一年定期存款税后利率×20%+沪深 300 指数收益率×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司于 2024 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 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》、《国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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、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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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、资产支持证券投资和衍生工具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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈

率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人

运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	4,392,734.45	2,148,609.03
等于：本金	4,392,547.40	2,148,341.69
加：应计利息	187.05	267.34
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	0
等于：本金	-	0
加：应计利息	-	0
减：坏账准备	-	0
其中：存款期限 1 个月以内	-	0
存款期限 1-3 个月	-	0
存款期限 3 个月以上	-	0
其他存款	-	0
等于：本金	-	0
加：应计利息	-	0

减：坏账准备	-	-
合计	4,392,734.45	2,148,609.03

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		23,253,666.69	-	23,088,807.02	-164,859.67
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	10,733,226.05	20,445.59	10,834,202.09	80,530.45
	银行间市场	129,244,795.32	2,375,901.17	132,004,901.17	384,204.68
	合计	139,978,021.37	2,396,346.76	142,839,103.26	464,735.13
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		163,231,688.06	2,396,346.76	165,927,910.28	299,875.46
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		29,181,721.57	-	26,905,002.00	-2,276,719.57
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	42,318,428.09	657,759.31	42,586,004.65	-390,182.75
	银行间市场	163,418,996.78	3,372,243.96	165,539,943.96	-1,251,296.78
	合计	205,737,424.87	4,030,003.27	208,125,948.61	-1,641,479.53
资产支持证券		0	0	-	0
基金		0	-	0	0
其他		0	0	-	0
合计		234,919,146.44	4,030,003.27	235,030,950.61	-3,918,199.10

7.4.7.3 买入返售金融资产

7.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	0
应付赎回费	0.07	60.48
应付证券出借违约金	-	0
应付交易费用	189,487.77	31,527.46
其中：交易所市场	175,967.54	23,330.62
银行间市场	13,520.23	8,196.84
应付利息	-	0
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提审计费	30,000.00	30,000.00
预提账户维护费	9,300.00	9,300.00
合计	348,787.84	190,887.94

7.4.7.6 实收基金

国泰君安君得盈债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	114,733,897.22	114,733,897.22
本期申购	29,802,391.38	29,802,391.38
本期赎回（以“-”号填列）	-59,243,603.50	-59,243,603.50
本期末	85,292,685.10	85,292,685.10

国泰君安君得盈债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	78,890,523.95	78,890,523.95
本期申购	1,536,106.78	1,536,106.78
本期赎回（以“-”号填列）	-28,181,436.29	-28,181,436.29
本期末	52,245,194.44	52,245,194.44

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.7 未分配利润

国泰君安君得盈债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,066,113.43	-2,487,364.68	578,748.75
本期期初	3,066,113.43	-2,487,364.68	578,748.75
本期利润	-2,482,102.85	2,552,286.40	70,183.55
本期基金份额交易产生的变动数	-524,440.25	81,337.28	-443,102.97
其中：基金申购款	415,303.69	12,104.44	427,408.13
基金赎回款	-939,743.94	69,232.84	-870,511.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	59,570.33	146,259.00	205,829.33

国泰君安君得盈债券 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	1,534,052.98	-1,705,950.29	-171,897.31
本期期初	1,534,052.98	-1,705,950.29	-171,897.31
本期利润	-1,781,477.57	1,665,788.16	-115,689.41
本期基金份额交易产生的变动数	-295,032.82	122,968.14	-172,064.68
其中：基金申购款	17,962.53	-5,616.57	12,345.96
基金赎回款	-312,995.35	128,584.71	-184,410.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-542,457.41	82,806.01	-459,651.40

7.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	7,108.21	47,940.32
定期存款利息收入	-	0
其他存款利息收入	-	0

结算备付金利息收入	5,578.32	44,132.89
其他	231.84	0
合计	12,918.37	92,073.21

7.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	337,836,720.70	179,235,231.42
减：卖出股票成本总额	342,691,093.25	198,974,360.10
减：交易费用	784,981.74	450,840.11
买卖股票差价收入	-5,639,354.29	-20,189,968.79

7.4.7.10 债券投资收益

7.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	5,853,665.02	10,792,065.37
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,724,783.61	-439,184.22
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	3,128,881.41	10,352,881.15

7.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	272,003,417.31	475,535,285.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	268,813,398.56	469,025,702.13
减：应计利息总额	5,903,200.77	6,933,300.64
减：交易费用	11,601.59	15,466.98
买卖债券差价收入	-2,724,783.61	-439,184.22

7.4.7.11 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	363,966.63	620,552.25
其中：证券出借权益补偿收入	-	0
基金投资产生的股利收益	-	0
合计	363,966.63	620,552.25

7.4.7.12 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	4,218,074.56	-12,645,969.90
——股票投资	2,111,859.90	-5,027,852.57
——债券投资	2,106,214.66	-7,618,117.33
——资产支持证券投资	-	0
——基金投资	-	0
——贵金属投资	-	0
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	0
——权证投资	-	0
3. 其他	-	0
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-284,711.75
合计	4,218,074.56	-12,361,258.15

7.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	8,039.51	102,678.23
合计	8,039.51	102,678.23

7.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023	上年度可比期间 2022 年 01 月
----	---------------------------	---------------------

	年 12 月 31 日	01 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	0
银行汇划费	5,998.24	5,586.20
账户维护费	37,200.00	37,080.00
合计	193,198.24	192,666.20

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 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
中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券	674,599,759.07	100.00%	333,316,744.73	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
国泰君安证券	142,005,105.01	100.00%	171,732,204.32	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰君安证券	112,400,000.00	100.00%	5,639,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的基金交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31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	496,784.43	100.00%	175,967.54	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31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	324,039.29	100.00%	23,330.62	100.00%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	926,077.99	1,880,191.87
其中：应支付销售机构的客户维护费	362,319.56	909,368.41
应支付基金管理人的净管理费	563,758.43	970,823.46

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.6% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	154,346.50	313,365.31

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.2.3 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安君得盈债券 A	国泰君安君得盈债券 C	合计
国泰君安资管	-	87,829.39	87,829.39
国泰君安证券	-	131,945.72	131,945.72

中国建设银行	-	1,742.62	1,742.62
合计	-	221,517.73	221,517.73
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰君安君得盈债券 A	国泰君安君得盈债券 C	合计
国泰君安资管	-	23,579.85	23,579.85
国泰君安证券	-	350,380.18	350,380.18
中国建设银行	-	2,492.67	2,492.67
合计	-	376,452.70	376,452.70

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.4%，销售服务费按前一日 C 类份额的基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行，本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	4,392,734.45	7,108.21	2,148,609.03	47,940.32

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须做说明的其他关联方交易事项。

7.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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 32,032,222.36 元，是以如下债券作为抵押：

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
190205	19 国开 05	2024-01-02	107.74	100,000	10,774,326.03
220208	22 国开 08	2024-01-02	102.27	127,000	12,988,619.65
230203	23 国开 03	2024-01-02	103.67	111,000	11,506,837.81
合计				338,000	35,269,783.49

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，与该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。

7.4.13.2.1 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	8,103,514.75	10,053,843.84
合计	8,103,514.75	10,053,843.84

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政策性金融债。

7.4.13.2.2 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	44,198,864.72	123,905,517.72
AAA 以下	30,332,091.67	63,927,244.58
未评级	60,204,632.12	10,239,342.47
合计	134,735,588.51	198,072,104.77

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政策性金融债、中期票据。

7.4.13.3 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 2023 年 12 月 31 日除卖出回购金融资产款余额中有 32,032,222.36 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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	4,392,734.45	-	-	-	4,392,734.45
结算备付金	404,515.25	-	-	-	404,515.25
存出保证金	17,735.59	-	-	-	17,735.59
交易性金融资产	55,505,064.82	76,559,712.41	10,774,326.03	23,088,807.02	165,927,910.28
应收申购款	-	-	-	1,068.00	1,068.00
资产总计	60,320,050.11	76,559,712.41	10,774,326.03	23,089,875.02	170,743,963.57
负债					
卖出回购金融资产款	32,032,222.36	-	-	-	32,032,222.36
应付清算款	-	-	-	961,241.47	961,241.47
应付赎回	-	-	-	3,876.05	3,876.05

款					
应付管理人报酬	-	-	-	70,404.15	70,404.15
应付托管费	-	-	-	11,734.07	11,734.07
应付销售服务费	-	-	-	17,709.67	17,709.67
应交税费	-	-	-	13,930.49	13,930.49
其他负债	-	-	-	348,787.84	348,787.84
负债总计	32,032,222.36	-	-	1,427,683.74	33,459,906.10
利率敏感度缺口	28,287,827.75	76,559,712.41	10,774,326.03	21,662,191.28	137,284,057.47
上年度末 2022 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	2,148,609.03	0	0	-	2,148,609.03
结算备付金	1,492,866.52	-	-	0	1,492,866.52
存出保证金	15,329.16	-	-	0	15,329.16
交易性金融资产	122,671,747.05	83,454,979.02	1,999,222.54	26,905,002.00	235,030,950.61
应收清算款	-	-	-	1,788,209.46	1,788,209.46
应收申购款	0	-	-	459.98	459.98
资产总计	126,328,551.76	83,454,979.02	1,999,222.54	28,693,671.44	240,476,424.76
负债					
卖出回购金融资产款	45,927,249.57	0	0	-	45,927,249.57
应付赎回款	-	-	-	161,539.84	161,539.84
应付管理人报酬	-	-	-	100,028.64	100,028.64
应付托管费	-	-	-	16,671.45	16,671.45
应付销售服务费	-	-	-	26,434.80	26,434.80
应交税费	-	-	-	22,339.91	22,339.91

其他负债	-	-	-	190,887.94	190,887.94
负债总计	45,927,249.57	-	-	517,902.58	46,445,152.15
利率敏感度缺口	80,401,302.19	83,454,979.02	1,999,222.54	28,175,768.86	194,031,272.61

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。

7.4.13.4.1.2 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	基准利率点利率增加 0.1%	-302,195.16	-217,192.32
	基准利率点利率减少 0.1%	303,484.41	217,400.45

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

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	23,088,807.02	16.82	26,905,002.00	13.87
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	23,088,807.02	16.82	26,905,002.00	13.87

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 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 16.82%(2022 年 12 月 31 日:13.87%)，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（2022 年 12 月 31 日：同）。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	33,923,009.11	38,817,150.21
第二层次	132,004,901.17	196,213,800.40
第三层次	-	0
合计	165,927,910.28	235,030,950.61

7.4.14.2.2 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。本基金本报告期持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	23,088,807.02	13.52
	其中：股票	23,088,807.02	13.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	142,839,103.26	83.66
	其中：债券	142,839,103.26	83.66
	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	4,797,249.70	2.81
8	其他各项资产	18,803.59	0.01
9	合计	170,743,963.57	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	46,882.00	0.03
B	采矿业	355,266.00	0.26
C	制造业	16,375,625.02	11.93

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	692,283.00	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	2,005,656.00	1.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,779,275.00	1.30
J	金融业	850,914.00	0.62
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	320,008.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	346,050.00	0.25
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	316,848.00	0.23
S	综合	-	-
	合计	23,088,807.02	16.82

8.2.2 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。

8.3 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603518	锦泓集团	37,600	376,752.00	0.27
2	688678	福立旺精密	20,200	371,882.00	0.27
3	603739	蔚蓝生物	24,400	371,368.00	0.27
4	002938	鹏鼎控股	16,500	368,280.00	0.27
5	600406	国电南瑞	16,400	366,048.00	0.27
6	000708	中信特钢	26,000	365,040.00	0.27
7	688187	时代电气	10,000	363,300.00	0.26
8	600219	南山铝业	123,100	361,914.00	0.26
9	600362	江西铜业	20,201	360,789.86	0.26
10	300433	蓝思科技	27,300	360,360.00	0.26
11	603839	安正时尚	43,300	359,390.00	0.26
12	000157	中联重科	55,000	359,150.00	0.26
13	600887	伊利股份	13,400	358,450.00	0.26
14	601808	中海油服	24,300	355,266.00	0.26

15	002916	深南电路	5,000	354,950.00	0.26
16	002202	金风科技	44,300	354,400.00	0.26
17	300999	金龙鱼	10,600	353,828.00	0.26
18	300719	安达维尔	26,500	353,245.00	0.26
19	603899	晨光股份	9,400	352,970.00	0.26
20	688132	邦彦技术股份	16,400	351,452.00	0.26
21	300622	博士眼镜	17,700	350,991.00	0.26
22	601628	中国人寿	12,300	348,705.00	0.25
23	300440	运达科技	46,700	347,915.00	0.25
24	603898	好莱客	31,700	347,749.00	0.25
25	600009	上海机场	10,600	347,468.00	0.25
26	600104	上汽集团	25,600	346,368.00	0.25
27	301223	中荣股份	19,100	346,092.00	0.25
28	688265	南方模式生物	9,000	346,050.00	0.25
29	600519	贵州茅台	200	345,200.00	0.25
30	601816	京沪高铁	70,000	344,400.00	0.25
31	002286	保龄宝	42,400	344,288.00	0.25
32	300884	狄耐克	26,300	344,004.00	0.25
33	000990	诚志股份	41,900	343,999.00	0.25
34	300577	开润股份	23,400	343,278.00	0.25
35	603085	天成自控	33,600	342,720.00	0.25
36	603385	惠达卫浴	42,700	342,027.00	0.25
37	002852	道道全	31,600	341,912.00	0.25
38	600115	中国东航	88,000	341,440.00	0.25
39	601607	上海医药	20,400	341,292.00	0.25
40	600196	复星医药	13,600	340,408.00	0.25
41	601238	广汽集团	38,900	340,375.00	0.25
42	688030	山石网科	17,000	340,340.00	0.25
43	600741	华域汽车	20,900	340,252.00	0.25
44	600029	南方航空	58,700	338,112.00	0.25
45	300326	凯利泰	53,400	338,022.00	0.25
46	688098	申联生物医药	45,100	337,348.00	0.25
47	003016	欣贺股份	41,200	336,604.00	0.25
48	600015	华夏银行	59,400	333,828.00	0.24
49	002688	金河生物	69,400	333,814.00	0.24
50	600018	上港集团	67,800	332,220.00	0.24
51	688159	有方科技	8,800	331,320.00	0.24
52	603232	格尔软件	24,200	331,298.00	0.24
53	300381	溢多利	44,700	329,439.00	0.24
54	000800	一汽解放	38,600	328,100.00	0.24
55	002399	海普瑞	27,700	324,921.00	0.24
56	600826	兰生股份	36,200	320,008.00	0.23
57	603096	新经典	16,100	316,848.00	0.23

58	688257	新锐股份	12,554	314,352.16	0.23
59	002730	电光科技	27,700	262,596.00	0.19
60	000877	天山股份	37,800	252,504.00	0.18
61	300830	金现代	29,400	237,258.00	0.17
62	688181	八亿时空液晶股份	8,100	218,700.00	0.16
63	603328	依顿电子	26,800	218,420.00	0.16
64	605208	永茂泰	20,300	192,850.00	0.14
65	300504	天邑股份	9,500	173,755.00	0.13
66	600233	圆通速递	13,700	168,373.00	0.12
67	601998	中信银行	30,700	162,403.00	0.12
68	600637	东方明珠	20,800	156,416.00	0.11
69	605058	澳弘电子	6,600	151,206.00	0.11
70	000910	大亚圣象	16,800	134,400.00	0.10
71	600897	厦门空港	10,700	133,643.00	0.10
72	300695	兆丰股份	2,300	121,808.00	0.09
73	002661	克明食品	11,800	112,454.00	0.08
74	600893	航发动力	2,900	108,402.00	0.08
75	603808	歌力思	8,300	76,111.00	0.06
76	000959	首钢股份	15,300	52,938.00	0.04
77	002982	湘佳股份	2,200	46,882.00	0.03
78	603113	金能科技	2,400	19,368.00	0.01
79	002736	国信证券	700	5,978.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

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	占期初基金资产净值比例(%)
1	300577	开润股份	2,694,763.00	1.39
2	601628	中国人寿	2,553,355.00	1.32
3	002035	华帝股份	2,359,228.00	1.22
4	688509	正元地信	2,236,718.78	1.15
5	688030	山石网科	2,177,370.52	1.12
6	002956	西麦食品	2,136,088.00	1.10
7	603787	新日股份	2,118,167.00	1.09
8	002996	顺博合金	2,073,672.00	1.07
9	002202	金风科技	2,057,889.00	1.06
10	000157	中联重科	2,016,996.00	1.04
11	600741	华域汽车	1,982,364.00	1.02
12	605388	均瑶健康	1,976,567.00	1.02
13	600999	招商证券	1,955,561.00	1.01

14	600690	海尔智家	1,935,025.00	1.00
15	000708	中信特钢	1,889,103.00	0.97
16	600104	上汽集团	1,887,072.00	0.97
17	600229	城市传媒	1,866,247.00	0.96
18	601009	南京银行	1,831,702.00	0.94
19	002730	电光科技	1,817,630.00	0.94
20	603518	锦泓集团	1,756,271.00	0.91

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。

8.4.2 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

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	占期初基金资产净值比例(%)
1	600690	海尔智家	2,404,744.00	1.24
2	300577	开润股份	2,354,384.00	1.21
3	002035	华帝股份	2,307,237.00	1.19
4	688509	正元地信	2,236,208.29	1.15
5	601628	中国人寿	2,159,043.00	1.11
6	002996	顺博合金	2,056,621.00	1.06
7	002956	西麦食品	2,049,025.00	1.06
8	603787	新日股份	2,024,882.00	1.04
9	605388	均瑶健康	1,980,494.00	1.02
10	600999	招商证券	1,972,814.00	1.02
11	601088	中国神华	1,895,537.00	0.98
12	600229	城市传媒	1,866,283.00	0.96
13	688030	山石网科	1,821,385.03	0.94
14	601009	南京银行	1,802,247.00	0.93
15	600519	贵州茅台	1,781,351.00	0.92
16	601238	广汽集团	1,779,537.00	0.92
17	601658	邮储银行	1,703,250.00	0.88
18	000157	中联重科	1,690,437.00	0.87
19	600176	中国巨石	1,671,544.00	0.86
20	600061	国投资本	1,653,172.48	0.85

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。

8.4.3 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	336,763,038.37
卖出股票收入（成交）总额	337,836,720.70

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。

8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,065,401.01	43.75
	其中：政策性金融债	60,065,401.01	43.75
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	71,939,500.16	52.40
7	可转债(可交换债)	10,834,202.09	7.89
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	142,839,103.26	104.05

8.6 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	200,000	20,733,041.10	15.10
2	220208	22 国开 08	200,000	20,454,519.13	14.90
3	190205	19 国开 05	100,000	10,774,326.03	7.85
4	102100042	21 长沙高新 MTN001A	100,000	10,684,112.33	7.78
5	101900910	19 粤铁建 MTN002	100,000	10,234,087.43	7.45

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，并积极采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对国债市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求合理的估值水平，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合整体风险的目的。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	17,735.59
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,068.00
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,803.59

8.12.4 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	113066	平煤转债	1,296,165.62	0.94
2	127058	科伦转债	1,267,709.59	0.92
3	110088	淮 22 转债	1,265,134.52	0.92
4	127012	招路转债	1,259,069.86	0.92
5	113044	大秦转债	1,163,280.14	0.85
6	110061	川投转债	1,083,919.23	0.79
7	113052	兴业转债	662,440.73	0.48
8	127064	杭氧转债	651,115.07	0.47
9	118034	晶能转债	617,695.32	0.45
10	113045	环旭转债	340,897.40	0.25
11	110085	通 22 转债	325,267.97	0.24
12	127056	中特转债	309,905.34	0.23

8.12.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
国泰君安君得盈债券 A	635	134,319.19	29,800,971.65	34.94%	55,491,713.45	65.06%
国泰君安君得盈债券 C	1,549	33,728.34	23,198,926.51	44.40%	29,046,267.93	55.60%

合计	2,184	62,975.22	52,999,898.16	38.53%	84,537,981.38	61.47%
----	-------	-----------	---------------	--------	---------------	--------

9.2 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	国泰君安君得盈债券 A	35,668.13	0.0418%
	国泰君安君得盈债券 C	68,421.42	0.1310%
	合计	104,089.55	0.0757%

注：分类基金基金管理人所有从业人员持有本基金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）。

9.3 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	国泰君安君得盈债券 A	0~10
	国泰君安君得盈债券 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰君安君得盈债券 A	-
	国泰君安君得盈债券 C	0~10
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安君得盈债券 A	国泰君安君得盈债券 C
基金合同生效日（2021 年 01 月 28 日）基金份额总额	52,495,722.43	-
本报告期期初基金份额总额	114,733,897.22	78,890,523.95
本报告期基金总申购份额	29,802,391.38	1,536,106.78
减：本报告期基金总赎回份额	59,243,603.50	28,181,436.29
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	85,292,685.10	52,245,194.44

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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：

2023 年 4 月 8 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关于完成公司法定代表人变更登记的公告》，公司法定代表人变更为陶耿先生，相关工商变更手续已于 2023 年 4 月 6 日在上海市场监督管理局办理完毕。

2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

11.5 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。本基金本年度支付给审计机构普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 3 万元人民币。其为本基金提供审计服务的连续年限为自 2021 年 01 月 28 日（基金合同生效日）至本报告期末。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期无涉及管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期无涉及托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	674,599,759.07	100.00%	496,784.43	100.00%	-

11.7.2 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
国泰君安证券股份有限公司	142,005,105.01	100.00%	112,400,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 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	国泰君安君得盈债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料	证监会指定网站、公司官网	2023-01-16

	概要更新		
2	国泰君安君得盈债券型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2023-01-16
3	国泰君安君得盈债券型证券投资基金招募说明书(更新)(2023年第1号)	证监会指定网站、公司官网	2023-01-16
4	国泰君安君得盈债券型证券投资基金2022年第四季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-01-20
5	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金2022年4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	2023-01-20
6	国泰君安君得盈债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2023-03-16
7	国泰君安君得盈债券型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2023-03-16
8	国泰君安君得盈债券型证券投资基金招募说明书(更新)(2023年第2号)	证监会指定网站、公司官网	2023-03-16
9	国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2023-03-16
10	国泰君安君得盈债券型证券投资基金2022年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-03-31
11	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金2022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	2023-03-31
12	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于完成公司法定代表人变更登记的公告	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	2023-04-08
13	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于调整旗下产品参与直销APP费率优惠活动的公告	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	2023-04-17
14	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金2023年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	2023-04-22
15	国泰君安君得盈债券型证券投资基金2023年第1季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-04-23
16	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金2023年2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	2023-07-21
17	国泰君安君得盈债券型证券投资基金2023年第二季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-07-21

18	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下公募基金的公告	证监会指定网站、公司官网	2023-08-21
19	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下公募基金的公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-08-22
20	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年中期报告提示性公告	上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报	2023-08-31
21	国泰君安君得盈债券型证券投资基金 2023 年中期报告	证监会指定网站、公司官网	2023-08-31
22	国泰君安君得盈债券型证券投资基金 2023 年第三季度报告	证监会指定网站、公司官网	2023-10-25
23	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下基金 2023 年第 3 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	2023-10-25
24	国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、证监会指定网站、公司官网	2023-12-12
25	国泰君安君得盈债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2023-12-12
26	国泰君安君得盈债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2023-12-12
27	国泰君安君得盈债券型证券投资基金招募说明书（更新）（2023 年第 3 号）	证监会指定网站、公司官网	2023-12-12

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划变更注册的批复；
- 2、《国泰君安君得盈债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安君得盈债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安君得盈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。

13.2 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>。

13.3 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
二〇二四年三月二十九日