

国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金

2024 年第 3 季度报告

2024 年 09 月 30 日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年07月01日起至2024年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰君安稳债增利债券发起	
基金主代码	020175	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024年02月06日	
报告期末基金份额总额	242,648,554.46份	
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。	
投资策略	本基金将采取自上而下的投资策略对各种投资工具进行合理的配置。在风险与收益的匹配方面，力求降低信用风险，并在良好控制利率风险与市场风险的基础上力争为投资者获取稳定的收益。	
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率×88%+中证500指数收益率×6%+中证1000指数收益率×6%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国泰君安稳债增利债券发起 A	国泰君安稳债增利债券发起 C
下属分级基金的交易代码	020175	020176
报告期末下属分级基金的份额总额	155,067,908.68份	87,580,645.78份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 07 月 01 日-2024 年 09 月 30 日）	
	国泰君安稳债增利债券发起 A	国泰君安稳债增利债券发起 C
1. 本期已实现收益	963,044.78	564,587.76
2. 本期利润	969,979.53	502,527.62
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0059	0.0044
4. 期末基金资产净值	156,983,680.47	88,429,572.79
5. 期末基金份额净值	1.0124	1.0097

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国泰君安稳债增利债券发起 A 净值表现

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.62%	0.06%	2.22%	0.21%	-1.60%	-0.15%
过去六个月	0.81%	0.05%	2.16%	0.18%	-1.35%	-0.13%
自基金合同 生效起至今	1.24%	0.05%	5.11%	0.20%	-3.87%	-0.15%

国泰君安稳债增利债券发起 C 净值表现

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.51%	0.06%	2.22%	0.21%	-1.71%	-0.15%
过去六个月	0.60%	0.05%	2.16%	0.18%	-1.56%	-0.13%
自基金合同 生效起至今	0.97%	0.05%	5.11%	0.20%	-4.14%	-0.15%

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

国泰君安稳债增利债券发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024年02月06日-2024年09月30日)



注：1、本基金于 2024 年 02 月 06 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。
2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，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。

国泰君安稳债增利债券发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024年02月06日-2024年09月30日)



注：1、本基金于 2024 年 02 月 06 日成立，自合同生效日起至本报告期末不足一年。
2、按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡崇海	<p>国泰君安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理，国泰君安量化选股混合型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安科技创新精选三个月持有期股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安中证 1000 优选股票型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金基金经理，国泰君安科创板量化选股股票型发起式证券投资基金基金经理。现任量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。</p>	2024-02-06	-	13 年	<p>胡崇海，浙江大学数学系运筹学与控制论专业博士。曾任香港科技大学人工智能实验室访问学者，其后加盟方正证券研究所、国泰君安证券咨询部及研究所从事量化对冲模型的研发工作，2014 年加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，先后在量化投资部、权益与衍生品部担任高级投资经理，从事量化投资和策略研发工作，在 Alpha 量化策略以及基于机器学习的投资方面有独到且深入的研究。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部总经理，兼任量化投资部（公募）总经理。</p>

朱莹	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，国泰君安安睿纯债债券型证券投资基金基金经理，国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金基金经理。现任固定收益投资部（公募）基金经理。	2024-02-06	-	4 年	朱莹，上海财经大学经济学学士、国际商务硕士、北卡罗莱纳大学夏洛特分校数理金融硕士、FRM。历任上海东证期货衍生品研究院高级金融工程分析师；2020 年 9 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任固定收益部研究员、投资经理助理，现任公司固定收益投资部（公募）基金经理，主要从事债券投资研究工作。
----	---	------------	---	-----	---

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规、相关规定以及

基金合同、招募说明书约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法违规行为及违反基金合同、招募说明书约定的行为，无侵害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度宏观基本面承压，工业增加值较二季度下滑，价格指数偏弱，核心 CPI 和 PPI 持续下降。出口整体稳定，投资下滑，消费低位震荡。在此背景下，9 月末中央推出一揽子政策刺激经济修复。货币政策宽松，央行实施了有力度的降息，7 月和 9 月降息两次，MLF 累计调降 50bp，OMO 调降 30bp，降准 50bp，并宣布下调存量房贷利率。财政政策积极，政府债发行进度在 8 月和 9 月明显提速，财政部也表示未来将加大财政政策逆周期调节力度。

三季度 A 股出现了巨幅波动，在 9 月底之前市场整体处于阴跌的格局，上证指数一度跌破 2700 点，超出大多数投资者的预期。期间看似阴跌的格局，其实市场内部从 7 月初开始已经悄然发生一些变化，部分前期走出很强动量的股票从 7 月初开始率先进入大幅度回调，从 7 月开始的第一波动量失效对部分量化策略的超额收益带来一些挑战，而从 8 月底开始五大国有银行的深幅调整则宣告了这轮红利资产当中最坚挺的堡垒彻底瓦解，而与此同时创业板指率先见底。在为期三年的价值股行情下，带有高股息属性的大型垄断性国企成为资金青睐的对象，展现出显著的超额收益，总市值排名 A 股前列的垄断性国企大多数创出历史新高，与“跌跌不休”的成长股形成了巨大的反差。这不仅反映了投资者对确定性资产的强烈需求，也揭示了市场在动荡时期的价值回归趋势。然而，从 8 月底开始以创业板指见底为标志性事件，市场风格逐渐从价值转向成长。9 月底，金融三部委国新

办新闻发布会上宣布了一系列利好资本市场的政策，包括创设“证券、基金、保险公司互换便利”和“股票回购增持专项再贷款”等货币工具，大大超出市场预期，稳定了投资者的信心，结合后续国务院其它部委的发布会来看，金融和财政政策的明显转向短期点燃了资本市场的情绪，三季度最后 5 个交易日的走势，几乎逆转了今年股票市场所有的颓势。市场从一个低波、低风险偏好的市场迅速进入高波动和极高风险偏好的市场，带动了整个三季度主要宽基指数均有 16% 以上的收益率，从行业来看非银、房地产和计算机等高 Beta 行业位居涨幅前列，而前期表现良好的防御性行业如石油石化、煤炭和公用事业等则相对滞涨。从风格角度来看，以双创为主的成长股表现更优，在高 Beta 的行情下以 ETF 为主的被动投资大行其道。每一轮股票市场“磨底”的过程都是煎熬的，前期市场的风格有多极致，后续的逆转就有多猛烈。市场内部的风格切换其实已经悄然发生，政策的外力只是加大了风格逆转的剧烈程度。不过，市场急速逆转的程度确实大大超出了投资者的预期，在某种程度上也加大了投资者的操作难度。三季度可转债市场触底后跟随权益大幅反转，在 9 月下旬以来的反转行情中，可转债受到偿债风险化解、正股上涨和增量资金入市等三重利好支撑，表现明显强于信用、利率等纯债品种。三季度债券市场走势略显波折，利率债表现优于信用债，在基本面持续偏弱的背景下，利率债下行动力较大，但为了避免债市风险的累积，央行对于长债的风险管控从第二季度的“喊话”转变为实际操作，央行进行买短卖长的操作维持收益率曲线的陡峭和抑制长债的投机情绪，在此影响下 8 月债券市场出现回调，进而导致固收类产品出现净值回撤，负债端出现波动，9 月在一揽子政策推出后，市场风险偏好大幅提升，在股债跷跷板的影响下债券市场再次出现调整，造成了负债端的进一步承压，信用利差大幅走阔。

报告期内本产品坚持稳健的定位，基于资产配置和风险管理角度低配泛权益资产，在权益市场持续下跌的行情中较好地控制了组合回撤。权益投资方面，在市场一度超过 3 万亿单日成交额的“非理性繁荣”下，我们也要保持一份冷静，过于剧烈的上涨并不具有可持续性，本基金在市场非稳态的情况下谨慎加仓权益类资产，预计等市场相对稳定之后择机再继续加大权益资产的配置。可转债方面报告期内以 AAA 交运、银行、农林牧渔行业转债作为转债部分底仓品种，通过双低、高 YTM 等择券策略优化持仓结构，以严格的信用标准和相对分散的个券配置减少转债尾部风险暴露。债券投资方面本基金优选高等级信用债进行投资配置，阶段性参与利率债交易机会。

展望四季度，央行支持资本市场的货币工具有望进入实质性落地阶段，为市场带来实质性的资金支持，更重要的是相关政策和举措进一步稳定了投资者的信心，当然也包括国际资本。不过我们也要清醒地意识到，每一次市场中长期底部都不是一蹴而就的，在当前复杂的国际政治形势和尚未企稳的经济基本面的现实面前，短期出现较大波动依然是难免的，任何“速胜”的想法都是急功近利的。值得庆幸的是，政府“稳增长”的举措十分坚决，改善市场预期的措施也是坚定的，我们认为市场最艰难的阶段已经成为过去式，市场交投活跃度也已大大改善，后续股票市场的机会大于挑战，A 股市场的投资胜率已经得到较大提升，成长股将接棒价值股逐步推动 A 股走出底部区域。本基金的股票投资部分采用了量化投资组合进行配置，以全市场最大化 Alpha 为目标，均衡配置大中小市值股票，随着市场情绪的不断好转，管理人将适时提升股票投资组合的风险偏好。未来管理人将通过不断提升投研能力，加强管理人内部的沟通协调，继续密切关注各类资产的市场变化，通过

优化大类资产配置来灵活调整本基金的股票投资比例，耐心等待股票端 Alpha 和 Beta 的双重催化，并通过量化投资的方式来捕捉股票市场上涨带来的业绩增厚，致力于为投资者创造稳健且可持续的回报。随着市场预期改善和风险偏好的提升，权益市场底部基本确立，当前仍处于估值低位的转债性价比凸显，我们将适时提升转债仓位配置，为投资者带来更加稳健的投资回报。债券市场虽有波折，但基本面的回暖还有待冷静观察，货币政策环境仍然宽松，我们对债券市场中期不悲观，未来本产品将继续按照投资目标和投资范围，维持中性杠杆水平，同时择机把握利率债交易机会，力争实现账户净值的稳健增长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安债增利债券发起 A 基金份额净值为 1.0124 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.62%，同期业绩比较基准收益率为 2.22%；截至报告期末国泰君安债增利债券发起 C 基金份额净值为 1.0097 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.51%，同期业绩比较基准收益率为 2.22%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，且截至本报告期末，本基金基金合同生效未满 3 年，暂不适用。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	6,711,937.50	2.62
	其中：股票	6,711,937.50	2.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	218,006,009.22	85.08
	其中：债券	218,006,009.22	85.08
	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	31,085,709.08	12.13
8	其他资产	425,145.00	0.17
9	合计	256,228,800.80	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	95,472.00	0.04
B	采矿业	83,334.00	0.03
C	制造业	4,185,478.50	1.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	161,370.00	0.07
E	建筑业	106,815.00	0.04
F	批发和零售业	145,526.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	279,931.00	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	891,608.00	0.36
J	金融业	676,146.00	0.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,536.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	60,601.00	0.02
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	21,120.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	6,711,937.50	2.73

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002410	广联达	6,900	93,288.00	0.04
2	002352	顺丰控股	2,000	89,960.00	0.04
3	601633	长城汽车	2,900	87,899.00	0.04
4	002946	新乳业	7,100	87,614.00	0.04
5	002180	纳思达	2,800	84,924.00	0.03
6	601600	中国铝业	9,500	84,550.00	0.03
7	601555	东吴证券	9,800	82,516.00	0.03
8	002120	韵达股份	9,200	81,788.00	0.03
9	002001	新和成	3,600	81,252.00	0.03
10	601319	中国人保	10,900	81,096.00	0.03

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	153,340,924.89	62.48
	其中：政策性金融债	62,026,357.97	25.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	61,381,291.28	25.01
7	可转债（可交换债）	3,283,793.05	1.34
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	218,006,009.22	88.83

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	210203	21 国开 03	300,000	31,220,013.70	12.72
2	210218	21 国开 18	200,000	20,512,836.07	8.36
3	2428002	24 平安银行 三农债 01	200,000	20,458,872.13	8.34
4	212380005	23 光大银行 债 01	200,000	20,369,772.05	8.30

5	102281141	22 新长宁 MTN001	200,000	20,270,436.1 6	8.26
---	-----------	------------------	---------	-------------------	------

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金可投资国债期货。若本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，综合考虑流动性、基差水平、与债券组合相关度等因素，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)					-
国债期货投资本期收益(元)					72,859.52
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金持有的前十名证券发行主体国家开发银行，2023 年 12 月因不正当方式影响市场价格，被银行间市场交易商协会启动自律调查。

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

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

本基金持有的前十名证券发行主体中国光大银行股份有限公司，2024 年 5 月因内部控制不严，被国家金融监督管理总局地方监管局罚款。

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

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	425,145.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	425,145.00

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113044	大秦转债	213,764.50	0.09

2	111014	李子转债	207,143.75	0.08
3	127049	希望转 2	202,397.78	0.08
4	123063	大禹转债	161,856.29	0.07
5	113634	珀莱转债	134,340.96	0.05
6	110079	杭银转债	133,766.83	0.05
7	113647	禾丰转债	129,528.19	0.05
8	113050	南银转债	125,705.05	0.05
9	110075	南航转债	118,956.39	0.05
10	127083	山路转债	116,655.50	0.05
11	111009	盛泰转债	112,739.88	0.05
12	113052	兴业转债	109,457.32	0.04
13	118031	天 23 转债	85,613.05	0.03
14	128138	侨银转债	64,310.38	0.03
15	127022	恒逸转债	59,413.53	0.02
16	113632	鹤 21 转债	47,599.99	0.02
17	113652	伟 22 转债	43,753.40	0.02
18	123119	康泰转 2	42,809.16	0.02
19	110085	通 22 转债	41,192.00	0.02
20	118022	锂科转债	40,007.62	0.02
21	113048	晶科转债	38,562.13	0.02
22	110086	精工转债	36,182.43	0.01
23	127084	柳工转 2	32,709.96	0.01
24	113641	华友转债	31,238.10	0.01
25	113060	浙 22 转债	28,042.17	0.01
26	113055	成银转债	25,783.05	0.01
27	113061	拓普转债	24,406.78	0.01
28	127086	恒邦转债	23,870.06	0.01
29	123114	三角转债	23,841.62	0.01
30	127018	本钢转债	23,805.78	0.01
31	128141	旺能转债	23,747.17	0.01
32	113062	常银转债	23,619.11	0.01
33	118013	道通转债	23,563.06	0.01
34	127045	牧原转债	23,134.20	0.01
35	113045	环旭转债	23,100.24	0.01
36	110073	国投转债	23,043.37	0.01
37	110093	神马转债	22,912.49	0.01
38	113065	齐鲁转债	22,788.65	0.01
39	127040	国泰转债	22,699.95	0.01
40	113042	上银转债	22,696.62	0.01
41	110062	烽火转债	22,612.28	0.01
42	113049	长汽转债	22,562.63	0.01
43	123133	佩蒂转债	22,560.65	0.01
44	123104	卫宁转债	22,320.45	0.01

45	113659	莱克转债	22,261.15	0.01
46	127016	鲁泰转债	22,242.08	0.01
47	110089	兴发转债	22,183.35	0.01
48	128117	道恩转债	22,169.98	0.01
49	110076	华海转债	21,670.56	0.01
50	127030	盛虹转债	21,537.50	0.01
51	113056	重银转债	21,509.76	0.01
52	127056	中特转债	21,454.01	0.01
53	113625	江山转债	21,375.44	0.01
54	113584	家悦转债	21,281.11	0.01
55	113066	平煤转债	21,109.57	0.01
56	128129	青农转债	20,974.15	0.01
57	113657	再 22 转债	20,970.47	0.01
58	113054	绿动转债	20,920.14	0.01
59	111010	立昂转债	20,861.56	0.01
60	127025	冀东转债	20,706.59	0.01
61	113067	燃 23 转债	20,661.27	0.01
62	113059	福莱转债	20,541.94	0.01
63	128135	洽洽转债	20,437.30	0.01
64	113053	隆 22 转债	20,365.73	0.01
65	110087	天业转债	20,078.50	0.01
66	118034	晶能转债	19,846.42	0.01
67	127089	晶澳转债	17,819.95	0.01

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安稳债增利债券发起 A	国泰君安稳债增利债券发起 C
报告期期初基金份额总额	179,884,696.78	152,742,124.56
报告期期间基金总申购份额	18,026,841.72	23,664,521.70
减：报告期期间基金总赎回份 额	42,843,629.82	88,826,000.48
报告期期间基金拆分变动份 额 (份额减少以“-”填列)	-	-

报告期期末基金份额总额	155,067,908.68	87,580,645.78
-------------	----------------	---------------

注：基金总申购份额含红利再投资及转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	国泰君安稳债增利债券发起 A	国泰君安稳债增利债券发起 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,009,450.45	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,009,450.45	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	6.45	-

注：本报告期期末基金管理人持有的本基金份额占基金总份额比例，分类基金比例的分母采用基金分类份额计算。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,009,450.45	4.13%	10,009,450.45	4.13%	自基金合同生效日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	997,324.97	0.41%	-	-	-
基金经理等人员	56,070.54	0.02%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	12,007.35	0.00%	-	-	-
合计	11,074,853.3	4.56%	10,009,450.4	4.13%	-

	1		5	
--	---	--	---	--

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、法律意见书；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.gtjazg.com>。

10.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

上海国泰君安证券资产管理有限公司

二〇二四年十月二十五日