

**国泰安璟债券型证券投资基金**  
**2023 年第 4 季度报告**  
**2023 年 12 月 31 日**

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年一月二十二日

§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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2024 年 01 月 18 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 2023 年 10 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                 |
|------------|-----------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 国泰安璟债券                                                          |
| 基金主代码      | 016419                                                          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                          |
| 基金合同生效日    | 2023 年 1 月 17 日                                                 |
| 报告期末基金份额总额 | 204,168,961.63 份                                                |
| 投资目标       | 在注重风险和流动性管理的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。                              |
| 投资策略       | 1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、股票投资策略；4、港股通标的股票投资策略；5、存托凭证投资策略；6、国债期货投资策略。 |
| 业绩比较基准     | 中债综合财富（总值）指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+恒生综合指数收益率（经汇率调整后）×5%       |
| 风险收益特征     | 本基金为债券型基金，理论上预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。本基金投              |

|                 |                                                     |                 |
|-----------------|-----------------------------------------------------|-----------------|
|                 | 资港股通标的股票时，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |                 |
| 基金管理人           | 国泰基金管理有限公司                                          |                 |
| 基金托管人           | 平安银行股份有限公司                                          |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 国泰安璟债券 A                                            | 国泰安璟债券 C        |
| 下属分级基金的交易代码     | 016419                                              | 016420          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 136,733,227.73 份                                    | 67,435,733.90 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<br>(2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日) |               |
|----------------|-------------------------------------------|---------------|
|                | 国泰安璟债券 A                                  | 国泰安璟债券 C      |
| 1.本期已实现收益      | -70,527.35                                | -75,879.97    |
| 2.本期利润         | -290,298.00                               | -565,924.61   |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0030                                   | -0.0062       |
| 4.期末基金资产净值     | 135,055,748.87                            | 66,666,698.79 |
| 5.期末基金份额净值     | 0.9877                                    | 0.9886        |

注：(1)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。

(2)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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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

##### 1、国泰安璟债券 A：

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①－③    | ②－④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -0.47%     | 0.11%         | 0.21%          | 0.14%                 | -0.68% | -0.03% |
| 过去六个月          | -1.47%     | 0.14%         | 0.14%          | 0.14%                 | -1.61% | 0.00%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -1.23%     | 0.14%         | 1.26%          | 0.14%                 | -2.49% | 0.00%  |

2、国泰安璟债券 C：

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①－③    | ②－④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -0.51%     | 0.11%         | 0.21%          | 0.14%                 | -0.72% | -0.03% |
| 过去六个月          | -1.53%     | 0.14%         | 0.14%          | 0.14%                 | -1.67% | 0.00%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -1.14%     | 0.14%         | 1.26%          | 0.14%                 | -2.40% | 0.00%  |

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

国泰安璟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的历史走势对比图  
 (2023 年 1 月 17 日至 2023 年 12 月 31 日)

1. 国泰安璟债券 A：

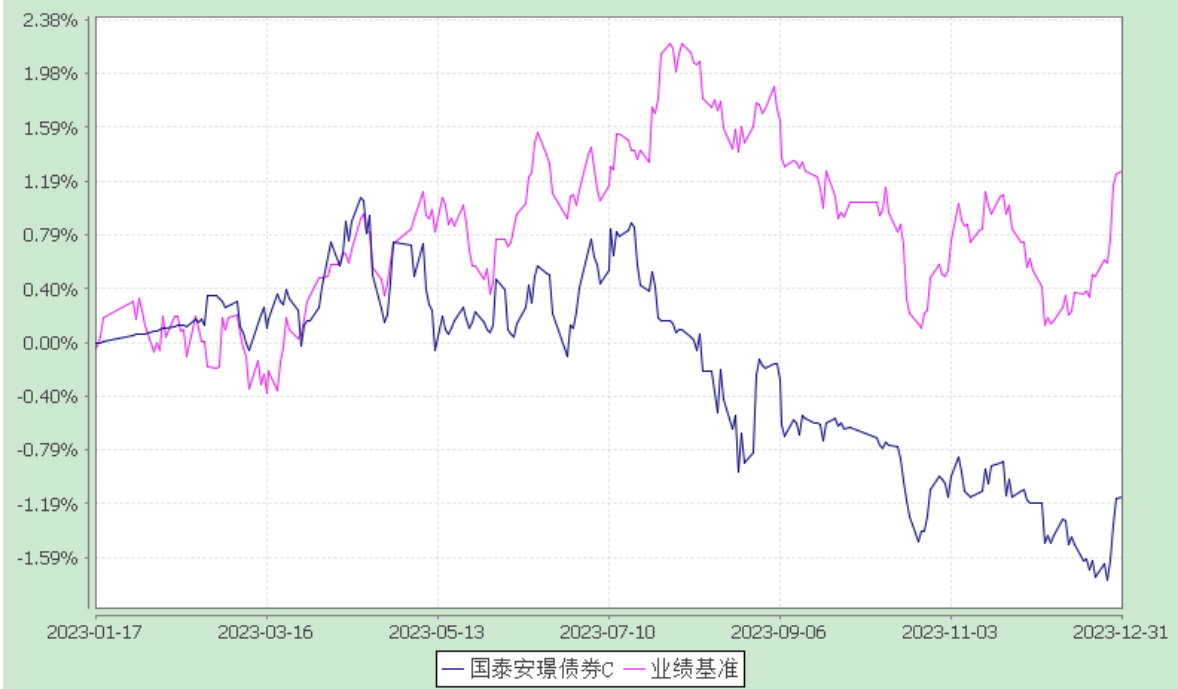


注：(1)本基金合同生效日为 2023 年 1 月 17 日，截止到 2023 年 12 月 31 日，本基金成立尚

未满一年。

(2)本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

2. 国泰安璟债券 C:



注：(1)本基金合同生效日为 2023 年 1 月 17 日，截止到 2023 年 12 月 31 日，本基金成立尚  
未满一年。

(2)本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

§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<br>限 |      | 证券从业<br>年限 | 说明                                                                                                                                       |
|-----|-----------------------------------------------|-----------------|------|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                               | 任职日期            | 离任日期 |            |                                                                                                                                          |
| 樊利安 | 国泰浓<br>益灵活<br>配置混<br>合、国<br>泰民益<br>灵活配<br>置混合 | 2023-01-17      | -    | 18 年       | 硕士。曾任职上海鑫地投资管理有<br>限公司、天治基金管理有限公司<br>等。2010 年 7 月加入国泰基金，<br>历任研究员、基金经理助理。2014<br>年 10 月起任国泰民益灵活配置混<br>合型证券投资基金（LOF）（原国<br>泰淘新灵活配置混合型证券投资 |

|  |                                                                                          |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>(LOF)、国泰融丰外延增长灵活配置混合(LOF)、国泰宏益一年持有期混合、国泰浩益混合、国泰科创板两年定期开放混合、国泰安璟债券、国泰慧益一年持有混合的基金经理</p> |  |  | <p>基金)和国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年1月至2018年8月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年3月至2019年1月任国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年5月至2020年5月任国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年6月至2019年12月任国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年6月至2018年2月任国泰生益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2015年6月至2017年1月任国泰金泰平衡混合型证券投资基金(由金泰证券投资基金转型而来)的基金经理,2016年5月至2017年11月任国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年8月至2018年8月任国泰添益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年10月至2018年4月任国泰福益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年11月至2018年12月任国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年12月至2019年12月任国泰普益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年12月至2020年5月任国泰安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年12月至2018年3月任国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年12月至2018年5月任国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年12月至2018年6月任国泰景益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年12月至2018年8月任国泰信益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理,2016年12月至2018年9月任国泰丰益</p> |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  | <p>灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 5 月任国泰嘉益灵活配置混合型证券投资基金、国泰众益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 9 月任国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 7 月至 2018 年 11 月任国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 7 月至 2018 年 9 月任国泰稳益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月至 2018 年 9 月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 11 月起兼任国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）的基金经理，2018 年 1 月至 2018 年 5 月任国泰瑞益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月至 2018 年 8 月任国泰恒益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 9 月至 2020 年 8 月任国泰融信灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来）的基金经理，2019 年 5 月至 2020 年 6 月任国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金和国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019 年 8 月至 2020 年 10 月任国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 6 月起兼任国泰宏益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理，2020 年 8 月至 2022 年 2 月任国泰浩益 18 个月封闭运作混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 4 月至 2023 年 11 月任国泰同益 18 个月持有期混合型证券</p> |
|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>投资基金的基金经理，2022 年 2 月起兼任国泰浩益混合型证券投资基金（由国泰浩益 18 个月封闭运作混合型证券投资基金变更而来）和国泰科创板两年定期开放混合型证券投资基金的基金经理，2023 年 1 月起兼任国泰安璟债券型证券投资基金的基金经理，2023 年 8 月起兼任国泰慧益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月至 2016 年 1 月任研究部副总监，2016 年 1 月至 2018 年 7 月任研究部副总监（主持工作），2018 年 7 月至 2019 年 7 月任研究部总监。</p> |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

#### 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，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

#### 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，本基金管理人严格遵守《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，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，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，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。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。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年四季度，市场处于持续弱势调整过程中。高股息板块也仅仅煤炭有持续较好表现，成长板块电子和医药相对较强，房地产相关行业、电力设备与新能源、泛消费板块表现不佳。最终上证指数下跌 4.36%，深证成指下跌 5.79%，创业板指下跌 5.62%。从申万一级行业来看，煤炭、电子、农业表现较好，逆市上涨，而美容护理、房地产、建材三个行业下跌幅度超过 14%。从风格来看，上证 50、沪深 300 等大盘股指数跑输中证 1000、国证 2000 等小盘股指数。

四季度以来国内经济表现依然疲弱，地产销售降幅再度走扩，基建及制造业投资增速放缓，社零增速因基数原因同比持续回升，进出口温和恢复。因能源价格转降、食品价格降幅扩大导致 CPI、PPI 二次探底。10 年美债收益率及美元指数在创出本轮新高后，四季度开始回落，人民币汇率在 7.3 附近获得支撑，并有小幅升值。北向资金四季度净流出 600 多亿元，比三季度有所减少。尽管三季度政府出台了多项提振资本市场的直接或间接措施，但效果短期并不显著，从市场表现来看，投资者仍然担忧房地产行业对经济的拖累。成长行业中四季度表现较好的电子、汽车等板块主要是华为相关产业链新产品周期的推动。医药行业则受益于医疗反腐短期冲击结束以及创新药新产品周期的带动。

本基金以绝对收益策略为主，在股票方面，四季度继续保持较低仓位运行，继续降低了成长行业仓位，增加了高股息以及医药行业品种的配置，提高了组合的防御性。债券方面，本基金主要以高等级信用债票息策略为主。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类本报告期内的净值增长率为-0.47%，同期业绩比较基准收益率为 0.21%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为-0.51%，同期业绩比较基准收益率为 0.21%。

## 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，我们对国内经济和资本市场表现相对乐观。宏观经济方面，库存周期的回升和稳增长政策的再加码，以及地产“三大工程”的落地，将使得国内经济企稳改善。美国经济高位下行难以避免，2024 年将进入降息周期，人民币汇率将保持稳定偏强。同时 A 股大部分行业经过过

去两年的调整，行业供需关系上都得到了较大程度的改善。大部分行业估值水平也回到了历史相对较低位置。

站在目前上证指数 3000 点以下的位置，我们认为 A 股市场有望出现震荡回升的走势。我们看好的方向包括以下几个方面：消费电子行业和 AI 硬件的创新周期，半导体行业去库存完成及国产化替代；人工智能在各行业应用带来的行业经营模式变革；医药行业中的创新药周期以及创新疫苗、耗材等；同时我们也继续看好煤炭、石化、大银行、高速公路等高股息板块表现。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### §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              | 26,085,271.55  | 11.63        |
|    | 其中：股票             | 26,085,271.55  | 11.63        |
| 2  | 固定收益投资            | 151,922,765.42 | 67.72        |
|    | 其中：债券             | 151,922,765.42 | 67.72        |
|    | 资产支持证券            | -              | -            |
| 3  | 贵金属投资             | -              | -            |
| 4  | 金融衍生品投资           | -              | -            |
| 5  | 买入返售金融资产          | -2,572.23      | 0.00         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -              | -            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 25,647,062.70  | 11.43        |
| 7  | 其他各项资产            | 20,698,646.65  | 9.23         |
| 8  | 合计                | 224,351,174.09 | 100.00       |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 5,011,895.00  | 2.48         |
| C  | 制造业              | 16,308,907.31 | 8.08         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | 321,816.00    | 0.16         |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 775,764.12    | 0.38         |
| J  | 金融业              | 1,089,224.00  | 0.54         |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 775,076.12    | 0.38         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 452,925.00    | 0.22         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |
| P  | 教育               | 1,349,664.00  | 0.67         |
| Q  | 卫生和社会工作          | -             | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -             | -            |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 26,085,271.55 | 12.93        |

## 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  | 000603 | 盛达资源 | 157,300 | 1,738,165.00 | 0.86         |
| 2  | 002607 | 中公教育 | 330,800 | 1,349,664.00 | 0.67         |
| 3  | 601058 | 赛轮轮胎 | 96,500  | 1,133,875.00 | 0.56         |
| 4  | 600988 | 赤峰黄金 | 79,000  | 1,106,790.00 | 0.55         |
| 5  | 688531 | 日联科技 | 10,784  | 1,090,046.72 | 0.54         |
| 6  | 301035 | 润丰股份 | 15,500  | 1,085,000.00 | 0.54         |
| 7  | 601233 | 桐昆股份 | 68,600  | 1,037,918.00 | 0.51         |

|    |        |      |        |              |      |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
| 8  | 605377 | 华旺科技 | 54,200 | 1,034,678.00 | 0.51 |
| 9  | 000333 | 美的集团 | 18,000 | 983,340.00   | 0.49 |
| 10 | 300373 | 扬杰科技 | 24,300 | 891,810.00   | 0.44 |

#### 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      | 43,917,121.10  | 21.77        |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | -              | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | 66,100,146.84  | 32.77        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 40,896,123.44  | 20.27        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,009,374.04   | 0.50         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 151,922,765.42 | 75.31        |

#### 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  | 019709    | 23 国债 16       | 184,000 | 18,496,284.93 | 9.17         |
| 2  | 019678    | 22 国债 13       | 145,000 | 14,670,345.21 | 7.27         |
| 3  | 019703    | 23 国债 10       | 106,000 | 10,750,490.96 | 5.33         |
| 4  | 102380274 | 23 兴泰金融 MTN001 | 100,000 | 10,415,974.79 | 5.16         |
| 5  | 175289    | 20 常城 06       | 100,000 | 10,305,676.71 | 5.11         |

#### 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

本基金本报告期内未投资股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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   | 31,357.76     |
| 2  | 应收证券清算款 | 20,667,288.89 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 20,698,646.65 |

##### 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  | 127049 | 希望转 2 | 1,009,374.04 | 0.50         |

### 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

| 项目             | 国泰安璟债券A        | 国泰安璟债券C       |
|----------------|----------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额   | 101,029,016.86 | 70,049,224.78 |
| 报告期期间基金总申购份额   | 47,751,255.03  | 30,193,236.72 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 12,047,044.16  | 32,806,727.60 |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -              | -             |
| 本报告期期末基金份额总额   | 136,733,227.73 | 67,435,733.90 |

## §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

|                          |               |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 19,999,000.00 |
| 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         | 19,999,000.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 9.80          |

### 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，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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              | 2023 年 10 月 09         | 29,910, | 30,193, | 22,644,92 | 37,458,578.3 | 18.35% |

|                                                               |  |                        |        |        |      |   |  |
|---------------------------------------------------------------|--|------------------------|--------|--------|------|---|--|
|                                                               |  | 日至 2023 年 12 月<br>28 日 | 269.19 | 236.72 | 7.54 | 7 |  |
| 产品特有风险                                                        |  |                        |        |        |      |   |  |
| 当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。 |  |                        |        |        |      |   |  |

## 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰安璟债券型证券投资基金注册的批复
- 2、国泰安璟债券型证券投资基金基金合同
- 3、国泰安璟债券型证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

### 9.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层。

基金托管人住所。

### 9.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司  
二〇二四年一月二十二日