

国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金
(FOF)

2024 年第 1 季度报告

2024 年 03 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:中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期:2024 年 04 月 22 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年04月17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01月01日起至2024年03月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)
基金主代码	019419
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年12月08日
报告期末基金份额总额	10,009,000.00份
投资目标	在合理控制风险的前提下，通过稳定的资产配置和精细化优选基金，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金采取积极的资产配置策略，通过宏观策略研究，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，精选基金品种，构建有超额收益能力的基金组合。同时通过有效地风险管理，降低业绩的波动性，获得稳定而持续的投资收益。</p> <p>2、基金投资策略</p> <p>（1）开放式基金投资策略</p> <p>在开放式基金的投资选择上，更倾向于挑选中长期主动管理能力得到验证的优质基金产品进行配置。在具体选择维度上分为基金公司、基金经理、基金产品三个方向，进行定量和定性的合理分析，筛选出超额收益稳定的基金产品进入组合配置。</p> <p>1) 在基金公司维度，主要考虑的因素有：基金公司的股东背景、公司治理、核心管理团队的综合素质和稳定性、基金经理与投研团队的综合素质和稳定性、公司管理的资产规模和</p>

	<p>盈利能力、管理层的管理风格、投资决策程序的科学性和执行度、公司风险控制制度健全性和执行力度、公司基金的类型和收益情况、公司基金交叉持股情况、基金公司产品创新能力及客户服务水平等。评价方式主要来自于实地调研、公司刊物和公开信息。</p> <p>2) 基金经理维度，对基金经理的从业经验、业绩表现、风险控制、业绩归因、风格特征等多个层面全方位地进行分析，定量和定性相结合，并通过持续跟踪保持更新。该体系从多种维度对基金经理的风格特征加以剖析，包括但不限于：组合构建思路、选股偏好、擅长投资领域、投资集中度、换手率情况等。</p> <p>3) 基金产品维度，重点考量首先根据基金的历史业绩情况，挑选出业绩持续优秀的基金，根据基金的风险收益特征，构建合适的基金投资组合。通过风险收益综合评价方法挖掘持续稳定的基金品种，主要包括选股能力、择时能力、风险控制能力等指标。</p> <p>（2）场内 ETF 等基金投资策略</p> <p>场内 ETF 等基金评价中更多考虑业绩持续性和市场因素的影响。通过对基金规模、流动性、跟踪误差、交易成本，以及 ETF 所跟踪指数的综合评价挑选适合的 ETF 投资标的，再根据市场波动因素的变化在适当时机完成基金的买入或卖出操作。</p> <p>3、股票的投资策略</p> <p>通过分析宏观经济、产业政策和行业景气程度，以证监会行业分类标准为基础，挑选出增长前景持续向好的行业或周期景气复苏或上升的行业。通过定性和定量分析精选个股。定量分析使用的指标包括成长指标、价值指标和盈利指标，针对不同行业采取相应的估值方法；定性分析对精选公司进行“波特五力模型”分析，结合行业估值模型进行数量化的辅助投资决策。</p> <p>4、债券的投资策略</p> <p>本基金将采取久期偏离、收益率曲线配置和类属配置、无风险套利、杠杆策略和个券选择策略等投资策略，发现、确认并利用市场失衡实现组合增值。在综合考虑流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上，评估债券投资价值，选择定价合理或者价值被低估的债券构建投资组合，并根据市场变化情况对组合进行优化。</p> <p>5、资产支持证券等品种投资策略</p> <p>资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将深入分析上述基本面因素，并辅助数量化定价模型，评估其内在价值。</p> <p>6、存托凭证投资策略</p>
--	---

	<p>在控制风险的前提下，本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>7、可转换债券、可交换债券的投资策略</p> <p>本基金将对可转换债券、可交换债券对应的基础股票进行深入分析与研究，重点选择有较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转换债券、可交换债券，并在对应可转换债券、可交换债券估值合理的前提下进行投资，以分享正股上涨带来的收益。同时，本基金还将密切跟踪上市公司的经营状况，从财务压力、融资安排、未来的投资计划等方面推测、并通过实地调研等方式确认上市公司对转股价的修正和转股意愿。</p> <p>8、未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>	
业绩比较基准	中债新综合指数（财富）收益率*90%+中证 800 指数收益率*10%	
风险收益特征	本基金为债券型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金，低于混合型基金、混合型基金中基金、股票型基金和股票型基金中基金。	
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	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起 (FOF) A	国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起 (FOF) C
下属分级基金的交易代码	019419	019420
报告期末下属分级基金的份额总额	8,009,000.00 份	2,000,000.00 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 01 月 01 日-2024 年 03 月 31 日）	
	国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起 (FOF) A	国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起 (FOF) C
1. 本期已实现收益	7,591.74	394.51
2. 本期利润	64,798.25	14,671.48
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0081	0.0073
4. 期末基金资产净值	8,095,341.59	2,019,672.21
5. 期末基金份额净值	1.0108	1.0098

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

国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)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	0.81%	0.03%	1.98%	0.12%	-1.17%	-0.09%
自基金合同 生效起至今	1.08%	0.03%	2.97%	0.11%	-1.89%	-0.08%

国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)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	0.73%	0.03%	1.98%	0.12%	-1.25%	-0.09%
自基金合同 生效起至今	0.98%	0.03%	2.97%	0.11%	-1.99%	-0.08%

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

国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)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

(2023年12月08日-2024年03月31日)



注：1、本基金于2023年12月08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，截止本报告期末基金成立未

六个月。

国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)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
(2023年12月08日-2024年03月31日)



注：1、本基金于2023年12月08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，截止本报告期末基金成立未满足六个月。

§ 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		
高琛	国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金(FOF)基金经理, 国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金经理, 国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)基金经理。现任基金投资部基	2023-12-08	-	13年	高琛, 华东理工大学工商管理硕士。曾任上海证券基金评价分析师、金融实验室负责人, 国泰君安资产管理业务委员会执行办董事。2019年4月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司, 现担任基金投资部基金经理。

金经理。				
------	--	--	--	--

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。

4.1.1 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，无侵害计划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 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾：

海外方面，一季度美国经济增长保持了较强韧性，受此支撑，美股走势强劲，标普 500 指数大涨 10.16%。油、金、铜等大宗商品价格强劲上升，同时美国 3 月消费者价格指数（CPI）同比上涨 3.5% 超市场预期，市场预期美联储首次降息时间从 6 月推迟到 9 月，年内预期降息次数也从 3 次降

至 2 次。

国内方面，随着外需走强，出口增速有所恢复，节假日期间旅游出行、电影票房等数据也有较强增长。制造业 PMI 数据在 3 月也明显走强至 50.80%。新房销售增速疲弱，仍是经济增长最大拖累项。在经济弱复苏形势下，一线城市房产限购政策放松及设备以旧换新等刺激政策陆续出台，预计将对经济增长形成一定支撑。

权益市场方面，一季度 A 股先抑后扬，呈现 V 型走势。1 月至 2 月初因市场下跌导致部分场外金融衍生品被动平仓，市场迅速下跌，中小市值板块调整幅度更大。2 月以后随着监管的迅速回应市场迅速反弹并重合 3000 点上方。煤炭、银行、家电、石油石化等行业表现相对靠前。

债券市场方面，年初债市大幅走高，经济疲弱配合权益市场的风险释放是债市走强的主要原因。3 月以来，随着权益市场的维稳见效以及 PMI 超预期，债券市场出现了一定幅度的调整。但由于经济基本面仍相对较弱，且实体信用需求弱以及通胀未见到明显反转，债市并未出现显著上行。

善怡：本季度组合处于建仓期，其中 80%以上资产投资于债券基金。从基金配置上来看，债基部分以纯债基金为主，少量配置含权低波动债基；风险类资产方面，主要为权益基金、黄金 ETF。

展望：

权益方面，总体上权益市场估值仍处于偏低的阶段，再加上除地产外的经济增长具有较强韧性，权益资产目前处于较高赔率，胜率提升的阶段，相较债券有较高性价比，我们对后市仍保持相对乐观。配置结构上建议重点关注以下方向：1）经济弱复苏阶段，维持原有哑铃策略，使得组合保持相对均衡。两端结构向泛成长中景气提升的子板块（互联网、消费、新能源等）和泛价值中具有质量特征的子板块（电力、出口链、顺周期板块等）倾斜；2）红利和周期资源品，此类品种具有供给端逻辑，在利率中枢持续下移的背景下，高股息率依然有一定配置价值，且随着经济进一步复苏，预计收入和盈利会有进一步显著的增长；3）受益于流动性宽松环境和新质生产力产业逻辑的板块，包括科技、医药、机器人、低空经济、智能汽车等，未来有可能成为市场阶段性主线。

债市方面，我们对债券市场持中性态度。预计随着 4 月份各项经济数据公布，政策大概率会维持偏宽松的基调，并对市场形成支撑。同时我们也看到，海外经济依然呈现出较强的韧性，未来如果人民币汇率压力加大，可能会对央行货币政策形成扰动，从而给债券市场带来一定的波动。但中长期看仍有配置价值，资产荒仍是债市投资的核心逻辑。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF) A 基金份额净值为 1.0108 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.81%，同期业绩比较基准收益率为 1.98%；截至报告期末国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起(FOF)C 基金份额净值为 1.0098 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.73%，同期业绩比较基准收益率为 1.98%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	9,540,349.10	94.21
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	586,115.98	5.79
8	其他资产	95.85	0.00
9	合计	10,126,560.93	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

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没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公

开谴责、处罚的情况。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	-
6	其他应收款	95.85
7	其他	-
8	合计	95.85

5.11.4 报告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。

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 基金中基金

6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资 产净值比 例(%)	是否属于 基金管理 人及管理 人关联方 所管理的 基金
1	952001	国泰君安 君得利短 债 A	契约型开 放式	715,468.1 9	754,031.9 3	7.45	是
2	013281	国泰君安 30 天滚动	契约型开 放式	601,330.3 7	655,750.7 7	6.48	是

		持有中短债 A					
3	003847	华安鼎丰债券发起式 A	契约型开放式	396,228.67	457,564.87	4.52	否
4	008207	国泰合融纯债债券 A	契约型开放式	418,548.31	456,510.64	4.51	否
5	015809	国泰君安君添利中短债发起 A	契约型开放式	429,621.25	456,429.62	4.51	是
6	530021	建信纯债债券 A	契约型开放式	283,255.82	456,268.47	4.51	否
7	006989	建信中短债纯债债券 A	契约型开放式	429,504.51	456,004.94	4.51	否
8	003949	兴全稳泰债券 A	契约型开放式	390,899.74	455,984.55	4.51	否
9	005725	国投瑞银恒泽中短债债券 A	契约型开放式	410,157.92	455,685.45	4.51	否
10	003265	招商招坤纯债 A	契约型开放式	345,160.27	453,713.17	4.49	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 03 月 31 日	其中：交易及持有基金管理人以及 管理人关联方所管理基金产生的 费用
当期交易基金产生的申购费 (元)	739.45	-
当期交易基金产生的赎回费 (元)	-	-
当期持有基金产生的应支付 销售服务费(元)	254.24	94.58
当期持有基金产生的应支付 管理费(元)	7,010.66	1,174.88
当期持有基金产生的应支付 托管费(元)	2,131.97	267.94
当期交易基金产生的交易费 (元)	7.46	-

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基

金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

	国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起 (FOF) A	国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起 (FOF) C
报告期期初基金份额总额	8,009,000.00	2,000,000.00
报告期期间基金总申购份额	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	8,009,000.00	2,000,000.00

注：本报告期内本基金份额无份额变动情况。

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起 (FOF) A	国泰君安善怡稳健六个月持有债券发起 (FOF) C
报告期期初管理人持有的本基金份额	8,009,000.00	2,000,000.00
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	8,009,000.00	2,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	100.00	100.00

注：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。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人持有本基金份额未发生变化。

§ 9 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	10,009,000.00	100.00%	10,009,000.00	100.00%	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	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,009,000.00	100.00%	10,009,000.00	100.00%	-

§ 10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 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	20240101-20240331	10,009,000.00	-	-	10,009,000.00	100.00%
产品特有风险							
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：							

(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赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延缓赎回,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。

10.2 影响投资者决策的其他重要信息

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关于高级管理人员变更公告》,2024年2月26日起,叶明同志代为履行公司首席信息官职责,免去朱晓力同志首席信息官职务。

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》,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》,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。

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1、中国证监会准予国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）募集注册的文件;

2、《国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）基金合同》;

3、《国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）托管协议》;

4、《国泰君安善怡稳健六个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）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。

11.2 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>。

11.3 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
二〇二四年四月二十二日