

国泰君安稳债增利债券型发起式证券投资基金

2024 年第 4 季度报告

2024 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:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2025 年 01 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。 基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年01月20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10月01日起至2024年12月31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	106,106,332.32 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	51,351,741.46 份	54,754,590.86 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 10 月 01 日-2024 年 12 月 31 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	1,450,012.34	1,093,069.43
2. 本期利润	1,322,661.13	1,071,846.53
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0155	0.0164
4. 期末基金资产净值	52,888,344.10	56,187,900.01
5. 期末基金份额净值	1.0299	1.0262

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	1.73%	0.12%	2.37%	0.26%	-0.64%	-0.14%
过去六个月	2.36%	0.09%	4.64%	0.24%	-2.28%	-0.15%
自基金合同 生效起至今	2.99%	0.08%	7.60%	0.22%	-4.61%	-0.14%

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	1.63%	0.12%	2.37%	0.26%	-0.74%	-0.14%
过去六个月	2.15%	0.09%	4.64%	0.24%	-2.49%	-0.15%
自基金合同 生效起至今	2.62%	0.08%	7.60%	0.22%	-4.98%	-0.14%

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12月31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12月31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	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，国泰君安红利量化选股混合型证券投资基金基金经理，国泰君安	2024-02-06	—	13 年	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。

	中证 A500 指数增强型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。				
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

在中央推出一揽子刺激政策后四季度宏观基本面有所修复，PMI 连续三个月维持在荣枯线以上，工业增加值和价格指数平稳，地产销售数据改善。四季度财政政策和货币政策双双发力，2 万亿置换债顺利发行，货币政策方面保持宽松取向。四季度 A 股市场受场外因素影响较大，是在指数、风格和情绪上均呈现出巨幅波动的一个季度，大大增加了投资的难度。债券市场走牛，9 月末股市暴涨带来风险偏好提升，“股债跷跷板”效应下债券市场经历了一轮调整，而在情绪冲击结束后，市场开始逐步定价刺激政策的效果和货币政策宽松的预期，尤其是在央行定调货币政策为“适度宽松”后，利率快速下行，10 年国债利率向下突破 1.7。可转债市场走出平价与估值双击行情，中证转债指数+5.55%。

报告期内本产品坚持稳健的定位进行投资策略的安排。在权益市场经历 9-10 月的大幅震荡后，

我们认为行情逐步从普涨的 BETA 行情进入到 BETA、ALPHA 需要兼顾的阶段。考虑到市场的复杂性，从风险收益比的角度考量，四季度可转债配置价值相对优于股票，也是更好的“高位追涨”工具，本基金在四季度增配转债资产。后续根据大类资产配置的需求，择机对泛权益的仓位做出适当调整。在股票投资方面，本基金主要采取量化的方式来构建投资组合。报告期内，组合可转债仓位中枢整体有所提升，围绕量化双低和行业均衡底仓策略构建转债组合。随着转债估值修复进入“下半场”，当前更加看重胜率而非弹性，我们通过量化模型优选高胜率品种，增配大盘高等级底仓品种。债券投资方面，四季度随着债券市场恐慌情绪的修复，提升了组合久期水平，在年末的快牛行情中获得较好的投资收益。

展望 2025 年，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，进一步稳定了投资者和国际资本的信心。不过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。股票方面目前在在大小盘和不同风格的配置上较为平衡，未来会逐步增加对成长类股票的配置。利率水平已快速下行至历史低位，对货币政策的宽松定价较为充分，在此背景下债券市场的波动可能加大，无论是票息策略还是久期策略获利空间均较以往大幅下降，债券投资过程中将更加注重交易节奏的把握。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安稳健增利债券发起 A 基金份额净值为 1.0299 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.73%，同期业绩比较基准收益率为 2.37%；截至报告期末国泰君安稳健增利债券发起 C 基金份额净值为 1.0262 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.63%，同期业绩比较基准收益率为 2.37%。

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	3,543,836.00	2.73
	其中：股票	3,543,836.00	2.73
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	111,986,828.89	86.16
	其中：债券	111,986,828.89	86.16
	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	14,298,206.79	11.00
8	其他资产	148,957.30	0.11
9	合计	129,977,828.98	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	—	—
B	采矿业	102,871.00	0.09
C	制造业	2,237,792.00	2.05
D	电力、热力、燃气及 水生产和供应业	188,575.00	0.17
E	建筑业	135,742.00	0.12
F	批发和零售业	65,232.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮 政业	103,136.00	0.09
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信 息技术服务业	207,398.00	0.19
J	金融业	407,576.00	0.37
K	房地产业	1,076.00	0.00
L	租赁和商务服务业	4,218.00	0.00
M	科学研究和技术服务 业	52,760.00	0.05
N	水利、环境和公共设 施管理业	14,099.00	0.01
O	居民服务、修理和其 他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	11,925.00	0.01

R	文化、体育和娱乐业	11,436.00	0.01
S	综合	—	—
	合计	3,543,836.00	3.25

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	600887	伊利股份	2,000	60,360.00	0.06
2	000725	京东方 A	12,800	56,192.00	0.05
3	300750	宁德时代	200	53,200.00	0.05
4	000001	平安银行	4,500	52,650.00	0.05
5	601919	中远海控	3,300	51,150.00	0.05
6	601766	中国中车	6,000	50,280.00	0.05
7	600050	中国联通	9,300	49,383.00	0.05
8	601857	中国石油	5,500	49,170.00	0.05
9	300433	蓝思科技	2,100	45,990.00	0.04
10	000166	申万宏源	8,500	45,475.00	0.04

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	11,375,817.68	10.43
2	央行票据	—	—
3	金融债券	61,837,651.77	56.69
	其中：政策性金融债	10,141,575.34	9.30
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	31,398,066.78	28.79
7	可转债（可交换债）	7,375,292.66	6.76
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	111,986,828.89	102.67

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	2400001	24 特别国债 01	100,000	11,375,817.68	10.43
2	102101119	21 九龙江 MTN002(绿色)	100,000	10,594,646.03	9.71
3	102480127	24 湖州经开 MTN001(可持续挂钩)	100,000	10,515,426.23	9.64
4	2428002	24 平安银行 三农债 01	100,000	10,397,904.92	9.53
5	2128033	21 建设银行 二级 03	100,000	10,394,819.18	9.53

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)					224,539.50
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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

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。

5.11 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，2024 年 12 月因违规经营，被国家金融监督管理总局地方分局罚款，其分支行 2024 年多次因违规被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行罚款、警示等。

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，其分支行 2024 年多次因违规被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行罚款、警示等。

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，2024 年 5 月因违规提供担保及财务资助、违规经营被国家金融监督管理总局罚款，2024 年 6 月因违规经营被深圳证监局警示，其分支行 2024 年多次因违规被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行罚款、警示等。

本基金持有的前十名证券发行主体中国建设银行股份有限公司，2024 年其分支行多次因违规，被国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行、国家外汇管理局、证监会分局罚款、警示等。

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	148,957.30
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	148,957.30

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	113054	绿动转债	400,948.14	0.37
2	113634	珀莱转债	326,626.46	0.30
3	110079	杭银转债	309,816.43	0.28
4	118031	天 23 转债	307,796.63	0.28
5	127083	山路转债	298,651.79	0.27
6	127049	希望转 2	271,954.30	0.25
7	113641	华友转债	250,672.37	0.23
8	110081	闻泰转债	247,030.99	0.23
9	113052	兴业转债	211,045.28	0.19
10	128133	奇正转债	194,891.95	0.18
11	110064	建工转债	179,749.83	0.16
12	128141	旺能转债	169,957.42	0.16
13	127018	本钢转债	157,360.02	0.14
14	110085	通 22 转债	143,750.08	0.13
15	111017	蓝天转债	141,385.33	0.13
16	111002	特纸转债	133,883.77	0.12
17	110082	宏发转债	131,853.64	0.12
18	113631	皖天转债	127,779.53	0.12
19	113065	齐鲁转债	123,651.33	0.11
20	113632	鹤 21 转债	122,598.95	0.11
21	110084	贵燃转债	122,493.44	0.11
22	113042	上银转债	121,249.20	0.11
23	113047	旗滨转债	119,399.21	0.11
24	123161	强联转债	116,499.73	0.11

25	113657	再 22 转债	114,207.03	0.10
26	113652	伟 22 转债	113,911.81	0.10
27	113682	益丰转债	113,210.23	0.10
28	127045	牧原转债	112,465.96	0.10
29	128129	青农转债	109,454.38	0.10
30	113625	江山转债	94,383.75	0.09
31	123063	大禹转债	81,793.78	0.07
32	113066	平煤转债	72,952.45	0.07
33	118034	晶能转债	67,947.00	0.06
34	127025	冀东转债	59,964.23	0.05
35	113048	晶科转债	57,274.44	0.05
36	127084	柳工转 2	56,365.70	0.05
37	118013	道通转债	52,084.78	0.05
38	127030	盛虹转债	50,727.09	0.05
39	113062	常银转债	50,267.88	0.05
40	113061	拓普转债	50,222.35	0.05
41	110075	南航转债	50,216.18	0.05
42	128131	崇达转 2	48,639.86	0.04
43	113067	燃 23 转债	48,168.61	0.04
44	128136	立讯转债	47,391.91	0.04
45	110093	神马转债	47,219.65	0.04
46	113056	重银转债	47,184.59	0.04
47	127086	恒邦转债	47,066.39	0.04
48	123119	康泰转 2	46,520.36	0.04
49	113659	莱克转债	46,456.06	0.04
50	128135	洽洽转债	46,400.00	0.04
51	110073	国投转债	46,212.53	0.04
52	127040	国泰转债	46,090.88	0.04
53	110062	烽火转债	45,944.20	0.04
54	110089	兴发转债	45,611.35	0.04
55	113621	彤程转债	45,294.73	0.04
56	110076	华海转债	45,245.08	0.04
57	113049	长汽转债	45,114.98	0.04
58	111010	立昂转债	45,048.48	0.04
59	127073	天赐转债	44,716.14	0.04
60	127085	韵达转债	44,273.73	0.04
61	113627	太平转债	43,900.76	0.04
62	127056	中特转债	43,099.80	0.04
63	113053	隆 22 转债	42,439.99	0.04
64	127016	鲁泰转债	38,243.33	0.04

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	155,067,908.68	87,580,645.78
报告期期间基金总申购份额	8,331,646.21	37,925,501.42
减：报告期期间基金总赎回份额	112,047,813.43	70,751,556.34
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	51,351,741.46	54,754,590.86

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（%）	19.49	-

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	9.43%	10,009,450.45	9.43%	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	0.94%	—	—	—
基金经理等人员	57,161.39	0.05%	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	2,389.69	0.00%	—	—	—
合计	11,066,326.50	10.42%	10,009,450.45	9.43%	—

注：其他为公司普通员工持有份额，持有期限为不低于 6 个月。

§ 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
二〇二五年一月二十二日