国泰基金管理有限公司企业年金基金投资管理情况

2025 年 3 季度

一、2025 年 3 季度投资管理基本情况

期末组合数（个）	期末组合资产净值（万元）	本期投资收益（万元）	本年累计投资收益（万元）
217	12,924,561.80	541,885.52	740,072.69

注：1.该表所取样本为期末管理的全部投资组合。

2.投资收益为所有组合投资收益合计数。投资收益=当期投资资产利息收入+投资处置收益+公允价值变动损益+其他收入-受托费-托管费-投资管理费-交易费用-利息支出-其他费用。本期投资收益以本季度为期间，本年累计投资收益以年初到本季度末为期间。

二、2025 年 3 季度投资管理收益情况

机构名称	计划类型	组合类型	样本组合数（个）	样本组合期末资产净值（万元）	本年以来加权平均收益率（%）
国泰基金管理有限公司	单一计划	固定收益类	13	289,932.65	2.69
		含权益类	147	11,139,576.66	7.05
	集合计划	固定收益类	4	420,070.22	3.00
		含权益类	9	159,652.42	7.27
	其他计划	固定收益类	-	-	-
		含权益类	-	-	-

注：1.组合类型按是否含权益类投资标的分为固定收益类和含权益类，以期初合同或备忘录为准，明确约定不能投资权益类的组合为固定收益类；没有明确约定或期间发生类别变动的，都为含权益类。

2.其他计划是指过渡计划。

3.样本为 2025 年 1 月 1 日以前正式投资运作的投资组合。包括含有按委托人指定的投资方向、投资品种进行被动投资资产的组合。

4.本年以来加权平均收益率计算方法为符合条件样本组合收益率的规模加权，以上年末和本年各季度末平均资产规模为权重；组合收益率为单位净值增长率。对因分红、净值归一等非正常业务影响组合单位净值的，收益率分阶段计算。

（1）分红情况

期间多段分红收益率公式：R=（期内第1次分红前一天单位净值 / 期初单位净值）*（期内第2次分红前一天单位净值 / （期内第1次分红前一天单位净值 - 第一次单位份额分红金额））* ... *（期末单位净值 / （期内第 n 次分红前一天单位净值 - 第 n 次单位份额分红金额））- 1

其中，单位份额分红金额 = 分红当天分红金额 / 分红前总份额

（2）净值归一情况

期间多段净值归一收益率公式：R=（（期内第1次归一当天单位净值 * 第1次净值归一系数）/ 期初单位净值）*（（期内第2次归一当天单位净值 *第2次净值归一系数）/ 期内第1次归一当天单位净值）* ... * （期末单位净值 / 期内第 n 次归一当天单位净值） - 1

其中，净值归一系数 = 净值归一当天总份额 / 净值归一前一天总份额

（3）期内混合发生分红、净值归一时，按上述公式进行混合分段并计算期间收益率。

三、2025 年本年以来投资组合收益率分布情况

收益率（R）区间	组合数（个）	期末资产净值（万元）
R ≥ 8%	25	1,871,724.75
6% ≤ R < 8%	104	8,142,574.46
4% ≤ R < 6%	25	1,263,665.25
2% ≤ R < 4%	19	731,267.48
0 ≤ R < 2%	0	0.00
R < 0	0	0.00
合计	173	12,009,231.94

注：1.样本为2025年1月1日以前正式运作的投资组合，包括含有按委托人指定的投资方向、投资品种进行被动投资资产的组合。

2.组合数和期末资产净值是指收益率在该区间的组合个数和这些组合期末资产净值之和。组合收益率 R 的计算方法为单位净值增长率。

3. 收益率区间以人社部基金监管局提供的每个季度组合收益率分布表为准，收益区间不固化，根据当期全国企业年金组合收益整体分布情况进行划分，一般分为5-6档。每个季度上报数据时，此表暂不填报。