

**国泰金龙债券证券投资基金**  
**2018 年年度报告摘要**  
**2018 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年三月三十日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2019 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金简称            | 国泰金龙债券           |                 |
| 基金主代码           | 020002           |                 |
| 交易代码            | 020002           |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                 |
| 基金合同生效日         | 2003 年 12 月 5 日  |                 |
| 基金管理人           | 国泰基金管理有限公司       |                 |
| 基金托管人           | 上海浦东发展银行股份有限公司   |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 124,705,936.01 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 国泰金龙债券 A         | 国泰金龙债券 C        |
| 下属分级基金的交易代码     | 020002           | 020012          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 108,616,869.45 份 | 16,089,066.56 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                   |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 在保证投资组合低风险和高流动性的前提下，追求较高的当期收入和总回报，力求基金资产的稳定增值。                                                                                                                                    |
| 投资策略   | 以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，通过债券置换和收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。在对拟公开发行股票的公司进行充分研究的基础上，择机参与拟公开发行股票申购。因申购所持有的股票资产自可上市交易之日起在 180 个自然日内卖出；因可转债转股所持有的股票资产自可上市交易之日起在 180 个自然日内卖出。 |
| 业绩比较基准 | 自 2015 年 9 月 1 日起，本基金的业绩比较基准由“中信全债指数收益率”，变更为“中证综合债指数收益率”。                                                                                                                         |

|        |                    |
|--------|--------------------|
| 风险收益特征 | 本基金属于收益稳定、风险较低的品种。 |
|--------|--------------------|

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                        | 基金托管人            |
|-------------|------|------------------------------|------------------|
| 名称          |      | 国泰基金管理有限公司                   | 上海浦东发展银行股份有限公司   |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 李永梅                          | 胡波               |
|             | 联系电话 | 021-31081600转                | 021-61618888     |
|             | 电子邮箱 | xinxipilu@gtfund.com         | Hub5@spdb.com.cn |
| 客户服务电话      |      | (021) 31089000, 400-888-8688 | 95528            |
| 传真          |      | 021-31081800                 | 021-63602540     |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                           |
|---------------------|-----------------------------------------------------------|
| 登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址 | <a href="http://www.gtfund.com">http://www.gtfund.com</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层及基金托管人住所                 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间<br>数据和指标 | 2018 年         |             | 2017 年        |             | 2016 年         |              |
|-------------------|----------------|-------------|---------------|-------------|----------------|--------------|
|                   | 国泰金龙债券 A       | 国泰金龙债券 C    | 国泰金龙债券 A      | 国泰金龙债券 C    | 国泰金龙债券 A       | 国泰金龙债券 C     |
| 本期已实现收益           | -12,573,761.46 | -345,879.02 | 11,910,365.98 | -112,792.33 | 39,506,952.47  | 6,228,327.25 |
| 本期利润              | -9,779,288.77  | 275,397.38  | 29,324,194.14 | 383,379.37  | -22,634,126.04 | 5,852,238.22 |

|                                  |                    |                   |                    |                   |                      |                   |
|----------------------------------|--------------------|-------------------|--------------------|-------------------|----------------------|-------------------|
| 加 权 平<br>均 基 金<br>份 额 本<br>期 利 润 | -0.0213            | 0.0140            | 0.0102             | 0.0122            | -0.0145              | 0.0329            |
| 本 期 基<br>金 份 额<br>净 值 增<br>长 率   | 1.39%              | 1.48%             | 1.56%              | 1.19%             | 2.94%                | 2.67%             |
| <b>3.1.2 期末</b>                  | <b>2018 年末</b>     |                   | <b>2017 年末</b>     |                   | <b>2016 年末</b>       |                   |
| <b>数据和指<br/>标</b>                | 国泰金龙债券<br>A        | 国泰金龙债券<br>C       | 国泰金龙债券<br>A        | 国泰金龙债券<br>C       | 国泰金龙债券 A             | 国泰金龙债券<br>C       |
| 期 末 可<br>供 分 配<br>基 金 份<br>额 利 润 | 0.0100             | -0.0047           | 0.0402             | 0.0116            | 0.0285               | 0.0595            |
| 期 末 基<br>金 资 产<br>净 值            | 113,293,546<br>.90 | 16,517,043.<br>92 | 981,816,343.<br>32 | 24,015,424.6<br>6 | 6,124,904,210.<br>96 | 35,684,151.8<br>3 |
| 期 末 基<br>金 份 额<br>净 值            | 1.043              | 1.027             | 1.040              | 1.012             | 1.028                | 1.059             |

注：(1)经中国证监会批准，国泰金龙债券基金于 2008 年 6 月 3 日刊登公告，自 2008 年 6 月 5 日起增加收取销售服务费的 C 类收费模式。

(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)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，计入费用实际收益水平要低于所列数字。

## 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

1. 国泰金龙债券 A:

| 阶段      | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 3 个月 | 2.36%    | 0.16%       | 2.57%      | 0.05%         | -0.21% | 0.11% |
| 过去 6 个月 | 3.68%    | 0.13%       | 3.93%      | 0.05%         | -0.25% | 0.08% |
| 过去 1 年  | 1.39%    | 0.17%       | 8.12%      | 0.06%         | -6.73% | 0.11% |
| 过去 3 年  | 6.00%    | 0.11%       | 10.72%     | 0.07%         | -4.72% | 0.04% |
| 过去 5 年  | 31.47%   | 0.13%       | 28.59%     | 0.09%         | 2.88%  | 0.04% |
| 成立至今    | 116.37%  | 0.20%       | 77.58%     | 0.08%         | 38.79% | 0.12% |

2. 国泰金龙债券 C:

| 阶段      | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 3 个月 | 2.29%    | 0.16%       | 2.57%      | 0.05%         | -0.28% | 0.11% |
| 过去 6 个月 | 4.16%    | 0.14%       | 3.93%      | 0.05%         | 0.23%  | 0.09% |
| 过去 1 年  | 1.48%    | 0.18%       | 8.12%      | 0.06%         | -6.64% | 0.12% |
| 过去 3 年  | 5.43%    | 0.11%       | 10.72%     | 0.07%         | -5.29% | 0.04% |
| 过去 5 年  | 30.06%   | 0.13%       | 28.59%     | 0.09%         | 1.47%  | 0.04% |
| 成立至今    | 109.90%  | 0.20%       | 77.58%     | 0.08%         | 32.32% | 0.12% |

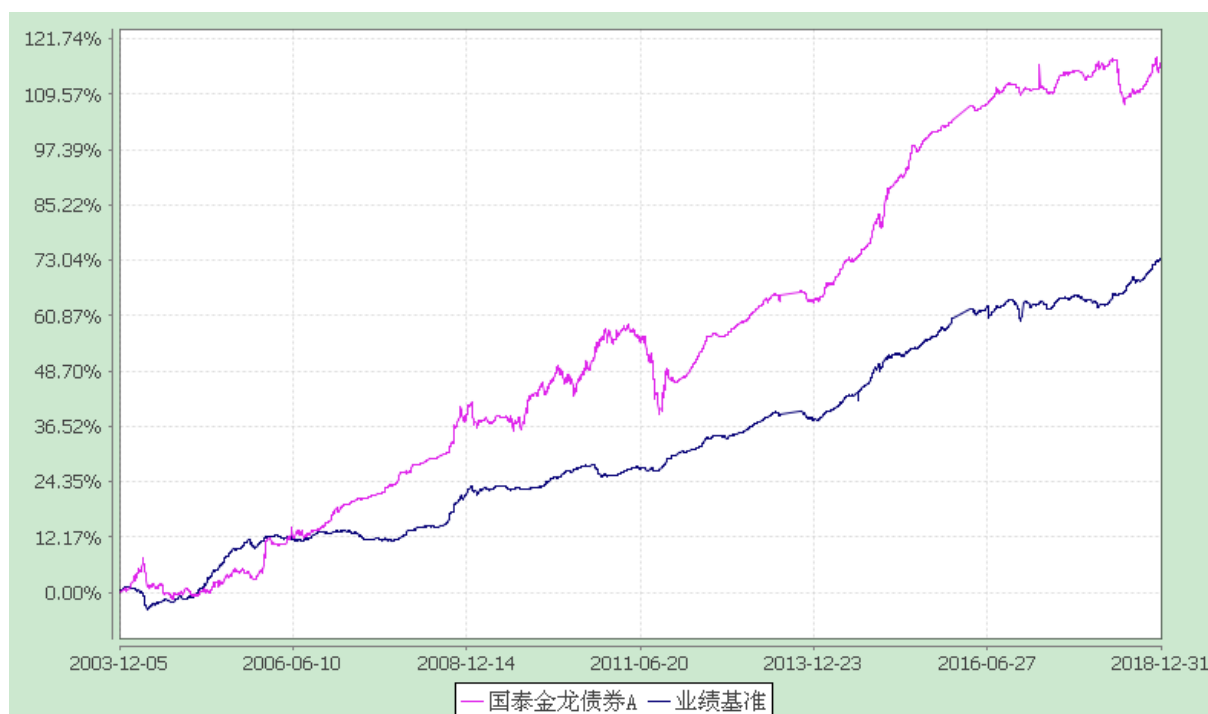
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰金龙债券证券投资基金

自基金合同生效以来份额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

(2003 年 12 月 5 日至 2018 年 12 月 31 日)

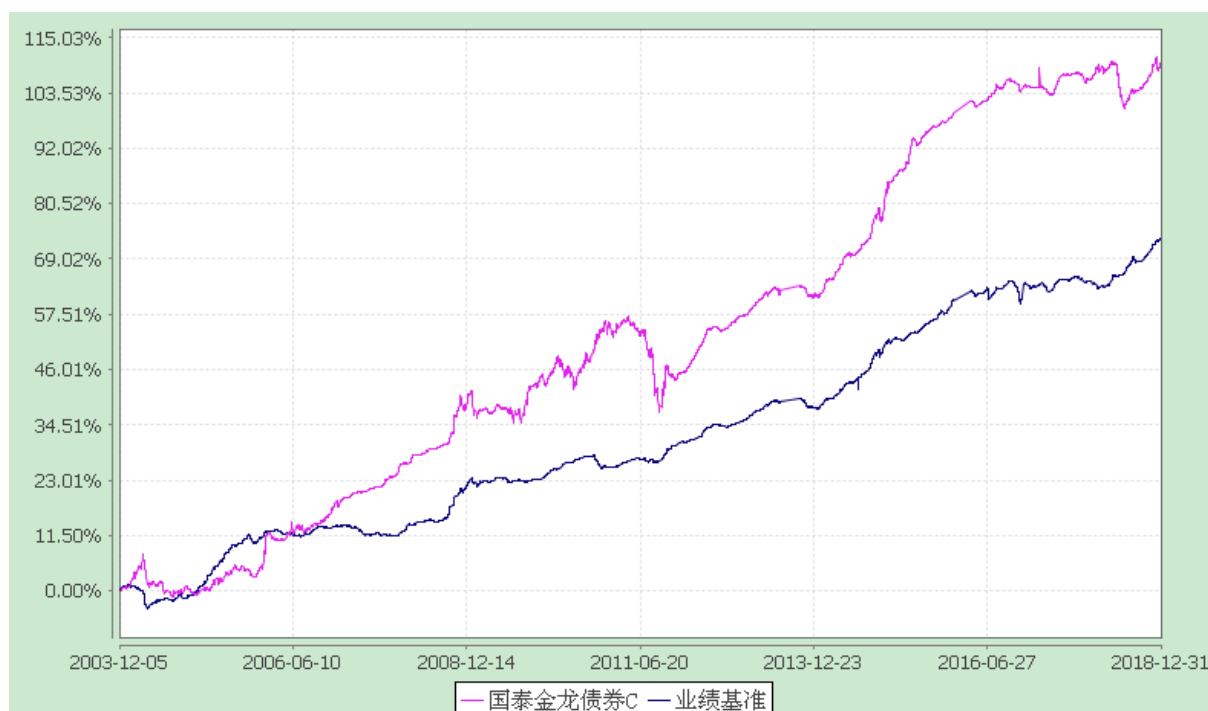
1、国泰金龙债券 A



注：1、本基金自2003年12月5日合同生效。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、自2015年9月1日起，本基金的业绩比较基准由“中信全债指数收益率”，变更为“中证综合债指数收益率”。

## 2、国泰金龙债券 C



注：1、本基金自2003年12月5日合同生效。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；

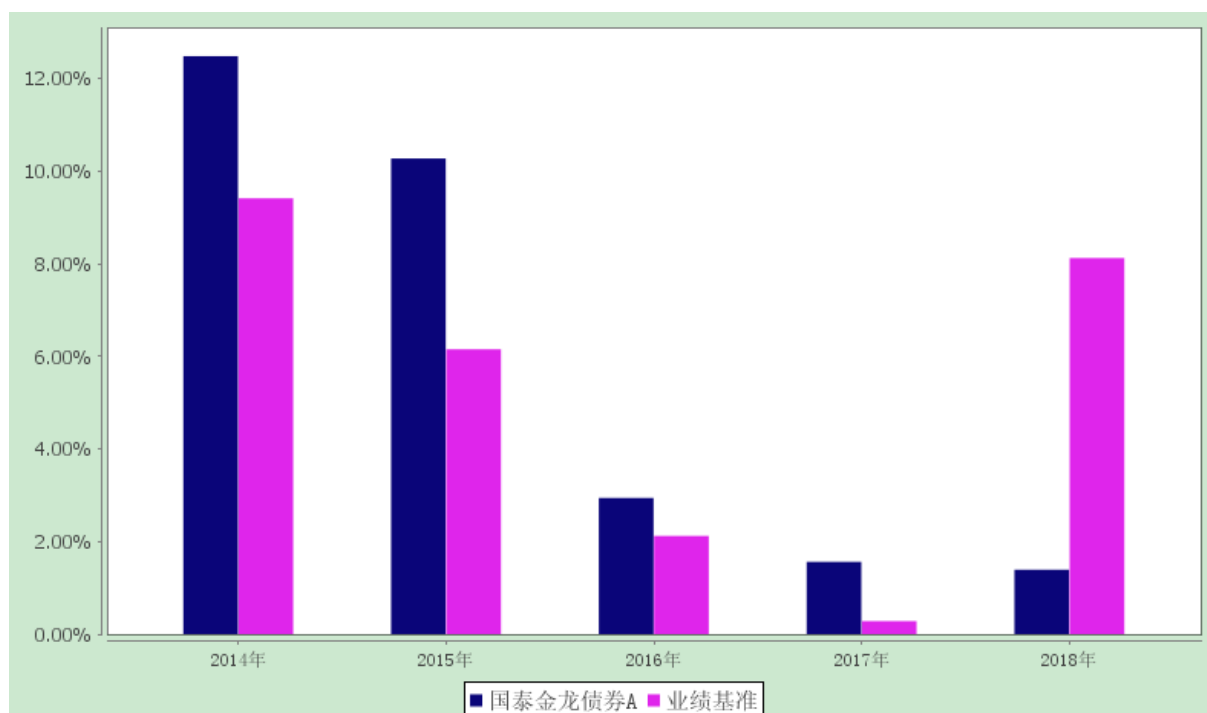
2、自 2015 年 9 月 1 日起，本基金的业绩比较基准由“中信全债指数收益率”，变更为“中证综合债指数收益率”。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

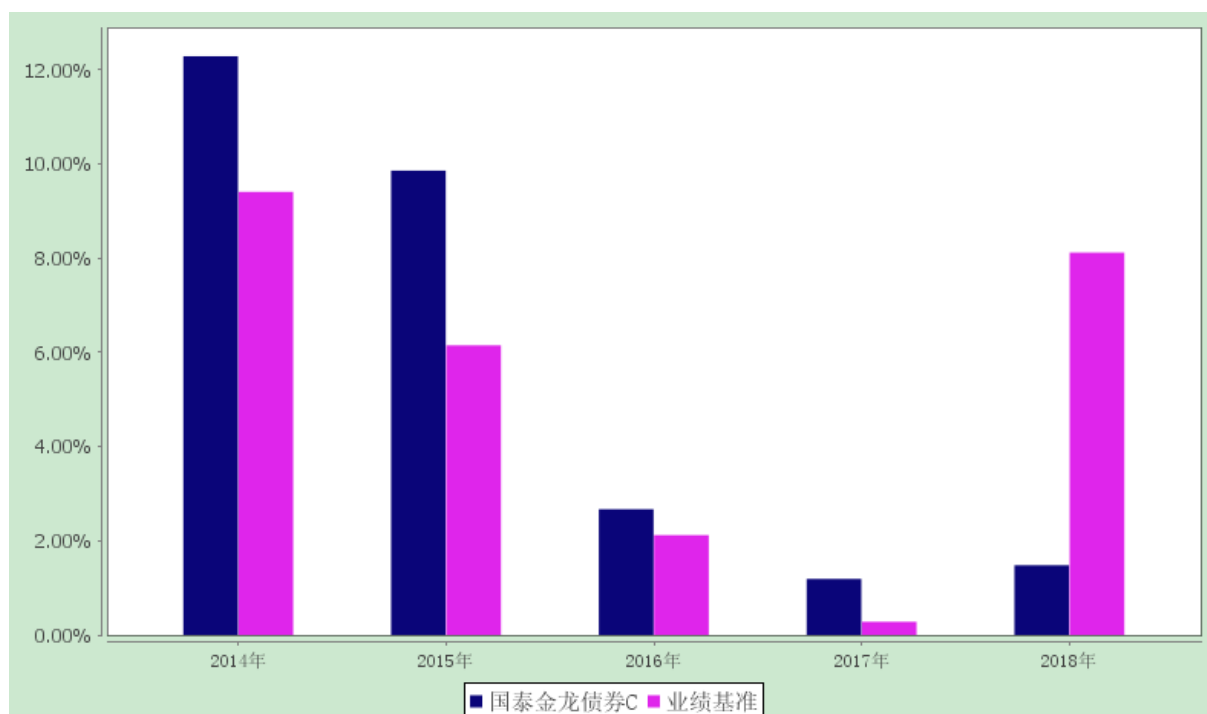
国泰金龙债券证券投资基金

过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

#### 1、国泰金龙债券 A



#### 2、国泰金龙债券 C



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

#### 1、国泰金龙债券 A:

单位：人民币元

| 年度     | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额      | 再投资形式发放总额    | 年度利润分配合计      | 备注 |
|--------|-------------|---------------|--------------|---------------|----|
| 2018 年 | 0.114       | 6,940,695.35  | 3,803,438.93 | 10,744,134.28 | -  |
| 2017 年 | 0.040       | 22,885,814.27 | 205,797.88   | 23,091,612.15 | -  |
| 2016 年 | 1.091       | 59,558,439.20 | 5,695,608.82 | 65,254,048.02 | -  |
| 合计     | 1.245       | 89,384,948.82 | 9,704,845.63 | 99,089,794.45 | -  |

#### 2、国泰金龙债券 C:

单位：人民币元

| 年度     | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额      | 再投资形式发放总额    | 年度利润分配合计      | 备注 |
|--------|-------------|---------------|--------------|---------------|----|
| 2018 年 | -           | -             | -            | -             | -  |
| 2017 年 | 0.590       | 1,303,022.63  | 650,306.28   | 1,953,328.91  | -  |
| 2016 年 | 0.720       | 15,415,859.07 | 883,123.44   | 16,298,982.51 | -  |
| 合计     | 1.310       | 16,718,881.70 | 1,533,429.72 | 18,252,311.42 | -  |

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 98 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金（LOF）、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金（由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来，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）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰中证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰中证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康定期支付混合型证券投资基金（由国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金更名而来）、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金、国泰国证有色金

属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰民福保本混合型证券投资基金、国泰鑫保本混合型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、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）、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）（由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰民利保本混合型证券投资基金、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、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）、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金（LOF）、国泰民丰回报定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金（LOF）、国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金、国泰大农业股票型证券投资基金、国泰智能装备股票型证券投资基金、国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金、国泰润鑫纯债债券型证券投资基金、国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰智能汽车股票型证券投资基金、上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰民安增益纯债债券型证券投资基金（由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金（QDII）、国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰可转债债券型证券投资基金、国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰江源优势精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰量化成长优选混合型证券投资基金、国泰量化价值精选混合型证券投资基金、国泰优势行业混合型证券投资基金、国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰瑞和纯债债券型证券投资基金、国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金、国泰恒生港股通指数证券投资基金（LOF）、国泰聚禾纯债债券型证券投资基金、国泰丰祺纯债债券型证券投资基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金、国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰新目标收益保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰聚享纯债债券型证券投资基金、国泰丰盈纯债债券型证券投资基金、国泰量化策略收益混合型证券投资基金（由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来，国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金由

国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来)。另外,本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格,目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日,本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日,本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务(专户理财)的基金公司之一,并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者(QDII)资格,囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

#### 4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

| 姓名 | 职务                                                                                                   | 任本基金的基金经理(助理)期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|----|------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|------|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                                                                                      | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 吴晨 | 本基金的基金经理、国泰信用互利分级债券、国泰双利债券、国泰多策略收益灵活配置、国泰鑫策略价值灵活配置混合、国泰招惠收益定期开放债券、国泰瑞和纯债债券的基金经理、绝对收益投资(事业)部总监、固收投资总监 | 2010-04-29      | -    | 17 年   | 硕士研究生, CFA, FRM。2001 年 6 月加入国泰基金管理有限公司,历任股票交易员、债券交易员;2004 年 9 月至 2005 年 10 月,英国城市大学卡斯商学院金融系学习;2005 年 10 月至 2008 年 3 月在国泰基金管理有限公司任基金经理助理;2008 年 4 月至 2009 年 3 月在长信基金管理有限公司从事债券研究;2009 年 4 月至 2010 年 3 月在国泰基金管理有限公司任投资经理。2010 年 4 月起任国泰金龙债券证券投资基金的基金经理;2010 年 9 月至 2011 年 11 月任国泰金鹿保本增值混合证券投资基金的基金经理;2011 年 12 月起任国泰信用互利分级债券型证券投资基金的基金经理;2012 年 9 月至 2013 年 11 月任国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金的基金经理;2013 年 10 月起兼任国泰双利债券证券投资基金的基金经理;2016 年 1 月至 2019 年 1 月任国泰鑫保本混合型证券投资基金的基金经理;2016 年 1 月至 2018 年 12 月任国泰新目标收益保本混合型证券投资基金的基金经理,2016 年 12 月至 2018 年 4 月任国泰民惠收益定期 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--|--|--|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>开放债券型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 4 月任国泰民丰回报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 8 月任国泰民安增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 9 月至 2019 年 1 月任国泰中国企业信用精选债券型证券投资基金（QDII）的基金经理，2017 年 11 月至 2018 年 9 月任国泰安心回报混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 1 月起兼任国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 2 月至 2018 年 8 月任国泰安惠收益定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 8 月至 2019 年 1 月任国泰民安增益纯债债券型证券投资基金（由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来）的基金经理，2018 年 9 月起兼任国泰瑞和纯债债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 12 月起兼任国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰新目标收益保本混合型证券投资基金变更而来）的基金经理，2019 年 1 月起兼任国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰鑫保本混合型证券投资基金变更而来）的基金经理。2014 年 3 月至 2015 年 5 月任绝对收益投资（事业）部总监助理，2015 年 5 月至 2016 年 1 月任绝对收益投资（事业）部副总监，2016 年 1 月至 2018 年 7 月任绝对收益投资（事业）部副总监（主持工作），2017 年 7 月起任固收投资总监，2018 年 7 月起任绝对收益投资（事业）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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，制定了《公平交易管理制度》，制度规范了公司各部门相关岗位职责，适用于公司所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，旨在规范交易行为，严禁利益输送，保证公平交易，保护投资者合法权益。

（一）公司投资和研究部门不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

（二）公司制定投资授权机制，明确各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各投资组合经理的投资权限，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

（三）公司对各投资组合信息进行有效的保密管理，不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息相互隔离。

（四）公司实行集中交易制度，严格隔离投资管理职能与交易执行职能，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。并在交易执行中对公平交易进行实时监控。

（五）公司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。

（六）公司相关部门定期对管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异、不同时间窗下同向交易和反向交易的交易价差等进行分析，并评估是否符合公平交易原则。

（七）公司相关部门建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，对交易过程进行定期检查，并将检查结果定期向公司风险管理委员会汇报。

#### 4.3.2 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，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。

##### （一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在 1%数量级及以下，且大部分溢价率均值通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

##### （二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 $\geq 30$ ），溢价率均值大部分在 1%数量级及以下。

##### （三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

#### 4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2018 年以来的债券市场走势，各类债券品种收益率多数出现下行，标杆品种的 10 年国债收益率下行约 70bp，短端国债下行更为显著，信用债品种收益率下行幅度也在 50-160bp 不等，但债券收益率下行的同时，信用事件仍屡屡发生，2018 年至今已新增逾 30 家违约主体、创历史新高，其中民企、上市公司成为重灾区，对应个券价格也相应出现大跌，风险溢价大幅走扩，从而加剧了民企融资难的困境，债券市场由此呈现冰火两重天的格局。2018 年债市行情的核心驱动因素在于基本面走弱、货币政策趋松，由于融资萎缩、贸易冲突等施压经济表现，国内货币政策维稳诉求加大，央行多次降准推动流动性趋于宽松，共同成为债券结构性牛市的关键。

本基金密切关注基本面、政策面变化带来的交易机会，把握利率债波段操作机会，并定期对持

仓品种进行风险排查、梳理及结构调整。自二季度开始，管理人稳步拉长组合久期，组合杠杆维持在较高水平，配置品种基本以中高等级信用债以及中长期利率债为主，准确把握了市场利率下行带来的资本利得。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰金龙债券 A 在 2018 年的净值增长率为 1.39%，同期业绩比较基准为 8.12%。

国泰金龙债券 C 在 2018 年的净值增长率为 1.48%，同期业绩比较基准为 8.12%。

#### 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 2019 年，我们认为基本面对债券市场仍旧构成利好支撑。第一，经济下行压力在加大。首先，房地产住而不炒、居民债务高企、棚改力度降低预计将继续施压房地产投资，企业盈利下滑将制约投资扩张意愿，制造业增速料将回落，而基建投资虽有改善，但于投资仍独木难支。其次，2018 年 11 月社零创 2003 年以后新低，未来居民收入增长放缓，地产财富效应下降，预示着消费仍有较大下行压力。再者，全球经济放缓，外需疲弱将拖累出口，尤其在中美贸易冲突下 2018 年抢出口效应明显，对 2019 年出口或已形成一定透支。第二，宽货币向宽信用传导见效缓慢。尽管 2018 年 11 月以来，多项支持民营企业相关政策陆续落地，部分民营企业的股权质押风险得到了一定化解，但 2018 年 11 月工业企业盈利增速转负，可能制约风险偏好回升的脚步，宽信用见效仍需时间。综上，在经济增长放缓、民企融资困难的背景下，金融去杠杆和实体去杠杆并不是当前的主要目标，预计 2019 年货币政策将加强逆周期调控，宽松货币环境对债市仍构成支撑。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截止至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施

的利润。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对国泰金龙债券证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对国泰金龙债券证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内对进行了一次利润分配，分配金额为 10,744,134.28 元。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由国泰基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### §6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2019)第 21037 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国泰金龙债券证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产          | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 资产：         | -                       | -                        |
| 银行存款        | 65,907.29               | 63,733,819.53            |
| 结算备付金       | 3,129,912.56            | 33,673,744.16            |
| 存出保证金       | 54,932.10               | 21,993.83                |
| 交易性金融资产     | 136,530,463.50          | 1,265,993,636.39         |
| 其中：股票投资     | -                       | -                        |
| 基金投资        | -                       | -                        |
| 债券投资        | 136,530,463.50          | 1,265,993,636.39         |
| 资产支持证券投资    | -                       | -                        |
| 贵金属投资       | -                       | -                        |
| 衍生金融资产      | -                       | -                        |
| 买入返售金融资产    | -                       | -                        |
| 应收证券清算款     | 8,805,700.80            | 1,842,300.80             |
| 应收利息        | 4,119,227.02            | 15,943,606.81            |
| 应收股利        | -                       | -                        |
| 应收申购款       | 55,622.01               | 60,300.64                |
| 递延所得税资产     | -                       | -                        |
| 其他资产        | -                       | -                        |
| <b>资产总计</b> | <b>152,761,765.28</b>   | <b>1,381,269,402.16</b>  |
| 负债和所有者权益    | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
| 负债：         | -                       | -                        |

|                   |                       |                         |
|-------------------|-----------------------|-------------------------|
| 短期借款              | -                     | -                       |
| 交易性金融负债           | -                     | -                       |
| 衍生金融负债            | -                     | -                       |
| 卖出回购金融资产款         | 22,700,000.00         | 320,000,000.00          |
| 应付证券清算款           | 27,674.66             | 53,343,430.18           |
| 应付赎回款             | 76,177.44             | 1,214,762.23            |
| 应付管理人报酬           | 66,281.96             | 697,379.66              |
| 应付托管费             | 22,093.98             | 232,459.88              |
| 应付销售服务费           | 4,258.94              | 6,345.09                |
| 应付交易费用            | 1,265.00              | 3,440.00                |
| 应交税费              | 8,879.20              | -                       |
| 应付利息              | -5,534.94             | -60,812.85              |
| 应付利润              | -                     | -                       |
| 递延所得税负债           | -                     | -                       |
| 其他负债              | 50,078.22             | 629.99                  |
| <b>负债合计</b>       | <b>22,951,174.46</b>  | <b>375,437,634.18</b>   |
| <b>所有者权益：</b>     | <b>-</b>              | <b>-</b>                |
| 实收基金              | 124,705,936.01        | 967,574,882.15          |
| 未分配利润             | 5,104,654.81          | 38,256,885.83           |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>129,810,590.82</b> | <b>1,005,831,767.98</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>152,761,765.28</b> | <b>1,381,269,402.16</b> |

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，国泰金龙债券证券投资基金 A 类基金的份额净值 1.043 元，国泰金龙债券证券投资基金 C 类基金的份额净值 1.027 元；基金份额总额 124,705,936.01 份，国泰金龙债券证券投资基金 A 类基金的份额总额 108,616,869.45 份，国泰金龙债券证券投资基金 C 类基金的份额总额 16,089,066.56 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国泰金龙债券证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                    | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至 2017<br>年 12 月 31 日 |
|-----------------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           | <b>1,189,603.93</b>                       | <b>73,615,774.72</b>                           |
| 1.利息收入                | 24,941,094.60                             | 135,801,201.65                                 |
| 其中：存款利息收入             | 449,413.42                                | 1,943,366.73                                   |
| 债券利息收入                | 24,491,681.18                             | 133,705,953.17                                 |
| 资产支持证券利息收入            | -                                         | -                                              |
| 买入返售金融资产收入            | -                                         | 151,881.75                                     |
| 其他利息收入                | -                                         | -                                              |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      | -27,559,232.78                            | -82,644,837.80                                 |
| 其中：股票投资收益             | -                                         | -                                              |
| 基金投资收益                | -                                         | -                                              |
| 债券投资收益                | -27,559,232.78                            | -82,644,837.80                                 |
| 资产支持证券投资收益            | -                                         | -                                              |
| 贵金属投资收益               | -                                         | -                                              |
| 衍生工具收益                | -                                         | -                                              |
| 股利收益                  | -                                         | -                                              |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 3,415,749.09                              | 17,909,999.86                                  |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -                                         | -                                              |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 391,993.02                                | 2,549,411.01                                   |
| <b>减：二、费用</b>         | <b>10,693,495.32</b>                      | <b>43,908,201.21</b>                           |
| 1. 管理人报酬              | 3,021,594.15                              | 18,427,232.46                                  |
| 2. 托管费                | 1,007,198.00                              | 6,142,410.80                                   |
| 3. 销售服务费              | 60,314.18                                 | 97,284.98                                      |
| 4. 交易费用               | 15,183.14                                 | 84,850.58                                      |
| 5. 利息支出               | 6,369,996.70                              | 18,971,059.49                                  |
| 其中：卖出回购金融资产支出         | 6,369,996.70                              | 18,971,059.49                                  |

|                            |                      |                      |
|----------------------------|----------------------|----------------------|
| 6. 税金及附加                   | 76,735.00            | -                    |
| 7. 其他费用                    | 142,474.15           | 185,362.90           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>-9,503,891.39</b> | <b>29,707,573.51</b> |
| 减：所得税费用                    | -                    | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>-9,503,891.39</b> | <b>29,707,573.51</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰金龙债券证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 |                |                  |
|----------------------------------------|----------------------------------------|----------------|------------------|
|                                        | 实收基金                                   | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 967,574,882.15                         | 38,256,885.83  | 1,005,831,767.98 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                      | -9,503,891.39  | -9,503,891.39    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -842,868,946.14                        | -12,904,205.35 | -855,773,151.49  |
| 其中：1.基金申购款                             | 97,409,779.82                          | 1,866,986.55   | 99,276,766.37    |
| 2.基金赎回款                                | -940,278,725.96                        | -14,771,191.90 | -955,049,917.86  |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                      | -10,744,134.28 | -10,744,134.28   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 124,705,936.01                         | 5,104,654.81   | 129,810,590.82   |

| 项目                                     | 上年度可比期间                          |                 |                   |
|----------------------------------------|----------------------------------|-----------------|-------------------|
|                                        | 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |                 |                   |
|                                        | 实收基金                             | 未分配利润           | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 5,989,112,536.65                 | 171,475,826.14  | 6,160,588,362.79  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | 29,707,573.51   | 29,707,573.51     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -5,021,537,654.50                | -137,881,572.76 | -5,159,419,227.26 |
| 其中：1.基金申购款                             | 444,640,853.40                   | 17,891,033.77   | 462,531,887.17    |
| 2.基金赎回款                                | -5,466,178,507.90                | -155,772,606.53 | -5,621,951,114.43 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                | -25,044,941.06  | -25,044,941.06    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 967,574,882.15                   | 38,256,885.83   | 1,005,831,767.98  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周向勇，主管会计工作负责人：倪莹，会计机构负责人：吴洪涛

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国泰金龙系列证券投资基金(以下简称“本系列基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]第 114 号《关于同意国泰金龙系列证券投资基金设立的批复》核准，由国泰基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试

点办法》等有关规定和《国泰金龙系列证券投资基金基金契约》(后更名为《国泰金龙系列证券投资基金基金合同》)发起,并于 2003 年 12 月 5 日募集成立。本系列基金为契约型开放式,存续期限不定,目前下设两个子基金,分别为国泰金龙债券证券投资基金(以下简称“本基金”)和国泰金龙行业精选证券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,570,221,715.39 元,其中包括本基金人民币 1,886,120,977.36 元和国泰金龙行业精选证券投资基金人民币 684,100,738.03 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 174 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《国泰金龙系列证券投资基金基金合同》和《国泰金龙系列证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,自 2008 年 6 月 5 日起,本基金根据申购费用、赎回费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用的,称为 A 类;新增的从本类别基金资产中计提销售服务费(赎回时持有期在 30 天以内,另收取 0.1%的赎回费)的基金类别,称为 C 类。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存,各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰金龙系列证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为在国内依法公开发行的各种固定收益类金融工具(包括资产支持证券和可分离转债等新的固定收益产品)和参与拟公开发行业股票的申购及可转债转股后所持有的股票,以及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。投资债券类资产的总比例不低于基金资产的 80%,投资于股票资产的比例不高于基金资产的 20%,投资于现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为“中证综合债指数收益率”。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2019 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰金龙债券证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(b) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(e) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称                                  | 与本基金的关系                     |
|----------------------------------------|-----------------------------|
| 国泰基金管理有限公司                             | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构         |
| 上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)                 | 基金托管人、基金销售机构                |
| 申万宏源集团股份有限公司(“申万宏源”)                   | 基金销售机构、受基金管理人的控股股东中国建投控制的公司 |
| 国泰元鑫资产管理有限公司                           | 基金管理人的控股子公司                 |
| 中国建银投资有限责任公司(“中国建投”)                   | 基金管理人的控股股东                  |
| 中国电力财务有限公司                             | 基金管理人的股东                    |
| 意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.) | 基金管理人的股东                    |
| 国泰全球投资管理有限公司                           | 基金管理人的控股子公司                 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 |              | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |              |
|-------|-----------------------------|--------------|----------------------------------|--------------|
|       | 成交金额                        | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额                             | 占当期债券成交总额的比例 |
| 申万宏源  | 1,119,986,460.63            | 90.05%       | 2,038,676,236.01                 | 77.10%       |

##### 7.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 |                | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |                |
|-------|-----------------------------|----------------|----------------------------------|----------------|
|       | 成交金额                        | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额                             | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 申万宏源  | 34,711,700,000.00           | 100.00%        | 110,761,500,000.00               | 99.96%         |

##### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2018年1月1日至2018年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12<br>月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,021,594.15                    | 18,427,232.46                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 822,965.79                      | 135,675.23                           |

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值  $\times$  0.60% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018年1月1日至2018年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12<br>月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,007,198.00                    | 6,142,410.80                         |

注：支付基金托管人浦发银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值  $\times$  0.20% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各<br>关联方名称 | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 |           |           |
|--------------------|-----------------------------|-----------|-----------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费            |           |           |
|                    | 国泰金龙债券 A                    | 国泰金龙债券 C  | 合计        |
| 国泰基金管理有限公司         | -                           | 21,788.69 | 21,788.69 |
| 浦发银行               | -                           | 583.46    | 583.46    |
| 申万宏源               | -                           | 125.09    | 125.09    |
| 合计                 | -                           | 22,497.24 | 22,497.24 |

| 获得销售服务费的各<br>关联方名称 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |           |           |
|--------------------|----------------------------------|-----------|-----------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |           |           |
|                    | 国泰金龙债券A                          | 国泰金龙债券C   | 合计        |
| 国泰基金管理有限公司         | -                                | 37,151.09 | 37,151.09 |
| 浦发银行               | -                                | 820.68    | 820.68    |
| 申万宏源               | -                                | 123.30    | 123.30    |
| 合计                 | -                                | 38,095.07 | 38,095.07 |

注：支付销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国泰基金管理有限公司，再由国泰基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                    | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 |         |
|-----------------------|-----------------------------|---------|
|                       | 国泰金龙债券A                     | 国泰金龙债券C |
| 期初持有的基金份额             | -                           | -       |
| 期间申购/买入总份额            | 34,825,373.13               | -       |
| 期间因拆分变动份额             | -                           | -       |
| 减：期间赎回/卖出总<br>份额      | -                           | -       |
| 期末持有的基金份额             | 34,825,373.13               | -       |
| 期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例 | 27.93%                      | -       |

注：基金管理人国泰基金管理有限公司在本年度申购本基金的交易委托国泰基金管理有限公司

直销柜台办理，无申购费用。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

国泰金龙债券 A

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资国泰金龙债券证券投资基金 A 类基金的情况。

国泰金龙债券 C

份额单位：份

| 关联方名称        | 国泰金龙债券 C 本期末 2018 年 12 月 31 日 |                  | 国泰金龙债券 C 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |                  |
|--------------|-------------------------------|------------------|--------------------------------|------------------|
|              | 持有的基金份额                       | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额                        | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 国泰元鑫资产管理有限公司 | 2,269,654.53                  | 1.82%            | 2,269,654.53                   | 0.23%            |

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 |            | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |              |
|-------|-----------------------------|------------|----------------------------------|--------------|
|       | 期末余额                        | 当期利息收入     | 期末余额                             | 当期利息收入       |
| 浦发银行  | 65,907.29                   | 181,351.10 | 63,733,819.53                    | 1,208,704.85 |

注：本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 22,700,000.00 元, 于 2019 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 170,657.20 元, 属于第二层次的余额为 124,903,806.30 元, 属于第三层次的余额为 11,456,000.00 元。(2017 年 12 月 31 日: 第一层次 56,604,564.99 元, 第二层次 1,209,389,071.40 元, 无属于第三层次的余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

|                  | 交易性金融资产<br>——债券投资 |
|------------------|-------------------|
| 2018 年 1 月 1 日   | -                 |
| 购买               | -                 |
| 出售               | -                 |
| 转入第三层次           | 11,456,000.00     |
| 转出第三层次           | -                 |
| 当期利得或损失总额        | -                 |
| ——计入损益的利得或损失     | -                 |
| 2018 年 12 月 31 日 | 11,456,000.00     |

2018 年 12 月 31 日仍持有的资产

计入 2018 年度损益的未实现利得或损失的变动

|            |                |
|------------|----------------|
| ——公允价值变动损益 | -27,860,000.00 |
|------------|----------------|

计入损益的利得或损失计入利润表中的公允价值变动收益等项目。

于 2017 年度，本基金无第三层次变动。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下：

| 交易性金融资产——债券投资 | 2018 年 12 月 31 日公允价值(元) | 估值技术    | 名称            | 范围/加权平均值        | 与公允价值之间的关系 |
|---------------|-------------------------|---------|---------------|-----------------|------------|
| 15 华信债        | 11,456,000.00           | 历史平均回收率 | 违约公募债的加权平均回收率 | 33.62 元/100 元面值 | 正相关        |

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 15 华信债

根据 2018 年 6 月 19 日上海证券交易所出具《监管警示函》(上证监(2018)9 号)上海华信国际集团有限公司未在规定时间之前披露 2017 年年度报告,违反了《上海证券交易所公司债券上市规则》第 1.5 条、第 3.2.2 条的相关规定。现对公司予以书面警示,并责令拟积极推进 2017 年年度报告编制工作并尽快完成披露。

根据 2018 年 5 月 24 日上海证监局发布《关于对华信国际集团有限公司采取责令改正措施的决定》。根据行政监管措施(沪证监决(2018)36 号)信息显示,2018 年 4 月 27 日,上海华信国际集团有限公司发布《关于预计无法按期披露 2017 年年度报告的风险提示公告》称,因司面临重大不确定性事项,预计无法按照原定时间披露 2017 年年度报告。截至 5 月 24 日,仍未披露 2017 年年度报告。上述行为违反了《公司债券发行与交易管理办法》(证监会令第 113 号)第四十二条、第四十三条的规定。按照《公司债券发行与交易管理办法》第五十八条、第六十五条的规定,现要求公司高度重视上述问题,切实整改,按规定履行信息披露义务。

该情况发生后,国泰基金管理有限公司就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究,并对该公司进行持续跟踪。

根据上海华信国际集团有限公司(以下简称“华信国际”)于 2018 年 12 月 24 日发布的《关于“15 华信债”公司债违约公告》,15 华信债(证券代码 136093)到期日提前至 2018 年 12 月 5 日,华信国际未能于该日前支付全部本息,15 华信债发生实质违约。于 2018 年 12 月 31 日,15 华信债的公允价值为 11,456,000.00 元。

(3)除公允价值和 15 华信债外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | -              | -             |
|    | 其中：股票             | -              | -             |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 136,530,463.50 | 89.37         |
|    | 其中：债券             | 136,530,463.50 | 89.37         |
|    | 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      | 3,195,819.85   | 2.09          |
| 8  | 其他各项资产            | 13,035,481.93  | 8.53          |
| 9  | 合计                | 152,761,765.28 | 100.00        |

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.3 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。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期内没有进行股票交易。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 75,456,460.00  | 58.13        |
|    | 其中：政策性金融债 | 75,456,460.00  | 58.13        |
| 4  | 企业债券      | 60,903,346.30  | 46.92        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 170,657.20     | 0.13         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 136,530,463.50 | 105.18       |

## 8.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量(张)   | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 180406 | 18 农发 06 | 300,000 | 32,079,000.00 | 24.71        |
| 2  | 170215 | 17 国开 15 | 200,000 | 20,642,000.00 | 15.90        |
| 3  | 136093 | 15 华信债   | 400,000 | 11,456,000.00 | 8.83         |
| 4  | 180313 | 18 进出 13 | 100,000 | 10,106,000.00 | 7.79         |
| 5  | 136459 | 16 上港 02 | 100,000 | 9,970,000.00  | 7.68         |

## 8.7 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。

## 8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“华信国际集团”违规外）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。

根据 2018 年 6 月 19 日上海证券交易所出具《监管警示函》（上证监（2018）9 号），上海华信国际集团有限公司未在规定时间内之前披露 2017 年年度报告，违反了《上海证券交易所公司债券上市规则》第 1.5 条、第 3.2.2 条的相关规定。现对公司予以书面警示，并责令公司拟积极推进 2017 年年度报告编制工作并尽快完成披露。

根据 2018 年 5 月 24 日上海证监局发布《关于对上海华信国际集团有限公司采取责令改正措施的决定》。根据行政监管措施（沪证监决（2018）36 号）信息显示，2018 年 4 月 27 日，上海华信国际集团有限公司发布《关于预计无法按期披露 2017 年年度报告的风险提示公告》称，因公司面临重大不确定性事项，预计无法按照原定时间披露 2017 年年度报告。截至 5 月 24 日，仍未披露 2017 年年度报告。上述行为违反了《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第 113 号）第四十二条、四十三条的规定。

按照《公司债券发行与交易管理办法》第五十八条、第六十五条的规定，现要求公司高度重视上述问题，切实整改，按规定履行信息披露义务。

根据 2018 年 4 月 27 日安徽监管局出具的《行政监管措施决定书——关于对上海华信国际集团有限公司采取警示函措施的决定》（〔2018〕6 号）和《行政监管措施决定书--关于对安徽华信国际控股股份有限公司采取警示函措施的决定》（〔2018〕7 号）公司违反了《上市公司信息披露管理办法》第四十六条规定和第三十条规定。按照《上市公司信息披露管理办法》第五十九条规定，安徽监管局决定对公司采取出具警示函的行政监管措施。

该情况发生后，本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，本基金管理人将继续对该公司进行跟踪。

8.12.2 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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 54,932.10     |
| 2  | 应收证券清算款 | 8,805,700.80  |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 4,119,227.02  |
| 5  | 应收申购款   | 55,622.01     |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 13,035,481.93 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1  | 128026 | 众兴转债 | 170,657.20 | 0.13         |

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别     | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构         |        |               |        |
|----------|----------|-----------|---------------|--------|---------------|--------|
|          |          |           | 机构投资者         |        | 个人投资者         |        |
|          |          |           | 持有份额          | 占总份额比例 | 持有份额          | 占总份额比例 |
| 国泰金龙债券 A | 17,335   | 6,265.76  | 63,659,227.12 | 58.61% | 44,957,642.33 | 41.39% |
| 国泰金龙债券 C | 2,130    | 7,553.55  | 2,364,531.19  | 14.70% | 13,724,535.37 | 85.30% |
| 合计       | 19,465   | 6,406.68  | 66,023,758.31 | 52.94% | 58,682,177.70 | 47.06% |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别     | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|----------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 国泰金龙债券 A | 74.07     | 0.00%    |
|                  | 国泰金龙债券 C | 29.85     | 0.00%    |
|                  | 合计       | 103.92    | 0.00%    |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                             | 份额级别     | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 国泰金龙债券 A | 0                 |
|                                | 国泰金龙债券 C | 0                 |
|                                | 合计       | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 国泰金龙债券 A | 0                 |
|                                | 国泰金龙债券 C | 0                 |
|                                | 合计       | 0                 |

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 国泰金龙债券 A         | 国泰金龙债券 C      |
|--------------------------------|------------------|---------------|
| 基金合同生效日（2003 年 12 月 5 日）基金份额总额 | 1,887,374,602.86 | -             |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 943,834,775.51   | 23,740,106.64 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 74,429,755.27    | 22,980,024.55 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 909,647,661.33   | 30,631,064.63 |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -                | -             |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 108,616,869.45   | 16,089,066.56 |

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2018 年 7 月 28 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司副总经理任职公告》，经本基金管理人第七届董事会第十六次会议审议通过，聘任封雪梅女士担任公司副总经理；

2018 年 12 月 13 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第七届董事会第十九次会议审议通过，陈星德先生不再担任公司副总经理。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

本报告期，本基金托管人根据工作需要，任命孔建先生担任资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。孔建先生的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为 50,000 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易<br>单元<br>数量 | 股票交易 |                      | 应支付该券商的佣金 |                    | 备注 |
|------|----------------|------|----------------------|-----------|--------------------|----|
|      |                | 成交金额 | 占当期股<br>票成交总<br>额的比例 | 佣金        | 占当期佣<br>金总量的<br>比例 |    |
| 国泰君安 | 1              | -    | -                    | -         | -                  | -  |
| 申万宏源 | 2              | -    | -                    | -         | -                  | -  |

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |                      | 回购交易      |                      | 权证交易 |                      |
|------|----------------|----------------------|-----------|----------------------|------|----------------------|
|      | 成交金额           | 占当期债<br>券成交总<br>额的比例 | 成交金额      | 占当期回<br>购成交总<br>额的比例 | 成交金额 | 占当期权证<br>成交总额的<br>比例 |
| 国泰君安 | 123,719,035.19 | 9.95%                | -         | -                    | -    | -                    |
| 申万宏源 | 1,119,986,46   | 90.05%               | 34,711,70 | 100.00%              | -    | -                    |

|  |      |  |          |  |  |  |
|--|------|--|----------|--|--|--|
|  | 0.63 |  | 0,000.00 |  |  |  |
|--|------|--|----------|--|--|--|

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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              | 2018 年 6 月 26 日至 2018 年 12 月 31 日 | -              | 34,825,373.13 | -              | 34,825,373.13 | 27.93% |
|                                                               | 2              | 2018 年 6 月 21 日至 2018 年 12 月 31 日 | 26,587,778.01  | 292,850.89    | 960,614.79     | 25,920,014.11 | 20.78% |
|                                                               | 3              | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 20 日   | 538,737,028.31 | -             | 538,737,028.31 | -             | -      |
|                                                               | 4              | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 5 月 20 日   | 239,233,971.29 | 2,635,040.84  | 241,869,012.13 | -             | -      |
| 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。 |                |                                   |                |               |                |               |        |