

**国泰金龙债券证券投资基金**  
**2020 年第 1 季度报告**  
**2020 年 3 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：二〇二〇年四月二十二日

## §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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2020 年 4 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 2020 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                    |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 国泰金龙债券                                                                                                                                                                             |
| 基金主代码      | 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                                                                                                                                                                    |
| 报告期末基金份额总额 | 110,594,564.84 份                                                                                                                                                                   |
| 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的申购。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。                                        |                |
| 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                                            |                |
| 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 | 100,642,215.09 份                                          | 9,952,349.75 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                              |               |
|----------------|----------------------------------|---------------|
|                | (2020 年 1 月 1 日-2020 年 3 月 31 日) |               |
|                | 国泰金龙债券 A                         | 国泰金龙债券 C      |
| 1.本期已实现收益      | 2,510,036.98                     | 234,579.78    |
| 2.本期利润         | 1,131,620.60                     | 107,796.08    |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0112                           | 0.0103        |
| 4.期末基金资产净值     | 110,512,387.85                   | 10,355,222.03 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.098                            | 1.040         |

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、国泰金龙债券 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 | 1.01%      | 0.14%         | 2.58%          | 0.10%                 | -1.57% | 0.04% |

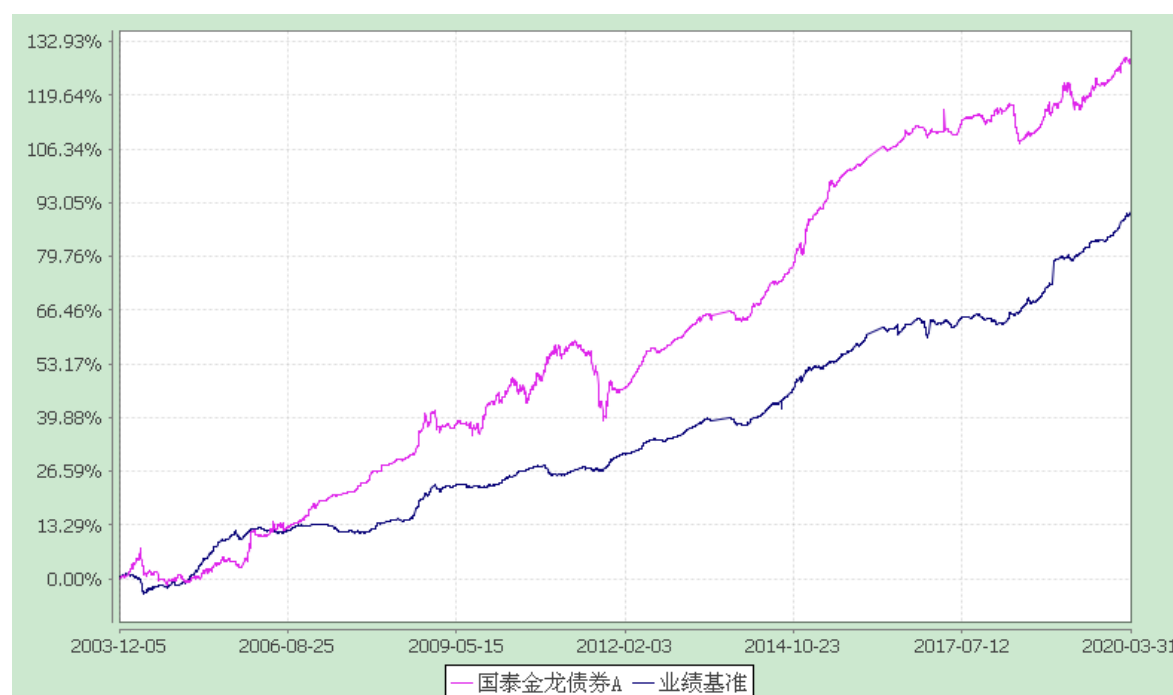
### 2、国泰金龙债券 C:

| 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 | 0.87%      | 0.14%         | 2.58%          | 0.10%                 | -1.71% | 0.04% |

### 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

国泰金龙债券证券投资基金  
 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  
 (2003 年 12 月 5 日至 2020 年 3 月 31 日)

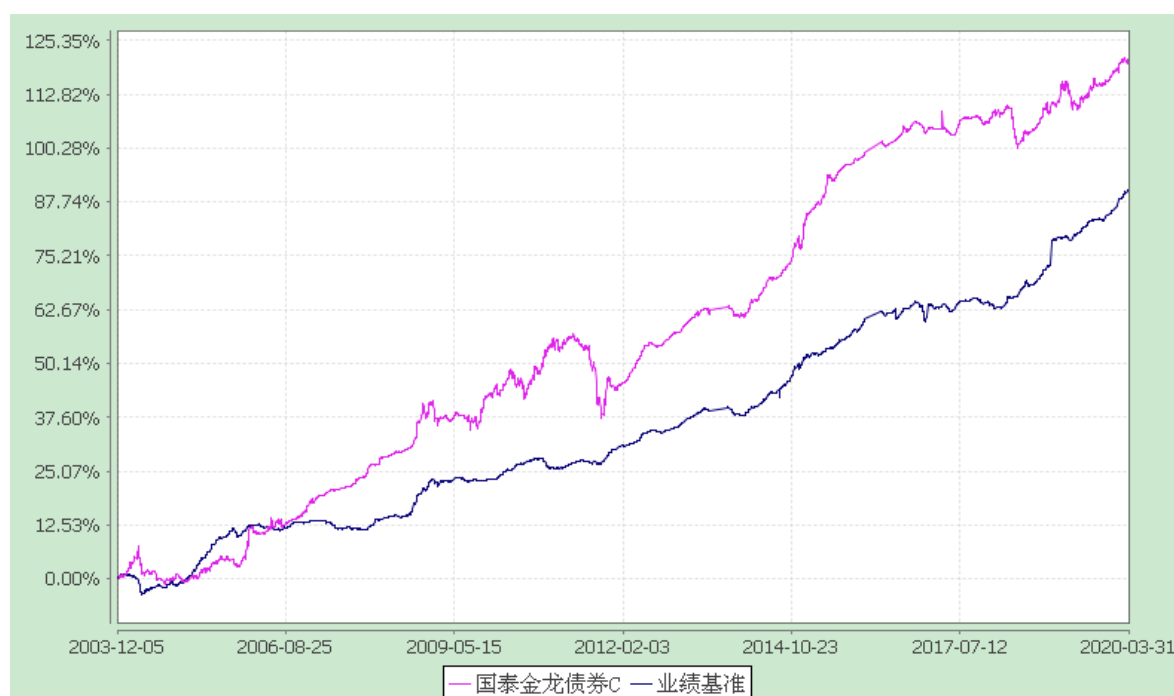
#### 1. 国泰金龙债券 A:



注：1、本基金的合同生效日为 2003 年 12 月 5 日。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、本基金合同生效日为 2003 年 12 月 5 日。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”。

## §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       |        |                                                                                                                                                          |
| 吴晨 | 本基金的基金经理 | 2010-04-29  | 2020-03-13 | 18 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 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>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 月至 2020 年 3 月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 月至 2020 年 3 月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 月至 2020 年 3 月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 月至 2019 年 8 月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</p> |
|--|--|--|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|    |                                                             |            |   |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|----|-------------------------------------------------------------|------------|---|-----|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                                             |            |   |     | 年 9 月至 2020 年 3 月任国泰瑞和纯债债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 12 月至 2019 年 5 月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 月至 2019 年 5 月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，2019 年 3 月至 2020 年 3 月任国泰农惠定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2019 年 7 月至 2020 年 3 月任国泰兴富三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。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 月起至 2020 年 3 月任固收投资总监，2018 年 7 月起至 2020 年 3 月任绝对收益投资(事业)部总监。 |
| 王玉 | 本基金的基金经理、国泰上证 5 年期国债 ETF、上证 10 年期国债 ETF 的基金经理、国泰信用互利债券的基金经理 | 2020-03-13 | - | 4 年 | 硕士研究生。曾任职于光大银行上海分行。2016 年 1 月加入国泰基金管理有限公司，历任交易员、基金经理助理。2019 年 12 月起担任上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金和上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 3 月起兼任国泰金龙债券证券投资基金和国泰信用互利债券型证券投资基金(由国泰信用互利分级债券型证券投资基金转型而来)的基金经理。                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

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，基金管理小组保持独立运作，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

2020 年一季度围绕新冠肺炎疫情在国内及海外的蔓延趋势展开，多国新冠确诊人数快速上升，二月中国内疫情得到有效控制，二月底开始海外已成为新冠疫情的主要战场。由于避险情绪发酵，海外各国的量化宽松政策加码，国内债券收益率下行速度加快，十年国债收益率下行接近 40-50bp。海外市场波动加剧，全球经济陷入较高不确定性。在全球经济下行压力之下，风险资产仍然比较脆弱，走势难言乐观。对于债券这种避险资产来讲，全球货币趋向宽松的态势仍旧提供利好，坚定看好国内债券市场的投资机会。短端受益于流动性更宽松影响，收益率不断下行，期

限利差处于高位。

2020 年一季度，新冠疫情在国内外发酵，经济修复仍需时日。货币政策逆周期调节力度加大，债券收益率大幅下行。组合在收益率下行过程中，适当增配长端利率债，把握了一定的交易机会，杠杆保持积极水平，信用资产进行了一定的调整；转债方面，持仓变化不大。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

国泰金龙债券 A 在 2020 年第一季度的净值增长率为 1.01%，同期业绩比较基准收益率为 2.58%。

国泰金龙债券 C 在 2020 年第一季度的净值增长率为 0.87%，同期业绩比较基准收益率为 2.58%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内疫情在一季度得到控制并积极复工复产，但是海外疫情蔓延之势仍在延续，使得疫情成为长期性问题，对于经济的影响可能会比之前的估计更严重，经济面临中枢下调的压力，需要更加宽松的货币政策支持。一季度以来，资金利率不断下降，央行在货币政策方面仍有空间。疫情蔓延导致外需大幅下行的情况下，逆周期宏观政策将继续发力于稳就业、稳增长。但考虑疫情冲击较大，当前的政策规模下，经济难以出现大幅回升，更多是向正常水平恢复。总体来看，经济依然将延续偏弱态势，债券市场仍然具有相对确定的交易机会和配置价值。

展望下季度，组合配置仍以高等级信用债为主，关注新的交易机会；同时资金利率维持低位的形势下，杠杆仍将保持相对积极水平；转债方面，积极关注一级新债申购及二级市场的结构性机会。

#### 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              | -              | -      |
|   | 其中：股票             | -              | -      |
| 2 | 固定收益投资            | 122,707,185.10 | 96.98  |
|   | 其中：债券             | 122,707,185.10 | 96.98  |
|   | 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          | -              | -      |
|   | 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      | 677,788.33     | 0.54   |
| 7 | 其他各项资产            | 3,142,341.92   | 2.48   |
| 8 | 合计                | 126,527,315.35 | 100.00 |

## 5.2 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。

## 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

| 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      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 39,513,400.00 | 32.69        |
|    | 其中：政策性金融债 | 39,513,400.00 | 32.69        |
| 4  | 企业债券      | 53,806,150.60 | 44.52        |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |

|    |           |                |        |
|----|-----------|----------------|--------|
| 6  | 中期票据      | 10,327,000.00  | 8.54   |
| 7  | 可转债（可交换债） | 19,060,634.50  | 15.77  |
| 8  | 同业存单      | -              | -      |
| 9  | 其他        | -              | -      |
| 10 | 合计        | 122,707,185.10 | 101.52 |

#### 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  | 200203    | 20 国开 03       | 300,000 | 30,861,000.00 | 25.53        |
| 2  | 136093    | 15 华信债         | 400,000 | 11,456,000.00 | 9.48         |
| 3  | 101800049 | 18 扬州经开 MTN001 | 100,000 | 10,327,000.00 | 8.54         |
| 4  | 136168    | 16 建发 01       | 100,000 | 10,051,000.00 | 8.32         |
| 5  | 1980217   | 19 柳州东城债       | 70,000  | 7,256,200.00  | 6.00         |

#### 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（除“上海华信国际”、“国家开发银行”、“国泰君安”公告自身或分支机构违规外）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。

上海华信国际集团有限公司因未按时披露定期报告等原因，受到证监会、上交所出具警示函、责令整改等监管措施。

国家开发银行湖北、青海、辽宁、广西等分行因未按照规定进行信息披露、严重违反审慎经营规则、贷款资金用途监测不尽职、贷款风险分类不准确、流动资金贷款被挪用等原因，受到当地银保监局罚款等监管处罚。

国泰君安深圳红荔西路证券营业部、四平中央西路证券营业部由于副总经理实际履行分支机构负责人职责 4 个月未向证监局报备，存在异常交易监控不到位等问题，受到证监会当地监管局出具警示函、责令改正等监管措施。

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，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

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   | 3,145.54     |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 3,045,268.26 |
| 5  | 应收申购款   | 93,928.12    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 3,142,341.92 |

#### 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  | 113013 | 国君转债  | 3,705,345.00 | 3.07   |
| 2  | 110050 | 佳都转债  | 2,551,508.50 | 2.11   |
| 3  | 110034 | 九州转债  | 2,325,923.60 | 1.92   |
| 4  | 110048 | 福能转债  | 2,285,202.50 | 1.89   |
| 5  | 113516 | 吴银转债  | 2,163,600.00 | 1.79   |
| 6  | 128021 | 兄弟转债  | 1,254,300.00 | 1.04   |
| 7  | 113009 | 广汽转债  | 1,142,800.00 | 0.95   |
| 8  | 128026 | 众兴转债  | 210,229.60   | 0.17   |
| 9  | 127012 | 招路转债  | 98,443.80    | 0.08   |
| 10 | 110053 | 苏银转债  | 57,206.70    | 0.05   |
| 11 | 110057 | 现代转债  | 53,746.40    | 0.04   |
| 12 | 113025 | 明泰转债  | 45,144.00    | 0.04   |
| 13 | 113026 | 核能转债  | 42,056.00    | 0.03   |
| 14 | 127013 | 创维转债  | 41,068.60    | 0.03   |
| 15 | 128059 | 视源转债  | 32,791.20    | 0.03   |
| 16 | 113534 | 鼎胜转债  | 30,588.30    | 0.03   |
| 17 | 110051 | 中天转债  | 30,542.20    | 0.03   |
| 18 | 113530 | 大丰转债  | 30,514.40    | 0.03   |
| 19 | 113024 | 核建转债  | 27,427.40    | 0.02   |
| 20 | 110055 | 伊力转债  | 26,661.60    | 0.02   |
| 21 | 113021 | 中信转债  | 26,040.00    | 0.02   |
| 22 | 113022 | 浙商转债  | 25,432.00    | 0.02   |
| 23 | 110058 | 永鼎转债  | 21,536.50    | 0.02   |
| 24 | 123022 | 长信转债  | 20,399.40    | 0.02   |
| 25 | 110052 | 贵广转债  | 19,000.00    | 0.02   |
| 26 | 127011 | 中鼎转 2 | 11,796.00    | 0.01   |

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### §6 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       |
|--------------|---------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 95,654,603.60 | 11,103,031.51 |
| 报告期基金总申购份额   | 16,829,527.11 | 1,466,497.64  |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 11,841,915.62 | 2,617,179.40  |

|              |                |              |
|--------------|----------------|--------------|
| 报告期基金拆分变动份额  | -              | -            |
| 本报告期期末基金份额总额 | 100,642,215.09 | 9,952,349.75 |

## §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

| 项目                       | 国泰金龙债券A       | 国泰金龙债券C |
|--------------------------|---------------|---------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 34,825,373.13 | -       |
| 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         | 34,825,373.13 | -       |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 31.49         | -       |

### 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              | 2020年1月1日至2020年3月31日   | 34,825,373.13 | -    | -    | 34,825,373.13 | 31.49% |
| 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、关于同意设立国泰金龙系列证券投资基金的批复
- 2、国泰金龙系列证券投资基金基金合同
- 3、国泰金龙系列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 16 层-19 层。

### 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

二〇二〇年四月二十二日