

国泰裕祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

2020 年第 2 季度报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年七月二十一日

§ 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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2020 年 7 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 2020 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国泰裕祥三个月定期开放债券
基金主代码	006795
交易代码	006795
基金运作方式	契约型开放式。本基金以定期开放方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。
基金合同生效日	2019 年 9 月 2 日
报告期末基金份额总额	1,009,999,000.00 份
投资目标	在注重风险和流动性管理的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	（一）封闭期投资策略 本基金在债券投资中将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，灵活运用久期策略、收益率曲线策略、类

	属配置策略、利率品种策略、信用债策略、资产支持证券投资策略、中小企业私募债投资策略等多种投资策略，构建债券资产组合，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，动态的对债券投资组合进行调整。 1、久期策略 本基金将基于对宏观经济政策的分析，积极的预测未来利率变化趋势，并根据预测确定相应的久期目标，调整债券组合的久期配置，以达到提高债券组合收益、降低债券组合利率风险的目的。当预期市场利率水平将上升时，本基金将适当降低组合久期；而预期市场利率将下降时，则适当提高组合久期。在确定债券组合久期的过程中，本基金将在判断市场利率波动趋势的基础上，根据债券市场收益率曲线的当前形态，通过合理假设下的情景分析和压力测试，最后确定最优的债券组合久期。 2、收益率曲线策略 在组合的久期配置确定以后，本基金将通过对收益率曲线的研究，分析和预测收益率曲线可能发生的形状变化，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。 3、类属配置策略 本基金对不同类型债券的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。 4、利率品种策略 本基金对国债、央行票据等利率品种的投资，是在对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上，运用数量方法对利
--	---

	率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测，深入分析利率品种的收益和风险，并据此调整债券组合的平均久期。在确定组合平均久期后，本基金对债券的期限结构进行分析，运用统计和数量分析技术，选择合适的期限结构的配置策略，在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，决定投资品种。 5、信用债策略 本基金将通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素，判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值和风险以及信用利差曲线的未来走势，确定信用债券的配置。 6、资产支持证券投资策略 本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。 7、中小企业私募债投资策略 本基金在严格控制风险的前提下，综合考虑中小企业私募债的安全性、收益性和流动性等特征，选择具有相对优势的品种，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。 （二）开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低预期风

	险和预期收益的产品。
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	江苏银行股份有限公司

§ 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 4 月 1 日-2020 年 6 月 30 日)
1. 本期已实现收益	21,441,606.96
2. 本期利润	-4,343,784.31
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0043
4. 期末基金资产净值	1,016,216,455.03
5. 期末基金份额净值	1.0062

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）本基金合同生效日为2019年9月2日，截止至2020年6月30日不满一年。

3.2 基金净值表现

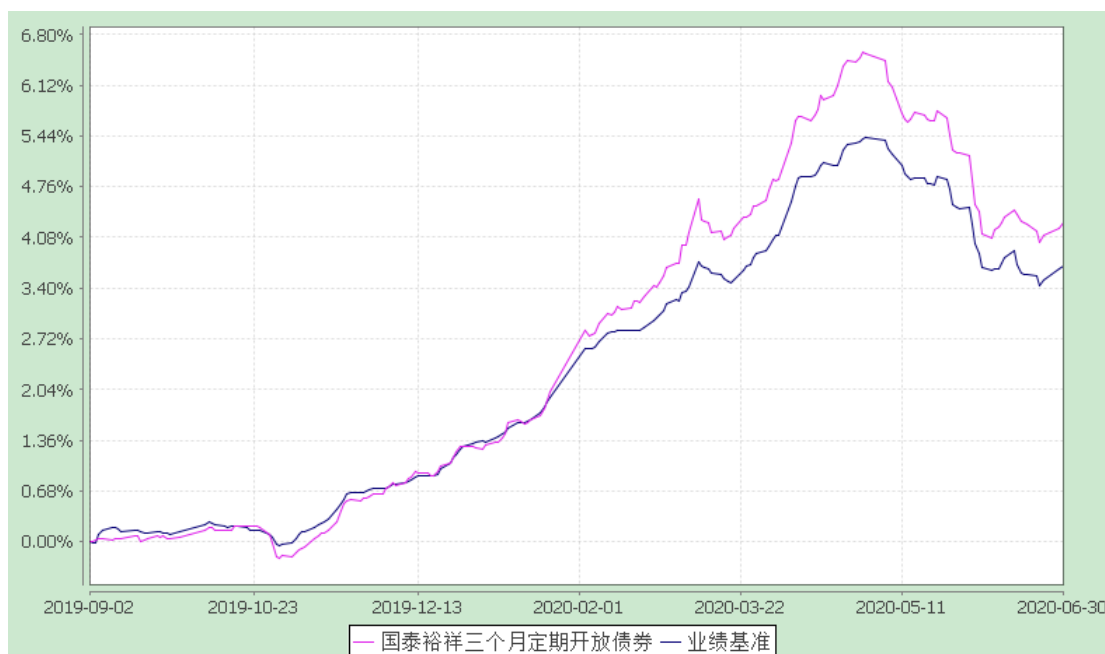
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.41%	0.14%	-0.26%	0.11%	-0.15%	0.03%
过去六个月	2.99%	0.14%	2.32%	0.11%	0.67%	0.03%
自基金合同	4.28%	0.11%	3.69%	0.08%	0.59%	0.03%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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

国泰裕祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019 年 9 月 2 日至 2020 年 6 月 30 日)



注：（1）本基金的合同生效日为2019年9月2日，截止至2020年6月30日，本基金运作时间未
满一年。

（2）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。

§ 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		
黄志翔	本基金的基金经理、	2019-09-02	-	10 年	学士。2010 年 7 月至 2013 年 6 月在华泰柏瑞基金管理有限公司任交易员。2013

	国泰润利纯债债券、国泰民安增益纯债债券、国泰瑞和纯债债券、国泰嘉睿纯债债券、国泰聚享纯债债券、国泰丰盈纯债债券、国泰惠盈纯债债券、国泰润鑫定期开放债券、国泰惠富纯债债券、国泰瑞安三个月定期开放债券、国泰兴富三个月定期开放债券、国泰惠丰纯债债券、国泰盛合三个月			年6月加入国泰基金管理有限公司，历任交易员和基金经理助理。2016年11月至2017年12月任国泰淘金互联网债券型证券投资基金的基金经理，2016年11月至2018年5月任国泰信用债券型证券投资基金的基金经理，2017年3月起兼任国泰润利纯债债券型证券投资基金的基金经理，2017年3月至2017年10月任国泰现金宝货币市场基金的基金经理，2017年4月至2019年10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7月至2019年3月任国泰润鑫纯债债券型证券投资基金的基金经理，2017年8月至2020年5月任国泰瞬利交易型货币市场基金的基金经理，2017年8月至2019年7月任上证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2017年9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，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月起兼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）、国泰瑞和纯债债券型证券投资基金的基金经理，2018年10月起兼任国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金的基金经理，2018年11月至2020年7月任国泰聚禾纯
--	--	--	--	--

	定期开 放债 券、国 泰惠 享三 个月 定期 开放 债券 的基 金经 理				债债券型证券投资基金和 国泰丰祺纯债债券型证券 投资基金的基金经理，2018 年 12 月起兼任国泰聚享纯 债债券型证券投资基金和 国泰丰盈纯债债券型证券 投资基金的基金经理，2019 年 3 月起兼任国泰惠盈纯债 债券型证券投资基金、国泰 润鑫定期开放债券型发起 式证券投资基金（由国泰润 鑫纯债债券型证券投资基 金变更注册而来）、国泰惠 富纯债债券型证券投资基 金的基金经理，2019 年 3 月至 2020 年 7 月任国泰信 利三个月定期开放债券型 发起式证券投资基金的基 金经理，2019 年 5 月起兼 任国泰瑞安三个月定期开 放债券型发起式证券投资 基金的基金经理，2019 年 7 月起兼任国泰兴富三个月 定期开放债券型发起式证 券投资基金的基金经理， 2019 年 8 月起兼任国泰惠 丰纯债债券型证券投资基 金的基金经理，2019 年 9 月起兼任国泰裕祥三个月 定期开放债券型发起式证 券投资基金的基金经理， 2019 年 10 月起兼任国泰盛 合三个月定期开放债券型 发起式证券投资基金的基 金经理，2019 年 12 月起兼 任国泰惠享三个月定期开 放债券型发起式证券投资 基金的基金经理。
--	---	--	--	--	---

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
黄志翔	公募基金	18	23,757,518,987.21	2016/11/7
	私募资产管理计划	/	/	/
	其他组合	1	3,742,454,772.01	2020/4/9
	合计	19	27,499,973,759.22	/

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

4 月，海外疫情进入爆发期，全球货币宽松力度加码，中国央行分别下调公开市场操作利率 20BP、下调超储利率至 0.35%、实施定向降准 1 个百分点，货币宽松带动债券收益率全线下行，中短端下行幅度明显大于长端；5 月，经济及金融数据均好于预期，延续改善方向，货币宽松政策进入观察期，叠加地方债供给压力明显加大，债券收益率上行调整；6 月，货币政策边际转向，特别国债市场化发行启动，降准降息落空，债券收益率明显上行。二季度

来看，1 年期国债上行 46BP 至 2.15%，1 年期国开债上行 45BP 至 2.29%；10 年期国债上行 27BP 至 2.86%，10 年期国开债上行 19BP 至 3.14%。信用债收益率跟随利率债上行，其中 3 年期 AAA、AA+、AA 分别上行 29BP、29BP、41BP 至 3.19%、3.40%及 3.74%，信用利差 1-3 年收窄、3 年以上走阔，期限利差走阔，等级利差先走阔后收窄。

资金方面，4 月，央行开展针对中小银行的定向降准操作，并降低政策利率 20BP，资金面宽松，资金利率下行；5 月，央行实施第二批定向降准操作，并重启公开市场操作，但利率持平，受利率债供给加大影响，资金利率上行；6 月，央行继续开展公开市场操作，但降息降准落空，资金利率明显上行。二季度看来，开展逆回购操作 2.21 万亿，逆回购到期 1.54 万亿；开展 MLF 操作 4000 亿，MLF 到期 1.14 万亿；TMLF 操作 561 亿，TMLF 到期 2674 亿；合计净回笼资金 2813 亿，考虑定向降准释放 4000 亿资金后，净投放资金 1187 亿。DR001 下行 13BP 至 1.48%，DR007 上行 4BP 至 2.13%。其中 6 月 DR007 均值为 1.94%较 4 月的均值 1.46%回升 48BP。

二季度基于对收益率曲线的判断，对组合进行了调仓，增加了操作的频率，降低了长久期利率的仓位以及杠杆水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2020 年第二季度的净值增长率为-0.41%，同期业绩比较基准收益率为-0.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度，美国经济受疫情二次反复影响复苏有所延后，但欧、日、韩经济延续修复；国内经济三季度将延续改善，但受出口、消费及制造业偏弱影响，改善斜率或有波折，且 7-8 月就业压力或明显加大。政策层面，三季度整体货币宽松力度较二季度有所减弱，就业压力凸显或带来短期宽松加码，但未来宽松空间将进一步弱化。总体看来，经济延续修复叠加宽松力度收敛使得三季度利率仍有上行压力，但疫情影响尚未完全消化，货币政策也未完全转向，利率上行有顶。策略上，目前 3 年 AAA 城投债估值收益率 3.26%，1 年 AA 城投债收益率 2.97%，以一个季度来看，利率上行 3BP 以上，1 年 AA 的持有期收益率将优于 3 年 AAA，高等级中长期信用债配置价值弱化，建议逐步调整仓位至短久期中低等级信用债，规避后续利率上行风险。长端利率债三季度或仍有短期交易性机会，但需及时止盈，参与交易需关注两点：（1）经济修复不及预期或就业压力加大，使得基本面对利率上行空间依然有制约。（2）利率调整出现安全边际，预计三季度利率难以大幅突破疫情前水平，10 年国债 3%或是短期震荡区间上限，靠近 3%可积极关注短期交易机会。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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	固定收益投资	1,097,680,000.00	98.45
	其中：债券	1,097,680,000.00	98.45
	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	374,473.60	0.03
7	其他各项资产	16,901,524.17	1.52
8	合计	1,114,955,997.77	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	958,022,000.00	94.27
	其中：政策性金融债	199,430,000.00	19.62
4	企业债券	91,188,000.00	8.97
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	48,470,000.00	4.77
9	其他	-	-
10	合计	1,097,680,000.00	108.02

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	190202	19 国开 02	1,000,000	100,900,000.00	9.93
2	200402	20 农发 02	1,000,000	98,530,000.00	9.70
3	1920062	19 宁波银行小微债 03	900,000	91,737,000.00	9.03
4	1928027	19 浙商银行绿色金融	900,000	91,386,000.00	8.99
5	1928030	19 招商银行小微债 02	900,000	91,386,000.00	8.99

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，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、处罚的情况如下：

北京银行及下属分支机构因员工大额消费贷款违规行为长期未有效整改；同业业务专营部门制改革不到位；同业投资违规接受第三方金融机构信用担保；个人消费贷款被挪用于支付购房首付款或投资股权；个别个人商办用房贷款违反房地产调控政策；同业投资通过信托通道违规发放土地储备贷款；信贷业务管理严重违反审慎经营规则；未按规定审查银行承兑汇票业务贸易背景真实性原因，多次受到当地银保监公开处罚。

贵阳银行下属分支机构因存在以自有资金借道发放信托贷款，大部分用于置换表内信贷资产及承接类信贷资产隐匿不良；向关系人发放信用贷款；重要岗位轮岗执行不到位；理财资金借助通道发放委托贷款，部分资金被挪用于兑付融资人发行的私募债、从部分理财产品中提取投资风险互换金，用于调节收益，刚性兑付；理财资金投资该行信贷资产收益权；代为履职超过规定期限，股东出质银行股份

未向董事会备案，违规为环保排放不达标、严重污染环境企业提供授信；以贷还贷、掩盖不良，贷款五级分类不准确等原因，多次受到当地银保监公开处罚。

国开行下属分支机构因存在“四证”不全的房地产项目发放贷款；未审核信贷资金是否按约定用途使用；贷款五级分类不准确；超权限办理委托贷款；未按规定受托支付；严重违反审慎经营规则；违规为地方政府提供债务融资等原因，多次受到当地银保监公开处罚。

华泰证券因未按规定履行客户身份识别义务、未按规定报送可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易；使用未经报备的宣传推介材料等原因，受到监管公开处罚。

宁波银行下属分支机构因违反信贷政策、违反房地产行业政策；违规开展存贷业务；员工管理不到位；向监管部门报送的报表不准确；存在存贷款挂钩行为；个人贷款用途管控不严等原因，多次受到当地人行及银保监公开处罚。

深圳农商行下属分支机构因重大关联交易未按照监管要求进行审批；强制休假及重要岗位轮岗执行严重不到位；流动资金贷款审查严重不尽职；贷前调查不尽职导致信贷资金被挪用于缴纳土地出让金；贷款用途审查不尽职导致信贷资金回流借款人；向项目资本金不足的项目发放房地产开发贷款；以贷收贷；利用本行信贷资金承接理财产品等等原因，多次受到当地银保监公开处罚。

招商银行下属分支机构因个人贷款管理不审慎，个人贷款资金违规流入房市；贷款发放不审慎，未严格审核楼盘结项情况即发放个人住房按揭贷款；对项目资本金认定不准确，向资本金不足的房开项目发放贷款；贷款管理不审慎，贷款资金转为单位定期存款等原因，多次受到当地银保监公开处罚。

浙商银行下属分支机构因未按规定履行客户身份识别义务；未按规定保存客户身份资料及交易记录；未按规定进行可疑交易报告；与身份不明的客户进行交易；

以不当方式吸收存款；贷款资金专做承兑汇票保证金等原因，多次受到当地人行及银保监公开处罚。

农发行下属分支机构因未经监管部门核准提前授权三名拟任支行高管人员实际履职；未严格落实“实贷实付”原则，部分贷款资金滞留借款人账户、贷后检查不到位等原因，多次受到当地银保监公开处罚。

中信银行下属分支机构因违规发放土地储备贷款；受托支付不符合监管规定；信托消费贷款业务开展不审慎；流动资金贷款被挪用于股权投资；信贷资金被挪用流入房地产开发公司；个人经营性贷款资金被挪用于购房；非真实转让不良信贷资产；未对融资人交易材料合理性进行必要的审查，资金被用于缴纳土地竞买保证金；违规为房地产开发企业发放流动资金性质融资；签署抽屉协议互投涉房信贷资产腾挪信贷规模；卖出回购信贷资产收益权，实现信贷规模阶段性出表；理财资金违规投向未上市房地产企业股权；理财资金被挪用于支付土地出让价款；违规向资本金不足的房地产开发项目提供融资；并购贷款真实性审核不足，借款人变相用于置换项目公司缴纳的土地出让价款；协助合作机构签署抽屉协议，规避相关监管规定；理财资金实际用于置换项目前期股东支付的土地出让金；违规为房地产企业支付土地购置费用提供融资；违规向四证不全的商业性房地产开发项目提供融资等原因，多次受到当地人行及银保监公开处罚。

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	-

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,901,524.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,901,524.17

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

本基金本报告期末未持有股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	1,009,999,000.00
报告期基金总申购份额	-
减：报告期基金总赎回份额	-
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,009,999,000.00

§ 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

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
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	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.99

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 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	10,000,000.00	0.99%	10,000,000.00	0.99%	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	10,000,000.00	0.99%	10,000,000.00	0.99%	—

§ 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

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 4 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	999,999,000.00	—	—	999,999,000.00	99.01%
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。							

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、国泰裕祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同
- 2、国泰裕祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰裕祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复
- 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

10.2 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。

10.3 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
二〇二〇年七月二十一日