

**国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金**  
**2020 年中期报告**  
**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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月三十一日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本中期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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2020 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>1 重要提示及目录</b>                        | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| <b>2 基金简介</b>                           | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 7         |
| 2.5 其他相关资料                              | 7         |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>                  | <b>7</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7         |
| 3.2 基金净值表现                              | 8         |
| <b>4 管理人报告</b>                          | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明              | 14        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 14        |
| 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             | 15        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 16        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 16        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 17        |
| 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       | 17        |
| <b>5 托管人报告</b>                          | <b>17</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 17        |
| 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 | 17        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 17        |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>                | <b>17</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 17        |
| 6.2 利润表                                 | 19        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 20        |
| 6.4 报表附注                                | 21        |
| <b>7 投资组合报告</b>                         | <b>38</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 38        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 39        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 39        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 39        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 39        |
| 7.6 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      | 40        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 40        |
| 7.8 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   | 40        |
| 7.9 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      | 40        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明               | 40        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 40        |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 41        |
| <b>8 基金份额持有人信息</b>                      | <b>42</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 42        |

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 42        |
| 8.3 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 ..... | 42        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....               | 42        |
| <b>9 开放式基金份额变动.....</b>                 | <b>43</b> |
| <b>10 重大事件揭示.....</b>                   | <b>43</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 43        |
| 10.2 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 .....  | 43        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 43        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                     | 43        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 44        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....     | 44        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 44        |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 45        |
| <b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>          | <b>45</b> |
| <b>12 备查文件目录.....</b>                   | <b>46</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                       | 46        |
| 12.2 存放地点 .....                         | 46        |
| 12.3 查阅方式 .....                         | 46        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                                          |
|------------|------------------------------------------|
| 基金名称       | 国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金                  |
| 基金简称       | 国泰瑞安三个月定期开放债券                            |
| 基金主代码      | 006994                                   |
| 交易代码       | 006994                                   |
| 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 5 月 30 日                          |
| 基金管理人      | 国泰基金管理有限公司                               |
| 基金托管人      | 平安银行股份有限公司                               |
| 报告期末基金份额总额 | 1,010,000,000.00 份                       |
| 基金合同存续期    | 不定期                                      |

### 2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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 | <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>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。</p> <p>1、久期策略</p> <p>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。</p> <p>2、收益率曲线策略</p> <p>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。</p> <p>3、类属配置策略</p> <p>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</p> |

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>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。</p> <p>4、利率品种策略</p> <p>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。</p> <p>5、信用债策略</p> <p>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。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>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。</p> <p>7、中小企业私募债投资策略</p> <p>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。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>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。</p> |
| 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。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |

## 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                   | 平安银行股份有限公司                    |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 刘国华                          | 李帅帅                           |
|             | 联系电话 | 021-31081600转                | 0755-25878287                 |
|             | 电子邮箱 | xinxipilu@gtfund.com         | LISHUAISHUA1130@pingan.com.cn |
| 客户服务电话      |      | (021) 31089000, 400-888-8688 | 95511-3                       |
| 传真          |      | 021-31081800                 | 0755-82080387                 |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区                | 广东省深圳市罗湖区深南东路                 |

|       |                            |                              |
|-------|----------------------------|------------------------------|
|       | 浦东大道1200号2层225室            | 5047 号                       |
| 办公地址  | 上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层 | 广东省深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座26楼 |
| 邮政编码  | 200082                     | 518001                       |
| 法定代表人 | 陈勇胜                        | 谢永林                          |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                           |
|---------------------|-----------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券时报》                                                    |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.gtfund.com">http://www.gtfund.com</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 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                 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称               | 办公地址                              |
|--------|------------------|-----------------------------------|
| 注册登记机构 | 国泰基金管理有限公司登记注册中心 | 上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层 |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 17,393,366.20                        |
| 本期利润          | 18,410,700.66                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0182                               |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.75%                                |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.78%                                |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020 年 6 月 30 日)                |
| 期末可供分配利润      | 36,565,547.17                        |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0362                               |
| 期末基金资产净值      | 1,051,050,035.73                     |
| 期末基金份额净值      | 1.0406                               |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2020 年 6 月 30 日)                |
| 基金份额累计净值增长率   | 4.06%                                |

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。

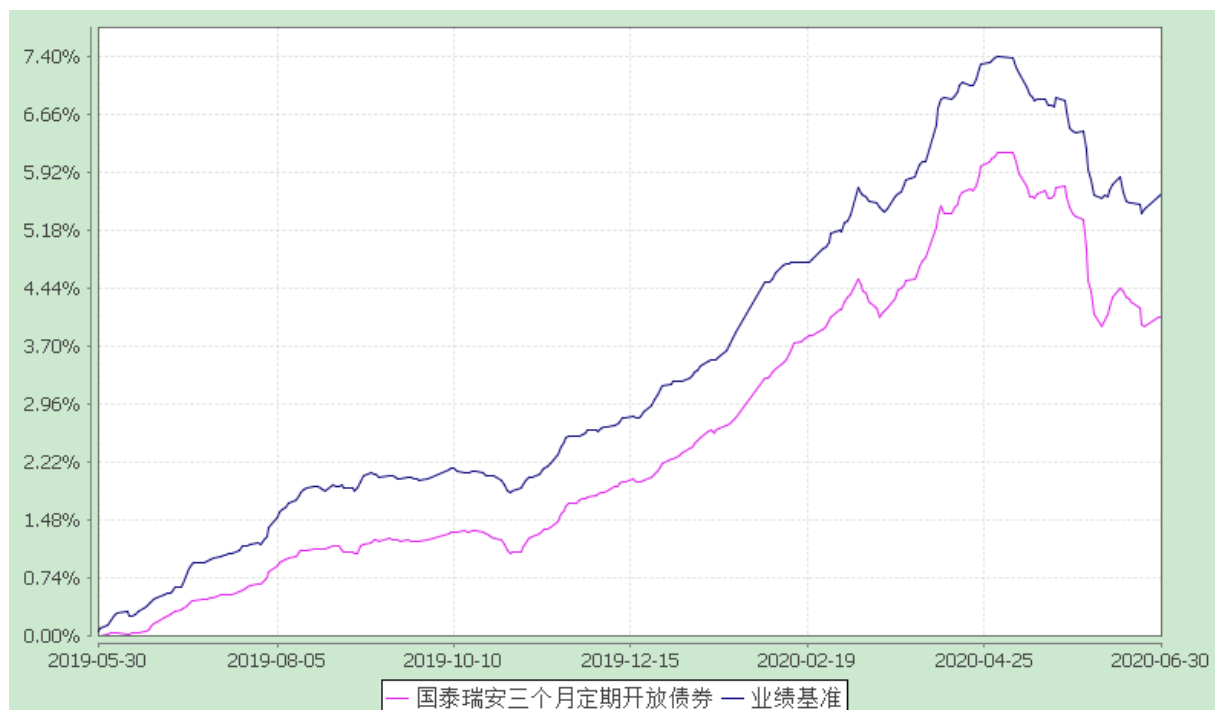
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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         | 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | -1.22%   | 0.15%       | -0.74%     | 0.11%         | -0.48% | 0.04% |
| 过去三个月      | -0.51%   | 0.12%       | -0.26%     | 0.11%         | -0.25% | 0.01% |
| 过去六个月      | 1.78%    | 0.11%       | 2.32%      | 0.11%         | -0.54% | 0.00% |
| 过去一年       | 3.73%    | 0.08%       | 5.00%      | 0.08%         | -1.27% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.06%    | 0.07%       | 5.64%      | 0.07%         | -1.58% | 0.00% |

#### 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

国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金  
 份额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 5 月 30 日至 2020 年 6 月 30 日)



注：本基金合同生效日为 2019 年 5 月 30 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。

## 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 2020 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 141 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）、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、国泰国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、国泰国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、国泰国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）、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）、国泰价值优选灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鹿混合型证券投资基金（由国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰消费

优选股票型证券投资基金、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、国泰农惠定期开放债券型证券投资基金、国泰信利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民福保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金（由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金更名而来）、国泰中证 500 指数增强型证券投资基金（由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来）、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰民安养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民利保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、国泰兴富三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠丰纯债债券型证券投资基金、国泰惠融纯债债券型证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金、国泰裕祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰丰鑫纯债债券型证券投资基金、国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠信三年定期开放债券型证券投资基金、国泰鑫睿混合型证券投资基金、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更名而来）、国泰惠享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰添瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰研究精选两年持有期混合型证券投资基金、国泰聚盈三年定期开放债券型证券投资基金、国泰合融纯债债券型证券投资基金、国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金、国泰鑫利一年持有期混合型证券投资基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金、国泰蓝筹精选混合型证券投资基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰聚鑫纯债债券型证券投资基金、国泰聚瑞纯债债券型证券投资基金、国泰大制造两年持有期混合型证券投资基金、国泰惠泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰宏益一年持有期混合型证券投资基金。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<br>（助理）期限 |      | 证券从业<br>年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|------|------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                                                                                                                                                     | 任职日期                | 离任日期 |            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 黄志翔 | 本基金的基金经理、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、国泰兴富三个月定期开放债券、国泰惠丰纯债债券、国泰裕祥三个月定期开放债券、国泰盛合三个月定期开放债券、国泰惠享三个月定期开放债券的基金经理 | 2019-05-30          | -    | 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 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。 |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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。

#### 4.1.3 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

| 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 |          |

## 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。

### 4.3.2 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 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

一季度央行采取积极的货币政策，进行了两次降准，为市场注入流动性。公开市场操作和利率方面，2月央行开启大规模公开市场逆回购，于2月17日公布1年期MLP和1年期LPR为3.15%和4.05%，分别下降10个基点；5年期LPR为4.75%，下调5个基点。3月，央行的货币政策表现出“定力”，在美联储降息100BP并重启QE后，维持了MLP和LPR的报价。中央定调今年的货币政策要适度灵活，引导贷款市场利率下行；要加大财政政策力度，提高赤字率，要发挥财政逆周期调节作用，发行特别国债。一季度货币市场利率中枢整体继续下行，银行间货币市场成交234.4万亿元，同比下降1.3%，利率债和高等级信用债收益率持续震荡、低等级信用债收益率维持高位。

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。

在这一市场环境下，一季度组合降低了杠杆但提升了组合久期。操作上面主要以中长久期信用

债置换短期信用债，在收益率下行阶段取得较好效果，二季度增加了操作的频率，尝试了中等久期高等级信用债的波段操作，在债市回调期间效果较差。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 2020 年上半年净值增长率为 1.78%，同期业绩比较基准收益率为 2.32%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于债市而言，5 月以来，债券市场在经济修复、货币政策收敛及股债跷跷板冲击影响下，利率持续上行，1 年期国债上行接近 100BP，10 年国债上行 50BP 至 3.1%后逐步回落至 2.9%附近，利率水平已回到疫情前。而当前经济仍未修复至疫情前，货币政策尚不具备转向基础，资金价格中枢仍有望保持在政策利率水平上下，因此利率大幅上行风险可控，整体将步入震荡走势。

利率债方面，7 月以来，在股市快速上涨影响下，利率出现一定超调迹象，目前长端已蕴含了经济向疫情前水平修复及货币政策收敛的预期，中短端对新的资金中枢重定价基本完成，未来有望稳定的资金价格中枢，为中短端 1-5 年利率债提供有力支撑。从期限利差来看，目前 3-1 年及 5-3 年政金债期限利差均处于 2012 年以来 70%分位数以上水平，期限利差保护较好。从近期一级招标情况来看，1-5 年政金债需求较好，全场倍数多在 3 倍以上，且多以低估值中标。7 月以来，摊余成本法债基单月募集规模已超过 700 亿元，作为摊余成本法债基主要配置品种的中短端政金债需求明显加强，配置价值凸显。长端利率的交易机会需关注经济修复不及预期、中美摩擦升级等触发因素。

信用债方面，在宽信用政策支持下，企业筹资性现金流明显改善，但疫情对企业经营性现金流的负面影响尚未完全消化，信用资质有限改善。结构上，城投债受益于外部融资支持政策更强，具有挖掘价值；地产债受“房住不炒”政策影响下，龙头效应依然明显，龙头民企配置价值更优，但需关注高杠杆、对非标依赖较强等风险特征；而具有多元化经营、扩张激进等特征的民营企业需保持谨慎。

可转债方面，当前沪深 300 指数 PE/PB 估值均仍处于最近十年周期历史较低水平，转债资产的股性估值存在提升空间，同时，转债市场供需双向扩容趋势明显，纯债资产产生的机会成本相对较低，转债资产配置价值显著提升，重点关注传统行业中的优质标的及新兴成长行业中的核心龙头转债资产的投资机会。

#### 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

不适用。

### 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            | -                              | -                                |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 1,018,360.92                   | 1,189,191.49                     |
| 结算备付金           |            | 17,615,472.60                  | 285,752.66                       |
| 存出保证金           |            | 25,567.03                      | 73,356.27                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 1,291,590,000.00               | 1,398,844,000.00                 |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 1,291,590,000.00               | 1,398,844,000.00                 |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 应收证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 17,335,772.08                  | 18,031,365.53                    |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>1,327,585,172.63</b>        | <b>1,418,423,665.95</b>          |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2019 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            | -                              | -                                |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | 275,949,611.52                 | 384,999,378.95                   |
| 应付证券清算款         |            | 20,563.17                      | -                                |
| 应付赎回款           |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 258,979.22                     | 262,399.23                       |
| 应付托管费           |            | 86,326.42                      | 87,466.39                        |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 13,680.97                      | 30,923.68                        |
| 应交税费            |            | 79,768.93                      | 76,817.79                        |
| 应付利息            |            | 21,780.53                      | 157,344.84                       |
| 应付利润            |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债         |            | -                              | -                                |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 104,426.14                     | 170,000.00                       |
| <b>负债合计</b>     |            | <b>276,535,136.90</b>          | <b>385,784,330.88</b>            |
| <b>所有者权益：</b>   |            | -                              | -                                |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 1,010,000,000.00               | 1,010,000,000.00                 |

|                   |          |                         |                         |
|-------------------|----------|-------------------------|-------------------------|
| 未分配利润             | 6.4.7.10 | 41,050,035.73           | 22,639,335.07           |
| <b>所有者权益合计</b>    |          | <b>1,051,050,035.73</b> | <b>1,032,639,335.07</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |          | <b>1,327,585,172.63</b> | <b>1,418,423,665.95</b> |

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0406 元，基金份额总额 1,010,000,000 份；

## 6.2 利润表

会计主体：国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 5 月 30 日（基<br>金合同生效日）至 2019<br>年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |          | <b>24,047,342.12</b>                     | <b>3,581,645.22</b>                                         |
| 1.利息收入                |          | 22,225,289.32                            | 2,138,923.67                                                |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11 | 166,816.30                               | 95,962.44                                                   |
| 债券利息收入                |          | 22,058,473.02                            | 1,028,932.72                                                |
| 资产支持证券利息收入            |          | -                                        | -                                                           |
| 买入返售金融资产收入            |          | -                                        | 1,014,028.51                                                |
| 证券出借利息收入              |          | -                                        | -                                                           |
| 其他利息收入                |          | -                                        | -                                                           |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 804,718.34                               | -                                                           |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12 | -                                        | -                                                           |
| 基金投资收益                |          | -                                        | -                                                           |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13 | 804,718.34                               | -                                                           |
| 资产支持证券投资收益            |          | -                                        | -                                                           |
| 贵金属投资收益               |          | -                                        | -                                                           |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.14 | -                                        | -                                                           |
| 股利收益                  | 6.4.7.15 | -                                        | -                                                           |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 1,017,334.46                             | 1,442,721.55                                                |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -                                        | -                                                           |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     |          | -                                        | -                                                           |
| <b>减：二、费用</b>         |          | <b>5,636,641.46</b>                      | <b>373,420.72</b>                                           |
| 1. 管理人报酬              |          | 1,571,977.65                             | 257,580.29                                                  |
| 2. 托管费                |          | 523,992.53                               | 85,860.11                                                   |
| 3. 销售服务费              |          | -                                        | -                                                           |
| 4. 交易费用               | 6.4.7.17 | 7,628.68                                 | 3,331.40                                                    |
| 5. 利息支出               |          | 3,358,639.16                             | -                                                           |
| 其中：卖出回购金融资产支出         |          | 3,358,639.16                             | -                                                           |
| 6.税金及附加               |          | 51,377.30                                | 1,463.64                                                    |

|                            |          |                      |                     |
|----------------------------|----------|----------------------|---------------------|
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.18 | 123,026.14           | 25,185.28           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>18,410,700.66</b> | <b>3,208,224.50</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                    | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>18,410,700.66</b> | <b>3,208,224.50</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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）                        | 1,010,000,000.00                                     | 22,639,335.07 | 1,032,639,335.07 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                                    | 18,410,700.66 | 18,410,700.66    |
| 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）      | -                                                    | -             | -                |
| 其中：1.基金申购款                             | -                                                    | -             | -                |
| 2.基金赎回款                                | -                                                    | -             | -                |
| 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） | -                                                    | -             | -                |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,010,000,000.00                                     | 41,050,035.73 | 1,051,050,035.73 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2019 年 5 月 30 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 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）                        | 1,010,000,000.00                                     | -             | 1,010,000,000.00 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                                    | 3,208,224.50  | 3,208,224.50     |
| 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）      | -                                                    | -             | -                |
| 其中：1.基金申购款                             | -                                                    | -             | -                |
| 2.基金赎回款                                | -                                                    | -             | -                |

|                                        |                  |              |                  |
|----------------------------------------|------------------|--------------|------------------|
| 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） | -                | -            | -                |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,010,000,000.00 | 3,208,224.50 | 1,013,208,224.50 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金(简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]122 号《关于准予国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。根据《国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金以定期开放的方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。自基金合同生效日(含基金合同生效日)起或自每一个开放期结束之日次日(含该日)起 3 个月的期间内，本基金采取封闭运作模式。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。每一个封闭期结束后，本基金即进入开放期，开放期的期限为自封闭期结束之日后第一个工作日(含该日)起不少于 5 个工作日并且最长不超过 10 个工作日，具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。开放期内，本基金采取开放运作模式，投资人可办理基金份额申购、赎回或其他业务，开放期末赎回的份额将自动转入下一个封闭期。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,010,000,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0328 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 5 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,010,000,000.00 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,000.00 基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具体良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、同业存单等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票、权证，不参与新股申购和新股增发，也不投资于可交换债券、可转换债券。本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%，但因开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，每个开放期开始前 10 个交易日至开放期及开放期结束后 10 个交易日内不受前述比例限制。开放期内，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制；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 2020 年 8 月 27 日批准报出。

#### 6.4.2 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<年度报告和中期报告>》、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》、《国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年半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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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。

#### 6.4.5 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。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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：

(1) 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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖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，以利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 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。

(4) 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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 1,018,360.92           |
| 定期存款 | -                      |
| 其他存款 | -                      |
| 合计   | 1,018,360.92           |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |                  |              |
|---------------|-------|------------------------|------------------|--------------|
|               |       | 成本                     | 公允价值             | 公允价值变动       |
| 股票            |       | -                      | -                | -            |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                      | -                | -            |
| 债券            | 交易所市场 | 380,361,353.98         | 380,493,000.00   | 131,646.02   |
|               | 银行间市场 | 906,744,157.46         | 911,097,000.00   | 4,352,842.54 |
|               | 合计    | 1,287,105,511.44       | 1,291,590,000.00 | 4,484,488.56 |
| 资产支持证券        |       | -                      | -                | -            |
| 基金            |       | -                      | -                | -            |
| 其他            |       | -                      | -                | -            |
| 合计            |       | 1,287,105,511.44       | 1,291,590,000.00 | 4,484,488.56 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 708.37                 |
| 应收定期存款利息   | -                      |
| 应收其他存款利息   | -                      |
| 应收结算备付金利息  | 7,927.00               |
| 应收债券利息     | 17,327,125.21          |
| 应收资产支持证券利息 | -                      |
| 应收买入返售证券利息 | -                      |
| 应收申购款利息    | -                      |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                      |
| 应收出借证券利息   | -                      |
| 其他         | 11.50                  |
| 合计         | 17,335,772.08          |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                      |
| 银行间市场应付交易费用 | 13,680.97              |
| 合计          | 13,680.97              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 其他应付款       | -                      |
| 预提费用        | 104,426.14             |
| 合计          | 104,426.14             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                  |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额             |
| 上年度末          | 1,010,000,000.00                      | 1,010,000,000.00 |
| 本期申购          | -                                     | -                |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -                |
| 本期末           | 1,010,000,000.00                      | 1,010,000,000.00 |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分        | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|--------------|---------------|
| 上年度末           | 19,172,180.97 | 3,467,154.10 | 22,639,335.07 |
| 本期利润           | 17,393,366.20 | 1,017,334.46 | 18,410,700.66 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -             | -            | -             |
| 其中：基金申购款       | -             | -            | -             |
| 基金赎回款          | -             | -            | -             |
| 本期已分配利润        | -             | -            | -             |
| 本期末            | 36,565,547.17 | 4,484,488.56 | 41,050,035.73 |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |  |
|-----------|---------------------------------------|--|
|           |                                       |  |
| 活期存款利息收入  | 25,800.45                             |  |
| 定期存款利息收入  | -                                     |  |
| 其他存款利息收入  | -                                     |  |
| 结算备付金利息收入 | 140,888.73                            |  |
| 其他        | 127.12                                |  |
| 合计        | 166,816.30                            |  |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |  |
|----|----------------------------|--|
|    |                            |  |

|                        |                |
|------------------------|----------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 969,362,369.45 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 954,715,078.48 |
| 减：应收利息总额               | 13,842,572.63  |
| 买卖债券差价收入               | 804,718.34     |

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产              | 1,017,334.46               |
| ——股票投资                 | -                          |
| ——债券投资                 | 1,017,334.46               |
| ——资产支持证券投资             | -                          |
| ——基金投资                 | -                          |
| ——贵金属投资                | -                          |
| ——其他                   | -                          |
| 2.衍生工具                 | -                          |
| ——权证投资                 | -                          |
| 3.其他                   | -                          |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                          |
| 合计                     | 1,017,334.46               |

#### 6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 941.18                     |
| 银行间市场交易费用 | 6,687.50                   |

|    |          |
|----|----------|
| 合计 | 7,628.68 |
|----|----------|

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 44,753.80                  |
| 信息披露费   | 59,672.34                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 债券账户服务费 | 18,000.00                  |
| 上清所查询费  | 600.00                     |
| 合计      | 123,026.14                 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 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 |
| 平安银行股份有限公司（“平安银行”） | 基金托管人               |

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                  | 2020年1月1日至2020年6月<br>30日 | 2019年5月30日(基金合同生<br>效日)至2019年6月30日 |
|------------------|--------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 1,571,977.65             | 257,580.29                         |
| 其中: 支付销售机构的客户维护费 | -                        | -                                  |

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 0.30%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 X 0.30% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

| 项目             | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2019年5月30日(基金合同<br>生效日)至2019年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 523,992.53                     | 85,860.11                                     |

注: 支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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 X 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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>2020年1月1日至2020年6月30日 | 上年度可比期间<br>2019年5月30日(基金合同生效日)至<br>2019年6月30日 |
|------------------------------------|----------------------------|-----------------------------------------------|
| 基金合同生效日<br>(2019年5月30日)<br>持有的基金份额 | -                          | 10,000,000.00                                 |
| 期初持有的基金份<br>额                      | 10,000,000.00              | -                                             |
| 期间申购/买入总份<br>额                     | -                          | -                                             |
| 期间因拆分变动份<br>额                      | -                          | -                                             |
| 减: 期间赎回/卖出总<br>份额                  | -                          | -                                             |
| 期末持有的基金份<br>额                      | 10,000,000.00              | 10,000,000.00                                 |

|                       |       |       |
|-----------------------|-------|-------|
| 期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例 | 0.99% | 0.99% |
|-----------------------|-------|-------|

#### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末 2019 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 |
| 平安银行  | 1,000,000,000.00    | 99.01%           | 1,000,000,000.00      | 99.01%           |

#### 6.4.10.5 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>2020年1月1日至2020年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2019年5月30日（基金合同生效日）至2019年6月30日 |           |
|-------|----------------------------|-----------|-------------------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                       | 当期利息收入    | 期末余额                                      | 当期利息收入    |
| 平安银行  | 1,018,360.92               | 25,800.45 | 2,129,260.59                              | 89,832.71 |

注：本基金的银行活期存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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。

#### 6.4.12.2 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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 136,949,611.52 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码    | 债券名称          | 回购到期日      | 期末估值<br>单价 | 数量（张）        | 期末估值总额         |
|---------|---------------|------------|------------|--------------|----------------|
| 1980323 | 19 华发集团<br>01 | 2020-07-01 | 103.17     | 600,000.00   | 61,902,000.00  |
| 1980341 | 19 成产业债<br>01 | 2020-07-01 | 101.71     | 510,000.00   | 51,872,100.00  |
| 180208  | 18 国开 08      | 2020-07-01 | 101.51     | 390,000.00   | 39,588,900.00  |
| 合计      |               |            |            | 1,500,000.00 | 153,363,000.00 |

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 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 139,000,000.00 元，截至 2020 年 7 月 1 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金投资的金融工具主要为债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金投资目标：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。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别

的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部、审计部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、审计、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行平安银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2020年6月30日 | 上年末<br>2019年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1    | -                 | 100,110,000.00     |
| A-1 以下 | -                 | -                  |
| 未评级    | -                 | 25,030,000.00      |
| 合计     | -                 | 125,140,000.00     |

注：本基金持有的未评级债券包括超短期融资券。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 | 上年末 |
|--------|-----|-----|
|--------|-----|-----|

|        | 2020年6月30日       | 2019年12月31日      |
|--------|------------------|------------------|
| AAA    | 1,230,684,000.00 | 1,019,712,000.00 |
| AAA 以下 | -                | -                |
| 未评级    | 60,906,000.00    | 60,042,000.00    |
| 合计     | 1,291,590,000.00 | 1,079,754,000.00 |

注：本基金持有的未评级债券包括政策性金融债。

#### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2020年6月30日 | 上年末<br>2019年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA    | -                 | 193,950,000.00     |
| AAA 以下 | -                 | -                  |
| 未评级    | -                 | -                  |
| 合计     | -                 | 193,950,000.00     |

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 275,949,611.52 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》，且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通

受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020 年 6 月 30 日   | 1 年以内           | 1-5 年            | 5 年以上          | 不计息           | 合计               |
|--------------------------|-----------------|------------------|----------------|---------------|------------------|
| 资产                       |                 |                  |                |               |                  |
| 银行存款                     | 1,018,360.92    | -                | -              | -             | 1,018,360.92     |
| 结算备付金                    | 17,615,472.60   | -                | -              | -             | 17,615,472.60    |
| 存出保证金                    | 25,567.03       | -                | -              | -             | 25,567.03        |
| 交易性金融资产                  | 60,906,000.00   | 1,027,204,000.00 | 203,480,000.00 | -             | 1,291,590,000.00 |
| 应收利息                     | -               | -                | -              | 17,335,772.08 | 17,335,772.08    |
| 资产总计                     | 79,565,400.55   | 1,027,204,000.00 | 203,480,000.00 | 17,335,772.08 | 1,327,585,172.63 |
| 负债                       |                 |                  |                |               |                  |
| 应付交易费用                   | -               | -                | -              | 13,680.97     | 13,680.97        |
| 卖出回购金融资产款                | 275,949,611.52  | -                | -              | -             | 275,949,611.52   |
| 应付管理人报酬                  | -               | -                | -              | 258,979.22    | 258,979.22       |
| 应付清算款                    | -               | -                | -              | 20,563.17     | 20,563.17        |
| 应付托管费                    | -               | -                | -              | 86,326.42     | 86,326.42        |
| 应交税费                     | -               | -                | -              | 79,768.93     | 79,768.93        |
| 应付利息                     | -               | -                | -              | 21,780.53     | 21,780.53        |
| 其他负债                     | -               | -                | -              | 104,426.14    | 104,426.14       |
| 负债总计                     | 275,949,611.52  | -                | -              | 585,525.38    | 276,535,136.90   |
| 利率敏感度缺口                  | -196,384,210.97 | 1,027,204,000.00 | 203,480,000.00 | 16,750,246.70 | 1,051,050,035.73 |
| 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 | 1 年以内           | 1-5 年            | 5 年以上          | 不计息           | 合计               |
| 资产                       |                 |                  |                |               |                  |
| 银行存款                     | 1,189,191.49    | -                | -              | -             | 1,189,191.49     |
| 结算备付金                    | 285,752.66      | -                | -              | -             | 285,752.66       |
| 存出保证金                    | 73,356.27       | -                | -              | -             | 73,356.27        |
| 交易性金融资产                  | 529,834,000.00  | 869,010,000.00   | -              | -             | 1,398,844,000.00 |
| 应收利息                     | -               | -                | -              | 18,031,365.53 | 18,031,365.53    |

|           |                |                |   |               |                  |
|-----------|----------------|----------------|---|---------------|------------------|
| 资产总计      | 531,382,300.42 | 869,010,000.00 | - | 18,031,365.53 | 1,418,423,665.95 |
| 负债        |                |                |   |               |                  |
| 应付交易费用    | -              | -              | - | 30,923.68     | 30,923.68        |
| 卖出回购金融资产款 | 384,999,378.95 | -              | - | -             | 384,999,378.95   |
| 应付管理人报酬   | -              | -              | - | 262,399.23    | 262,399.23       |
| 应付托管费     | -              | -              | - | 87,466.39     | 87,466.39        |
| 应交税费      | -              | -              | - | 76,817.79     | 76,817.79        |
| 应付利息      | -              | -              | - | 157,344.84    | 157,344.84       |
| 其他负债      | -              | -              | - | 170,000.00    | 170,000.00       |
| 负债总计      | 384,999,378.95 | -              | - | 784,951.93    | 385,784,330.88   |
| 利率敏感度缺口   | 146,382,921.47 | 869,010,000.00 | - | 17,246,413.60 | 1,032,639,335.07 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除利率外其他市场条件不变  |                                  |                          |
|----|---------------|----------------------------------|--------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动     | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币万元） |                          |
|    |               | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日           | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日 |
|    | 市场利率上升 25 个基点 | 减少约 993                          | 减少约 851                  |
|    | 市场利率下降 25 个基点 | 增加约 1,006                        | 增加约 863                  |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易

的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

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、回购交易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。

本基金投资组合中债券资产的比例不低于基金资产的 80%；持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资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、存出保证金及应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此无其他价格风险敞口。

#### 6.4.14 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 2020 年 6 月 30 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无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为 1,291,590,000.00 元，无属于第三层次的余额(于 2019 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无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为 1,398,844,000.00 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。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 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)其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 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   | 1,291,590,000.00 | 97.29         |
|    | 其中：债券    | 1,291,590,000.00 | 97.29         |
|    | 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      | 18,633,833.52    | 1.40   |
| 8 | 其他各项资产            | 17,361,339.11    | 1.31   |
| 9 | 合计                | 1,327,585,172.63 | 100.00 |

## 7.2 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。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

## 7.5 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      | 162,522,000.00 | 15.46        |
|    | 其中：政策性金融债 | 60,906,000.00  | 5.79         |
| 4  | 企业债券      | 554,588,000.00 | 52.77        |

|    |           |                  |        |
|----|-----------|------------------|--------|
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -      |
| 6  | 中期票据      | 574,480,000.00   | 54.66  |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -      |
| 8  | 同业存单      | -                | -      |
| 9  | 其他        | -                | -      |
| 10 | 合计        | 1,291,590,000.00 | 122.89 |

#### 7.6 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  | 155616    | 19 恒健 02      | 1,000,000 | 100,390,000.00 | 9.55         |
| 2  | 155240    | 19 华泰 G1      | 900,000   | 91,188,000.00  | 8.68         |
| 3  | 102000600 | 20 苏沙钢 MTN004 | 900,000   | 88,821,000.00  | 8.45         |
| 4  | 1980341   | 19 成产业债 01    | 800,000   | 81,368,000.00  | 7.74         |
| 5  | 163187    | 20 国金 02      | 800,000   | 79,736,000.00  | 7.59         |

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

#### 7.8 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。

#### 7.9 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。

#### 7.10 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。

#### 7.11 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。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“华泰证券、国开行”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。

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。

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。

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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 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   | 25,567.03     |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 17,335,772.08 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 17,361,339.11 |

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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 |
| 2        | 505,000,000.00 | 1,010,000,000.00 | 100.00% | -     | -      |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 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 | 0.00      | 0.00%    |

### 8.3 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                                 | 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<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

### 8.4 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 开放式基金份额变动

单位：份

|                                |                  |
|--------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2019 年 5 月 30 日）基金份额总额 | 1,010,000,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 1,010,000,000.00 |
| 本报告期基金总申购份额                    | -                |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | -                |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 1,010,000,000.00 |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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：

2020 年 2 月 15 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二十八次会议审议通过，李永梅女士不再担任本基金管理人副总经理。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

### 10.5 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。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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 | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 川财证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：基金租用席位的选择标准是：

- （1）资质雄厚，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。

#### 10.7.2 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           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 川财证券 | 505,471,681.10 | 100.00%      | 20,903,400,000.00 | 100.00%      | -    | -            |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                           | 法定披露方式                        | 法定披露日期     |
|----|------------------------------------------------|-------------------------------|------------|
| 1  | 国泰基金旗下基金在 2020 年春节假期期间交易确认、清算交收、开放时间等相关安排调整的公告 | 《中国证券报》                       | 2020-01-29 |
| 2  | 国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告                           | 《中国证券报》                       | 2020-02-15 |
| 3  | 国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告         | 《证券时报》                        | 2020-03-12 |
| 4  | 关于国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的提示性公告    | 《证券时报》                        | 2020-03-13 |
| 5  | 国泰基金管理有限公司关于旗下证券投资基金招募说明书的补充提示                 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》 | 2020-03-17 |
| 6  | 国泰基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法份子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告        | 《公司官网》                        | 2020-04-04 |
| 7  | 国泰基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告        | 《公司官网》                        | 2020-05-20 |
| 8  | 国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告         | 《证券时报》                        | 2020-06-20 |
| 9  | 关于国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的提示性公告    | 《证券时报》                        | 2020-06-22 |

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日 | 1,000,000.00 | —    | —    | 1,000,000.00 | 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。 |                |                                    |              |      |      |              |        |

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同
- 2、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰瑞安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

### 12.2 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。

### 12.3 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

二〇二〇年八月三十一日