

**国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金**  
**2022 年中期报告**  
**2022 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

## 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2022 年 8 月 26 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 2022 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                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>                  | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <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              | 15        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 15        |
| 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             | 16        |
| 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>18</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 18        |
| 6.2 利润表                                 | 19        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 20        |
| 6.4 报表附注                                | 22        |
| <b>7 投资组合报告</b>                         | <b>50</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 50        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 50        |
| 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       | 51        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 51        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 51        |
| 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      | 51        |
| 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   | 52        |
| 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   | 52        |
| 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      | 52        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 52        |
| 7.11 投资组合报告附注                           | 52        |
| <b>8 基金份额持有人信息</b>                      | <b>54</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 54        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                | 55        |

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| 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 ..... | 55 |
| <b>9 开放式基金份额变动</b> .....                | 55 |
| <b>10 重大事件揭示</b> .....                  | 56 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 56 |
| 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 .....  | 56 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 56 |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 56 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 56 |
| 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 .....     | 56 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 56 |
| <b>11 备查文件目录</b> .....                  | 57 |
| 11.1 备查文件目录 .....                       | 57 |
| 11.2 存放地点 .....                         | 57 |
| 11.3 查阅方式 .....                         | 58 |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                     |
|-----------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------|
| 基金名称            | 国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                     |
| 基金简称            | 国泰利优 30 天滚动持有短债债券                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                     |
| 基金主代码           | 012452                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                     |
| 交易代码            | 012452                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                     |
| 基金运作方式          | 契约型开放式 1、本基金对于每份基金份额，设定 30 天的滚动运作期，基金管理人仅在该基金份额的每个运作期到期日为基金份额持有人办理赎回。对于每份基金份额，第一个运作期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作期起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日后的第 30 天（即第一个运作期到期日。如该日为非工作日，则顺延至下一工作日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一日起（即第二个运作期起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日后的第 60 天（即第二个运作期到期日。如该日为非工作日，则顺延至下一工作日）止。以此类推。 2、每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未提出赎回申请，则自该运作期到期日次一日起该基金份额进入下一个运作期。 基金份额持有人在运作期到期日申请赎回的，基金管理人按照《招募说明书》的约定为基金份额持有人办理赎回事宜。 |                     |
| 基金合同生效日         | 2021 年 6 月 22 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                     |
| 基金管理人           | 国泰基金管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                     |
| 基金托管人           | 兴业银行股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                     |
| 报告期末基金份额总额      | 3,832,361,225.25 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                     |
| 基金合同存续期         | 不定期                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                     |
| 下属分级基金的基金简称     | 国泰利优 30 天滚动持有短债债券 A                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 国泰利优 30 天滚动持有短债债券 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 012452                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 012453              |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 8,656,517.67 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 3,823,704,707.58 份  |

### 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   | 1、久期策略；2、类属配置策略；3、利率债投资策略；4、信用债投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、国债期货投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富（1 年以下）指数收益率                                           |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。            |

## 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                       | 兴业银行股份有限公司               |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 刘国华                              | 李真                       |
|             | 联系电话 | 021-31081600转                    | 021-52629999-212051      |
|             | 电子邮箱 | xinxipilu@gtfund.com             | tgb_lizhen@cib.com.cn    |
| 客户服务电话      |      | (021) 31089000, 400-888-8688     | 95561                    |
| 传真          |      | 021-31081800                     | 021-62159217             |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区<br>浦东大道1200号2层225室 | 福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦 |
| 办公地址        |      | 上海市虹口区公平路18号8号<br>楼嘉昱大厦16层-19层   | 上海市银城路167号兴业大厦4楼         |
| 邮政编码        |      | 200082                           | 200120                   |
| 法定代表人       |      | 邱军                               | 吕家进                      |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                            |
|---------------------|--------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《上海证券报》                                    |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.gtfund.com                      |
| 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 层和本基金托管人住所 |

## 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 | 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（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|

|                      | 国泰利优 30 天滚动持有<br>短债债券 A      | 国泰利优 30 天滚动持有<br>短债债券 C |
|----------------------|------------------------------|-------------------------|
| 本期已实现收益              | 155,083.69                   | 31,424,846.49           |
| 本期利润                 | 208,232.27                   | 39,825,607.22           |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.0198                       | 0.0175                  |
| 本期加权平均净值利润率          | 1.92%                        | 1.69%                   |
| 本期基金份额净值增长率          | 1.91%                        | 1.79%                   |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>报告期末(2022 年 6 月 30 日)</b> |                         |
|                      | 国泰利优 30 天滚动持有短<br>债债券 A      | 国泰利优 30 天滚动持有短<br>债债券 C |
| 期末可供分配利润             | 303,146.46                   | 123,965,988.72          |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.0350                       | 0.0324                  |
| 期末基金资产净值             | 9,015,828.25                 | 3,972,467,711.96        |
| 期末基金份额净值             | 1.0415                       | 1.0389                  |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | <b>报告期末(2022 年 6 月 30 日)</b> |                         |
|                      | 国泰利优 30 天滚动持有<br>短债债券 A      | 国泰利优 30 天滚动持有<br>短债债券 C |
| 基金份额累计净值增长率          | 4.15%                        | 3.89%                   |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

国泰利优 30 天滚动持有短债债券 A

| 阶段             | 份额净值增<br>长率① | 份额净值增<br>长率标准差<br>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   |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去一个月          | 0.19%        | 0.01%               | 0.15%          | 0.01%                 | 0.04% | 0.00% |
| 过去三个月          | 1.01%        | 0.01%               | 0.73%          | 0.01%                 | 0.28% | 0.00% |
| 过去六个月          | 1.91%        | 0.01%               | 1.39%          | 0.01%                 | 0.52% | 0.00% |
| 过去一年           | 4.10%        | 0.02%               | 2.70%          | 0.01%                 | 1.40% | 0.01% |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 4.15%        | 0.01%               | 2.79%          | 0.01%                 | 1.36% | 0.00% |

国泰利优 30 天滚动持有短债债券 C

| 阶段 | 份额净值增<br>长率① | 份额净值增<br>长率标准差<br>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 |
|----|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|-----|-----|
|----|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|-----|-----|

|            |       |       |       |       |       |       |
|------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 过去一个月      | 0.17% | 0.01% | 0.15% | 0.01% | 0.02% | 0.00% |
| 过去三个月      | 0.96% | 0.01% | 0.73% | 0.01% | 0.23% | 0.00% |
| 过去六个月      | 1.79% | 0.01% | 1.39% | 0.01% | 0.40% | 0.00% |
| 过去一年       | 3.85% | 0.01% | 2.70% | 0.01% | 1.15% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.89% | 0.01% | 2.79% | 0.01% | 1.10% | 0.00% |

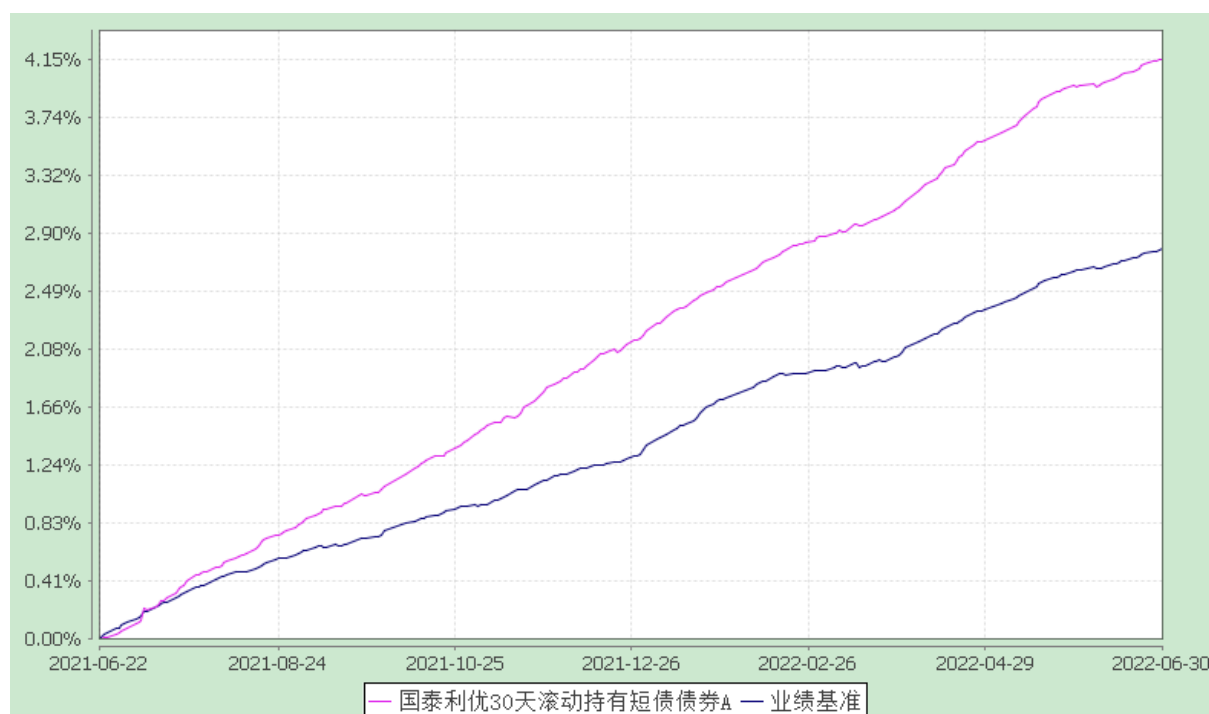
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金

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

(2021 年 6 月 22 日至 2022 年 6 月 30 日)

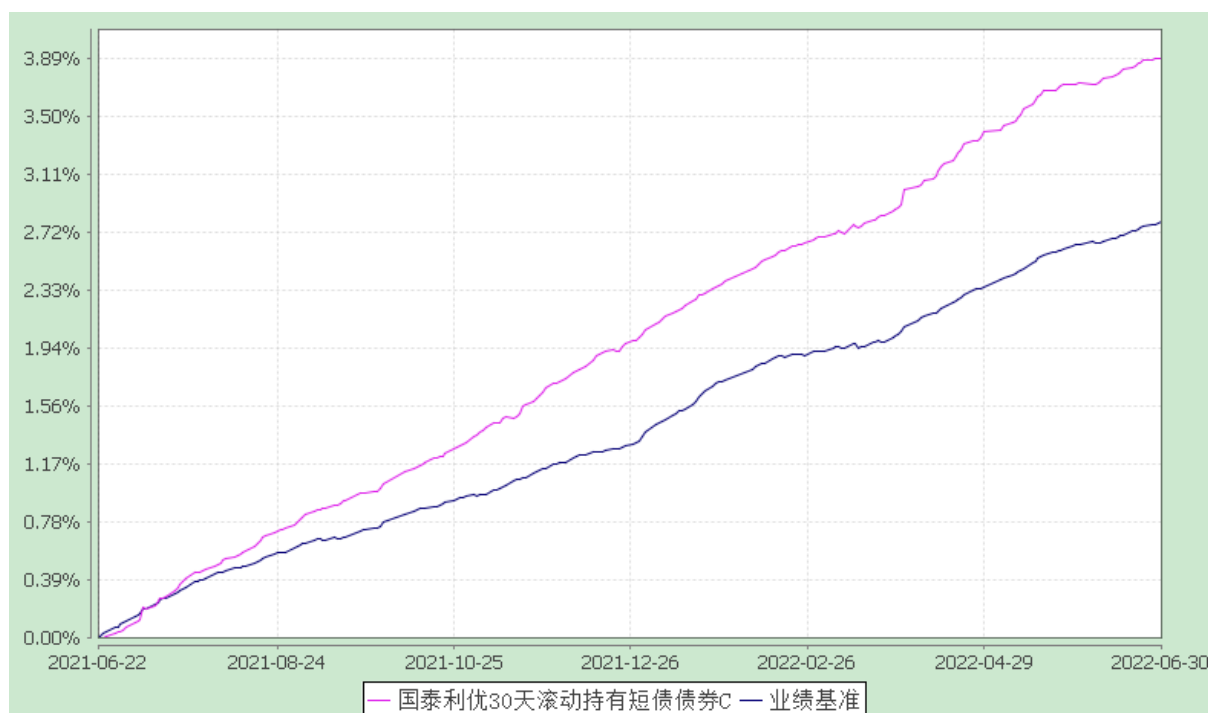
国泰利优 30 天滚动持有短债债券 A



注：本基金合同生效日为 2021 年 6 月 22 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规定。

国泰利优 30 天滚动持有短债债券 C





注：本基金合同生效日为 2021 年 6 月 22 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规定。

## 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 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 220 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证券投资基金（由国泰民安增利债券型发起式证券投资基金变更注册而来）、国证房地产行业指数证券投资基金（由国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、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证券投资基金（由国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、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证券投资基金（由国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰国证有色金属行业指数证券投资基金（由国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、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（LOF）（由国泰价值优选灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、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、国泰民泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、国泰致远优势混合型证券投资基金、国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰浩益混合型证券投资基金（原国泰浩益 18 个月封闭运作混合型证券投资基金）、国泰惠瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰医药健康股票型证券投资基金、国泰中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、国泰研究优势混合型证券投资基金、国泰民裕进取灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金（由国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型而来）、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰合益混合型证券投资基金、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金、国泰通利 9 个月持有期混合型证券投资基金、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰价值先锋股票型证券投资基金、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金、国泰成长价值混合型证券投资基金、国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证 800

汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金、国泰同益 18 个月持有期混合型证券投资基金、国泰诚益混合型证券投资基金、国泰鑫享稳健 6 个月滚动持有债券型证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰核心价值两年持有期股票型证券投资基金、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、国泰佳益混合型证券投资基金、国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证细分化工产业主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰瑞泰纯债债券型证券投资基金、国泰中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证有色金属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 500 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰利泽 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰价值领航股票型证券投资基金、国泰价值远见两年封闭运作混合型证券投资基金、国泰中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、国泰兴泽优选一年持有期混合型证券投资基金、国泰中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证光伏产业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 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰惠元混合型证券投资基金、国泰中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、国泰景气优选混合型证券投资基金、国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、国泰中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、国泰睿元一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金、国泰瑞鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰优选领航一年持有期混合型基金中基金（FOF）、国泰中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、国泰致和两年封闭运作混合型证券投资基金、国泰中证基建交易型开放式指数证券投资基金、国泰瑞丰纯债债券型证券投资基金、国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新材料主

题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰科创板两年定期开放混合型证券投资基金、国泰中证沪港深动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰睿毅三年持有期混合型证券投资基金、国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、国泰中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、国泰中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。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（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------|------|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                                                                                                             | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 陶然 | 国泰利是宝货币、国泰货币、国泰现金管理货币、国泰瞬利货币 ETF、国泰利享中短债债券、国泰利优 30 天滚动持有短债债券、国泰利泽 90 天滚动持有中短债债券、国泰中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期的基金经理 | 2021-06-22      | -    | 11 年   | 硕士研究生，CFA。曾任职于海富通基金管理有限公司、华安基金管理有限公司、汇添富基金管理股份有限公司。2020 年 3 月加入国泰基金，拟任基金经理。2020 年 7 月至 2022 年 8 月任国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2020 年 7 月起任国泰货币市场证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰利是宝货币市场基金、国泰瞬利交易型货币市场基金和国泰利享中短债债券型证券投资基金的基金经理，2021 年 6 月起兼任国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理，2021 年 8 月起兼任国泰利泽 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金的基金经理，2022 年 5 月起兼任国泰中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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。

## 4.2 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、组合同向交易记录配对。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都在 1%数量级及以下，且大多数溢价率均值都可以通过 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 $\geq 30$ ），溢价率均值普遍在 1%数量级及以下。为稳妥起见，对于溢价率均值过大的基金或组合配对，我们也进行了模拟溢价金额计算。

#### （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，基金经理也对价差作出了解释，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

2022 年上半年债市整体呈现窄幅震荡走势。一月，央行下调 7 天逆回购和 1 年期 MLF 利率 10BP，宽货币态度明显，降准降息预期升温，收益率快速下行；二月，信贷和社融数据超预期，叠加部分城市因城施策，推出房地产优惠政策，而月中的降准降息落空，收益率自低位反弹；三月两会召开后，全年增长目标明确，债市交易逻辑转向稳增长，中下旬上海、吉林等多地疫情散发，债市担忧稳增长面临挑战，收益率窄幅震荡。四月，上海疫情爆发，经济活动受到明显制约，央行通过降准和上缴利润加码宽松，货币市场资金利率大幅度下行，因市场期待的降息落空，且担忧月底政治局会议出台稳增长政策，债市小幅度调整；五月，上海复工复产进度低于预期，北京疫情加重，稳增长措施受多重因素约束未能见效，市场对经济预期较为悲观，债市收益率下行；六月，上海宣布复工复产，北京疫情解除，经济转入疫后修复，市场风险偏好抬升，债市收益率温和上行。上半年资金面合理充裕，资金价格整体处于较低水平，3M shibor 利率在低位窄幅波动。

本基金延续稳健的操作思路，灵活运用杠杆和久期策略，在严控组合信用风险的前提下为持有人获取稳定回报，实现组合净值稳步增长。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类本报告期内的净值增长率为 1.91%，同期业绩比较基准收益率为 1.39%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为 1.79%，同期业绩比较基准收益率为 1.39%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，全国疫情控制良好，防疫政策根据形势逐步放松，稳增长政策持续发力，疫后复苏态势延续，但疫情长尾效应仍会制约修复斜率，稳增长、稳就业的压力依然较大，预计货币政策将为经济稳增长保驾护航，流动性将继续维持在合理充裕水平。

我们将在密切跟踪基本面、政策面和资金面的前提下，做好各类别资产配置以及比例的动态调整。同时，严防信用风险，规避高风险主体。组合将延续积极的投资策略，为持有人在管理好流动性的前提下获取持续稳定的投资回报。

#### 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

无。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## 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：国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号        | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                                |                                  |
| 银行存款          | 6.4.7.1    | 147,144,566.78                 | 1,919,934.46                     |
| 结算备付金         |            | 263,466.30                     | 23,045.69                        |
| 存出保证金         |            | 3,978.52                       | 2,353.40                         |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 4,247,657,525.88               | 271,876,350.00                   |
| 其中：股票投资       |            | -                              | -                                |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | 4,152,024,423.41               | 271,876,350.00                   |
| 资产支持证券投资      |            | 95,633,102.47                  | -                                |
| 贵金属投资         |            | -                              | -                                |
| 其他投资          |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | -                              | -                                |
| 应收清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 95,951,963.64                  | 27,775,938.03                    |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                              | 1,786,027.88                     |
| 资产总计          |            | 4,491,021,501.12               | 303,383,649.46                   |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2021 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     |            | 417,919,637.94                 | 31,944,752.08                    |
| 应付清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款         |            | 89,707,166.84                  | 1,380,115.34                     |
| 应付管理人报酬       |            | 617,331.35                     | 38,564.20                        |
| 应付托管费         |            | 154,332.83                     | 9,641.02                         |
| 应付销售服务费       |            | 615,835.01                     | 36,936.96                        |
| 应付投资顾问费       |            | -                              | -                                |
| 应交税费          |            | 296,321.93                     | 33,514.90                        |

|             |         |                  |                |
|-------------|---------|------------------|----------------|
| 应付利润        |         | -                | -              |
| 递延所得税负债     |         | -                | -              |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 227,335.01       | 155,177.89     |
| 负债合计        |         | 509,537,960.91   | 33,598,702.39  |
| <b>净资产：</b> |         |                  |                |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 3,832,361,225.25 | 264,325,224.72 |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | 149,122,314.96   | 5,459,722.35   |
| 净资产合计       |         | 3,981,483,540.21 | 269,784,947.07 |
| 负债和净资产总计    |         | 4,491,021,501.12 | 303,383,649.46 |

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 3,832,361,225.25 份，其中国泰利优 30 天滚动持有短债债券 A 的份额净值 1.0415 元，A 类基金的份额总额 8,656,517.67 份；国泰利优 30 天滚动持有短债债券 C 的份额净值 1.0389 元，C 类基金的份额总额 3,823,704,707.58 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 6 月 22 日（基<br>金合同生效日）至 2021<br>年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>        |          | 49,587,682.12                            | 143,225.07                                                  |
| 1.利息收入                |          | 1,406,581.38                             | 145,925.07                                                  |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.9  | 1,367,882.09                             | 5,114.81                                                    |
| 债券利息收入                |          | -                                        | 5,392.61                                                    |
| 资产支持证券利息收入            |          | -                                        | -                                                           |
| 买入返售金融资产收入            |          | 38,699.29                                | 135,417.65                                                  |
| 证券出借利息收入              |          | -                                        | -                                                           |
| 其他利息收入                |          | -                                        | -                                                           |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 39,727,191.43                            | -                                                           |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.10 | -                                        | -                                                           |
| 基金投资收益                |          | -                                        | -                                                           |
| 债券投资收益                | 6.4.7.11 | 39,239,810.09                            | -                                                           |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.12 | 487,381.34                               | -                                                           |
| 贵金属投资收益               |          | -                                        | -                                                           |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.13 | -                                        | -                                                           |
| 股利收益                  | 6.4.7.14 | -                                        | -                                                           |
| 其他投资收益                |          | -                                        | -                                                           |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.15 | 8,453,909.31                             | -2,700.00                                                   |

|                            |          |                      |                   |
|----------------------------|----------|----------------------|-------------------|
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |          | -                    | -                 |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.16 | -                    | -                 |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |          | 9,553,842.63         | 30,375.23         |
| 1. 管理人报酬                   |          | 2,291,857.50         | 11,043.00         |
| 2. 托管费                     |          | 572,964.42           | 2,760.75          |
| 3. 销售服务费                   |          | 2,280,980.31         | 10,495.70         |
| 4. 投资顾问费                   |          | -                    | -                 |
| 5. 利息支出                    |          | 4,142,918.77         | -                 |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 4,142,918.77         | -                 |
| 6. 信用减值损失                  |          | -                    | -                 |
| 7. 税金及附加                   |          | 122,354.30           | -                 |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.16 | 142,767.33           | 6,075.78          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>40,033,839.49</b> | <b>112,849.84</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                    | -                 |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>40,033,839.49</b> | <b>112,849.84</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | -                    | -                 |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | <b>40,033,839.49</b> | <b>112,849.84</b> |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |                |                  |
|------------------------|---------------------------------------|----------------|------------------|
|                        | 实收基金                                  | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产（基金净值）        | 264,325,224.72                        | 5,459,722.35   | 269,784,947.07   |
| 二、本期期初净资产（基金净值）        | 264,325,224.72                        | 5,459,722.35   | 269,784,947.07   |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）   | 3,568,036,000.53                      | 143,662,592.61 | 3,711,698,593.14 |
| （一）、综合收益总额             | -                                     | 40,033,839.49  | 40,033,839.49    |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | 3,568,036,000.53                      | 103,628,753.12 | 3,671,664,753.65 |

|                                          |                                                      |                 |                   |
|------------------------------------------|------------------------------------------------------|-----------------|-------------------|
| （净值减少以“-”号填列）                            |                                                      |                 |                   |
| 其中：1.基金申购款                               | 7,474,810,957.35                                     | 230,393,067.69  | 7,705,204,025.04  |
| 2.基金赎回款                                  | -3,906,774,956.82                                    | -126,764,314.57 | -4,033,539,271.39 |
| （三）、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） | -                                                    | -               | -                 |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 3,832,361,225.25                                     | 149,122,314.96  | 3,981,483,540.21  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2021 年 6 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日 |                 |                   |
|                                          | 实收基金                                                 | 未分配利润           | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产（基金净值）                          | 251,877,917.58                                       | 1,775.24        | 251,879,692.82    |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 251,877,917.58                                       | 1,775.24        | 251,879,692.82    |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -                                                    | 112,849.84      | 112,849.84        |
| （一）、综合收益总额                               | -                                                    | 112,849.84      | 112,849.84        |
| （二）、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                                  | -                                                    | -               | -                 |
| （三）、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） | -                                                    | -               | -                 |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 251,877,917.58                                       | 114,625.08      | 251,992,542.66    |

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

国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金(以下简称“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[2021]1624 号文《关于准予国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，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《国泰利优 30 天滚动持有短债债券型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，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 251,846,622.63 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(2021)第 0593 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》于 2021 年 6 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 251,877,917.58 份基金份额，其中认购资金利息折合 31,294.95 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金对于每份基金份额设定 30 天的滚动运作期。每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请。每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期到期日未提出赎回申请，则自该运作期到期日次一日起该基金份额进入下一个运作期。

根据《国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金份额时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，不收取认购/申购费用的基金份额称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码，分别计算基金份额净值并单独公告。本基金不同类别基金份额之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括债券(含国债、央行票据、

金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债、政府支持机构债券、中期票据、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货以及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,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%,其中投资于短期债券的比例不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金业绩比较基准为:中债综合财富(1 年以下)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 2022 年 8 月 26 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》、《国泰利优 30 天滚动持有短债债券型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 2022 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告不一致,会计估计与最近一期年度报告一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。



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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

## (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

## 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)

该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 新金融工具准则

债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

##### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行

企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### **6.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确

定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 9,043,487.77 元、7,704,345.90 元、167,975.93 元、40,000,000.00 元、11,778,443.55 元、66,420,509.58 元和 70,012,689.45 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 9,044,846.99 元、7,708,159.60 元、168,059.09 元、39,984,912.49 元、0.00 元、66,420,509.58 元和 70,012,690.90 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,222,980,569.46 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,234,768,842.99 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 177,999,853.00 元、73,197,332.31 元、462,440.52 元、554,767.16 元、158,504.92 元、70,853.19 元、450,631.95 元、-54,484.39 元和 129.97 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 177,945,368.61 元、73,197,332.31 元、462,440.52 元、554,767.16 元、158,504.92 元、70,853.19 元、450,631.95 元、0.00 元和 129.97 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利



息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 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[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，以产生的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。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(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>2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 25,843,467.78          |
| 等于：本金          | 25,836,647.61          |
| 加：应计利息         | 6,820.17               |
| 定期存款           | 121,301,099.00         |
| 等于：本金          | 120,000,000.00         |
| 加：应计利息         | 1,301,099.00           |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | 121,301,099.00         |
| 其他存款           | -                      |
| 等于：本金          | -                      |
| 加：应计利息         | -                      |
| 合计             | 147,144,566.78         |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |      |      |        |
|----------|------------------------|------|------|--------|
|          | 成本                     | 应计利息 | 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 |                  | 245,358.91    |                  |              |
|        | 市场  | 50,007,216.43    |               | 50,630,358.91    | 377,783.57   |
|        | 银行间 |                  | 36,104,264.50 |                  |              |
|        | 市场  | 4,056,774,261.71 |               | 4,101,394,064.50 | 8,515,538.29 |
|        | 合计  | 4,106,781,478.14 | 36,349,623.41 | 4,152,024,423.41 | 8,893,321.86 |
| 资产支持证券 |     | 95,000,000.00    | 501,102.47    | 95,633,102.47    | 132,000.00   |
| 基金     |     | -                | -             | -                | -            |
| 其他     |     | -                | -             | -                | -            |
| 合计     |     | 4,201,781,478.14 | 36,850,725.88 | 4,247,657,525.88 | 9,025,321.86 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022 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   | -                      |
| 应付交易费用      | 68,074.86              |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | 68,074.86              |
| 应付利息        | -                      |

|      |            |
|------|------------|
| 预提费用 | 159,260.15 |
| 合计   | 227,335.01 |

### 6.4.7.7 实收基金

国泰利优 30 天滚动持有短债债券 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                   |                |
|---------------|----------------------|----------------|
|               | 2022年1月1日至2022年6月30日 |                |
|               | 基金份额                 | 账面金额           |
| 上年度末          | 12,234,988.46        | 12,234,988.46  |
| 本期申购          | 11,456,981.45        | 11,456,981.45  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -15,035,452.24       | -15,035,452.24 |
| 本期末           | 8,656,517.67         | 8,656,517.67   |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

国泰利优 30 天滚动持有短债债券 C

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                   |                   |
|---------------|----------------------|-------------------|
|               | 2022年1月1日至2022年6月30日 |                   |
|               | 基金份额                 | 账面金额              |
| 上年度末          | 252,090,236.26       | 252,090,236.26    |
| 本期申购          | 7,463,353,975.90     | 7,463,353,975.90  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -3,891,739,504.58    | -3,891,739,504.58 |
| 本期末           | 3,823,704,707.58     | 3,823,704,707.58  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

### 6.4.7.8 未分配利润

国泰利优 30 天滚动持有短债债券 A

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           | 246,638.21 | 22,655.57  | 269,293.78  |
| 本期利润           | 155,083.69 | 53,148.58  | 208,232.27  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -98,575.44 | -19,640.03 | -118,215.47 |
| 其中：基金申购款       | 305,579.67 | 48,629.62  | 354,209.29  |

|         |             |            |             |
|---------|-------------|------------|-------------|
| 基金赎回款   | -404,155.11 | -68,269.65 | -472,424.76 |
| 本期已分配利润 | -           | -          | -           |
| 本期末     | 303,146.46  | 56,164.12  | 359,310.58  |

国泰利优 30 天滚动持有短债债券 C

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           | 4,721,095.00    | 469,333.57     | 5,190,428.57    |
| 本期利润           | 31,424,846.49   | 8,400,760.73   | 39,825,607.22   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 87,820,047.23   | 15,926,921.36  | 103,746,968.59  |
| 其中：基金申购款       | 194,230,618.73  | 35,808,239.67  | 230,038,858.40  |
| 基金赎回款          | -106,410,571.50 | -19,881,318.31 | -126,291,889.81 |
| 本期已分配利润        | -               | -              | -               |
| 本期末            | 123,965,988.72  | 24,797,015.66  | 148,763,004.38  |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 66,402.41                             |
| 定期存款利息收入  | 1,301,099.00                          |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 361.11                                |
| 其他        | 19.57                                 |
| 合计        | 1,367,882.09                          |

#### 6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 39,021,712.94              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 218,097.15                 |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                          |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                          |

|    |               |
|----|---------------|
| 合计 | 39,239,810.09 |
|----|---------------|

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 4,322,434,805.10           |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 4,284,048,110.44           |
| 减：应计利息总额               | 38,102,868.72              |
| 减：交易费用                 | 65,728.79                  |
| 买卖债券差价收入               | 218,097.15                 |

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                       | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|--------------------------|----------------------------|
| 资产支持证券投资收益——利息收入         | 487,381.34                 |
| 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入 | -                          |
| 资产支持证券投资收益——赎回差价收入       | -                          |
| 资产支持证券投资收益——申购差价收入       | -                          |
| 合计                       | 487,381.34                 |

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称      | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | 8,453,909.31               |

|                            |              |
|----------------------------|--------------|
| ——股票投资                     | -            |
| ——债券投资                     | 8,321,909.31 |
| ——资产支持证券投资                 | 132,000.00   |
| ——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<br>预估增值税 | -            |
| 合计                         | 8,453,909.31 |

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 审计费用     | 29,752.78                  |
| 信息披露费    | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金  | -                          |
| 银行汇划费用   | 35,327.18                  |
| 上清所查询服务费 | 600.00                     |
| 银行间账户维护费 | 17,580.00                  |
| 合计       | 142,767.33                 |

#### 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 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 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           |
| 兴业银行股份有限公司（“兴业银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

##### 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<br>2022年1月1日至2022年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2021年6月22日（基金合同<br>生效日）至2021年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,291,857.50                   | 11,043.00                                     |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 931,253.12                     | 5,519.73                                      |

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 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 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>2022年1月1日至2022年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2021年6月22日（基金合同<br>生效日）至2021年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 572,964.42                     | 2,760.75                                      |

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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 × 0.05% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |               |    |
|----------------|----------------------------|---------------|----|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费           |               |    |
|                | 国泰利优 30 天滚动                | 国泰利优 30 天滚动持有 | 合计 |



|                | 持有短债债券 A                                  | 短债债券 C           |            |
|----------------|-------------------------------------------|------------------|------------|
| 兴业银行           | -                                         | 139,584.59       | 139,584.59 |
| 国泰基金管理有限公司     | -                                         | 160.06           | 160.06     |
| 合计             | -                                         | 139,744.65       | 139,744.65 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2021年6月22日（基金合同生效日）至2021年6月30日 |                  |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                          |                  |            |
|                | 国泰利优30天滚动持有短债债券A                          | 国泰利优30天滚动持有短债债券C | 合计         |
|                |                                           |                  |            |
| 兴业银行           | -                                         | 10,491.72        | 10,491.72  |
| 国泰基金管理有限公司     | -                                         | 2.86             | 2.86       |
| 合计             | -                                         | 10,494.58        | 10,494.58  |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国泰基金管理有限公司，再由国泰基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。C类基金份额约定的销售服务费年费率为0.20%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

#### 6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期及上年度可比期间内均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.3.2 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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.4 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>2022年1月1日至2022年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2021年6月22日（基金合同生效日）至2021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   |
| 兴业银行  | 25,843,467.78              | 66,402.41 | 1,243,200.80                              | 5,114.81 |

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.6 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2022 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因暂时停牌等流通受限的股票。

##### 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 2022 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 417,919,637.94 元，是以如下债券作为质押：

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         |
|-----------|------------------|------------|------------|--------------|----------------|
| 112206153 | 22 交通银行<br>CD153 | 2022-07-05 | 97.86      | 1,086,000.00 | 106,275,960.00 |
| 220201    | 22 国开 01         | 2022-07-01 | 101.06     | 2,853,000.00 | 288,324,180.00 |
| 220401    | 22 农发 01         | 2022-07-01 | 100.52     | 500,000.00   | 50,260,000.00  |
| 合计        |                  |            |            | 4,439,000.00 | 444,860,140.00 |

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 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，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人兴业银行，定期存款存放在大连银行、哈尔滨银行，因而与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>2022年6月30日 | 上年末<br>2021年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1    | 70,877,399.45     | 5,020,000.00       |
| A-1 以下 | -                 | -                  |
| 未评级    | 2,683,418,314.09  | 210,935,950.00     |
| 合计     | 2,754,295,713.54  | 215,955,950.00     |

注：本基金持有的未评级债券包括短期融资券、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<br>2022年6月30日 | 上年末<br>2021年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA    | 540,417,216.55    | 24,099,800.00      |
| AAA 以下 | 113,391,870.69    | -                  |
| 未评级    | 391,257,802.16    | 17,005,100.00      |
| 合计     | 1,045,066,889.40  | 41,104,900.00      |

注：本基金持有的未评级债券包括国债、政策性金融债。

#### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2022年6月30日 | 上年末<br>2021年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA    | 95,633,102.47     | -                  |
| AAA 以下 | -                 | -                  |
| 未评级    | -                 | -                  |
| 合计     | 95,633,102.47     | -                  |

#### 6.4.13.2.4 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>2022年6月30日 | 上年末<br>2021年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA    | 352,661,820.47    | 14,815,500.00      |
| AAA 以下 | -                 | -                  |
| 未评级    | -                 | -                  |
| 合计     | 352,661,820.47    | 14,815,500.00      |

#### 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 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 417,919,637.94 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约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(净资产)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%。

于开放期内，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>2022 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                   | 147,144,566.78   | -             | -     | -             | 147,144,566.78   |
| 结算备付金                  | 263,466.30       | -             | -     | -             | 263,466.30       |
| 存出保证金                  | 3,978.52         | -             | -     | -             | 3,978.52         |
| 交易性金融资产                | 4,180,322,544.28 | 67,334,981.60 | -     | -             | 4,247,657,525.88 |
| 应收申购款                  | 5.47             | -             | -     | 95,951,958.17 | 95,951,963.64    |
| 资产总计                   | 4,327,734,561.35 | 67,334,981.60 | -     | 95,951,958.17 | 4,491,021,501.12 |
| 负债                     |                  |               |       |               |                  |
| 卖出回购金融资产款              | 417,919,637.94   | -             | -     | -             | 417,919,637.94   |
| 应付赎回款                  | -                | -             | -     | 89,707,166.84 | 89,707,166.84    |
| 应付管理人报酬                | -                | -             | -     | 617,331.35    | 617,331.35       |

|                                        |                  |               |              |               |                  |
|----------------------------------------|------------------|---------------|--------------|---------------|------------------|
| 应付托管费                                  | -                | -             | -            | 154,332.83    | 154,332.83       |
| 应付销售服务费                                | -                | -             | -            | 615,835.01    | 615,835.01       |
| 应交税费                                   | -                | -             | -            | 296,321.93    | 296,321.93       |
| 其他负债                                   | -                | -             | -            | 227,335.01    | 227,335.01       |
| 负债总计                                   | 417,919,637.94   | -             | -            | 91,618,322.97 | 509,537,960.91   |
| 利率敏感度缺口                                | 3,909,814,923.41 | 67,334,981.60 | -            | 4,333,635.20  | 3,981,483,540.21 |
| <b>上年度末</b><br><b>2021 年 12 月 31 日</b> | <b>1 年以内</b>     | <b>1-5 年</b>  | <b>5 年以上</b> | <b>不计息</b>    | <b>合计</b>        |
| 资产                                     |                  |               |              |               |                  |
| 银行存款                                   | 1,919,934.46     | -             | -            | -             | 1,919,934.46     |
| 结算备付金                                  | 23,045.69        | -             | -            | -             | 23,045.69        |
| 存出保证金                                  | 2,353.40         | -             | -            | -             | 2,353.40         |
| 交易性金融资产                                | 255,857,350.00   | 16,019,000.00 | -            | -             | 271,876,350.00   |
| 应收申购款                                  | -                | -             | -            | 27,775,938.03 | 27,775,938.03    |
| 其他资产                                   | -                | -             | -            | 1,786,027.88  | 1,786,027.88     |
| 资产总计                                   | 257,802,683.55   | 16,019,000.00 | -            | 29,561,965.91 | 303,383,649.46   |
| 负债                                     |                  |               |              |               |                  |
| 卖出回购金融资产款                              | 31,944,752.08    | -             | -            | -             | 31,944,752.08    |
| 应付赎回款                                  | -                | -             | -            | 1,380,115.34  | 1,380,115.34     |
| 应付管理人报酬                                | -                | -             | -            | 38,564.20     | 38,564.20        |
| 应付托管费                                  | -                | -             | -            | 9,641.02      | 9,641.02         |
| 应付销售服务费                                | -                | -             | -            | 36,936.96     | 36,936.96        |
| 应交税费                                   | -                | -             | -            | 33,514.90     | 33,514.90        |
| 其他负债                                   | -                | -             | -            | 155,177.89    | 155,177.89       |
| 负债总计                                   | 31,944,752.08    | -             | -            | 1,653,950.31  | 33,598,702.39    |
| 利率敏感度缺口                                | 225,857,931.47   | 16,019,000.00 | -            | 27,908,015.60 | 269,784,947.07   |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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>2022 年 6 月 30 日           | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|    | 市场利率上升 25 个基点 | 减少约 501                          | 减少约 32                   |
|    | 市场利率下降 25 个基点 | 增加约 502                          | 增加约 32                   |

#### 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币汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。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

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |                      | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 |                      |
|--------------|------------------------|----------------------|--------------------------|----------------------|
|              | 公允价值                   | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资产<br>净值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | -                      | -                    | -                        | -                    |
| 交易性金融资产—基金投资 | -                      | -                    | -                        | -                    |



|               |               |      |   |   |
|---------------|---------------|------|---|---|
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -             | -    | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资   | -             | -    | - | - |
| 其他            | -             | -    | - | - |
| 合计            | 95,633,102.47 | 2.40 | - | - |

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资（2021 年 12 月 31 日：无），因此无其他价格风险敞口（2021 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金净资产无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------|
| 第一层次          | -                      |
| 第二层次          | 4,247,657,525.88       |
| 第三层次          | -                      |
| 合计            | 4,247,657,525.88       |

##### 6.4.14.2.2 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。

本基金本期及上年度可比期间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。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 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(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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            | 4,247,657,525.88 | 94.58         |
|    | 其中：债券             | 4,152,024,423.41 | 92.45         |
|    | 资产支持证券            | 95,633,102.47    | 2.13          |
| 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      | 147,408,033.08   | 3.28          |
| 8  | 其他各项资产            | 95,955,942.16    | 2.14          |
| 9  | 合计                | 4,491,021,501.12 | 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      | 39,846,189.01    | 1.00         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 351,411,613.15   | 8.83         |
|    | 其中：政策性金融债 | 351,411,613.15   | 8.83         |
| 4  | 企业债券      | 50,630,358.91    | 1.27         |
| 5  | 企业短期融资券   | 2,754,295,713.54 | 69.18        |
| 6  | 中期票据      | 603,178,728.33   | 15.15        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | 352,661,820.47   | 8.86         |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 4,152,024,423.41 | 104.28       |

### 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  | 220201    | 22 国开 01       | 2,980,000 | 301,151,941.92 | 7.56         |
| 2  | 102000331 | 20 海淀国资 MTN002 | 1,500,000 | 152,031,410.96 | 3.82         |
| 3  | 112206153 | 22 交通银行 CD153  | 1,500,000 | 146,783,369.59 | 3.69         |
| 4  | 112203042 | 22 农业银行 CD042  | 1,100,000 | 107,882,303.21 | 2.71         |
| 5  | 042100472 | 21 电网 CP017    | 1,000,000 | 102,072,526.03 | 2.56         |

#### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称    | 数量(份)      | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|------------|---------------|--------------|
| 1  | 180280 | 22 华发 A | 500,000.00 | 50,004,164.39 | 1.26         |
| 2  | 183547 | 华发 18A  | 250,000.00 | 25,326,712.33 | 0.64         |
| 3  | 183472 | 华发 17A  | 200,000.00 | 20,302,225.75 | 0.51         |

#### 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。

#### 7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“交通银行、农业银行、国开行、物产中大”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。

交通银行股份有限公司及下属分支机构因理财业务投资运作管理不规范；个人消费贷款业务贷后风险控制措施严重不到位；个人消费贷款挪用于购房、投资等禁止性领域；向资本金不足且未取得施工许可证项目发放贷款；同业投资资金违规投向股权投资领域；转嫁应由银行与企业共同承担的抵押物

保险费；监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在偏差、漏报；理财业务和同业业务制度不健全；理财业务数据与事实不符；部分理财业务发展与监管导向不符；理财业务风险隔离不到位，利用本行表内自有资金为本行表外理财产品提供融资；理财资金违规投向土地储备项目；违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；对公账户开立尽职调查环节制度执行不严，相关管理工作存在缺陷；信贷资金被挪用；转让不良资产严重违反审慎经营规则；发放小微企业贷款附加不合理条件；贷后检查不到位、贷款分类不准确等原因，多次受到监管机构公开处罚。

中国农业银行股份有限公司及下属分支机构因违规设立时点性存款规模考评指标；二、违规发放借名贷款。未经资格核准实际履行高管职责；遗失金融许可证；未将其到期票据按照规定给予兑现，造成事实上的压票行为；个人贷款管理不审慎，信贷资金未按约定用途使用；员工行为管理不尽职、内控制度落实不到位；违规降低准入条件发放贷款致使贷款形成风险；违规发放短期贷款虚增存贷款规模，严重违反审慎经营规则；未落实授信批复条件发放贷款对外支付残缺人民币；隐瞒与保险合同有关的重要情况；与身份不明的客户进行交易；以服务顾问费形式收取贷款利息；违规为地方政府购买服务提供融资；重要空白凭证管理不到位；对公账户开立管理不到位；提供虚假的金融统计数据；违规代客操作；贷款“三查”不尽职，贷款资金被挪用；贷前调查不尽职；代理销售保险业务管理不规范等原因，多次受到监管机构公开处罚。

国家开发银行及下属分支机构因漏报、错报 EAST 数据；未按规定报送案件信息；为违规的政府购买服务项目提供融资；项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况；违规变相发放土地储备贷款；设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款；贷款风险分类不准确；向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产；违规进行信贷资产拆分转让，隐匿信贷资产质量；向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品；扶贫贷款存贷挂钩；易地扶贫搬迁贷款“三查”不尽职，部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁；未落实同业业务交易对手名单制监管要求；以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资，未纳入同业借款业务管理；以协定存款方式吸收同业存款，未纳入同业存款业务管理；风险隔离不到位，违规开展资金池理财业务；未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况；逾期未整改，屡查屡犯，违规新增业务；利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表；违规收取小微企业贷款承诺费；收取财务顾问费质价不符；利用银团贷款承诺费浮利分费；向检查组提供虚假整改说明材料；未如实提供信贷资产转让台账；案件信息迟报、瞒报；对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位等原因，多次受到监管机构公开处罚。

物产中大集团股份有限公司因未及时准确披露重大经营情况信息，还只是业绩数据通过非法定渠道对外泄露，相关信息发布不公平，受到上交所监管关注。

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。

7.11.2 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。

### 7.11.3 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 | 3,978.52      |
| 2  | 应收清算款 | -             |
| 3  | 应收股利  | -             |
| 4  | 应收利息  | -             |
| 5  | 应收申购款 | 95,951,963.64 |
| 6  | 其他应收款 | -             |
| 7  | 待摊费用  | -             |
| 8  | 其他    | -             |
| 9  | 合计    | 95,955,942.16 |

### 7.11.4 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。

### 7.11.5 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

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 |     |       |     |
|------|----------|-----------|-------|-----|-------|-----|
|      |          |           | 机构投资者 |     | 个人投资者 |     |
|      |          |           | 持有份额  | 占总份 | 持有份额  | 占总份 |

|                     |         |           |   | 额比例 |                  | 额比例      |
|---------------------|---------|-----------|---|-----|------------------|----------|
| 国泰利优 30 天滚动持有短债债券 A | 245     | 35,332.73 | - | -   | 8,656,517.67     | 100.00 % |
| 国泰利优 30 天滚动持有短债债券 C | 170,943 | 22,368.30 | - | -   | 3,823,704,707.58 | 100.00 % |
| 合计                  | 171,188 | 22,386.86 | - | -   | 3,832,361,225.25 | 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               | 份额级别                | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|---------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 国泰利优 30 天滚动持有短债债券 A | 3,485.46  | 0.04%    |
|                  | 国泰利优 30 天滚动持有短债债券 C | 93,366.99 | 0.00%    |
|                  | 合计                  | 96,852.45 | 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                             | 份额级别                | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|---------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 国泰利优 30 天滚动持有短债债券 A | 0                 |
|                                | 国泰利优 30 天滚动持有短债债券 C | 0                 |
|                                | 合计                  | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 国泰利优 30 天滚动持有短债债券 A | 0                 |
|                                | 国泰利优 30 天滚动持有短债债券 C | 0~10              |
|                                | 合计                  | 0~10              |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 国泰利优 30 天滚动持有短债债券 A | 国泰利优 30 天滚动持有短债债券 C |
|--------------------------------|---------------------|---------------------|
| 基金合同生效日（2021 年 6 月 22 日）基金份额总额 | 12,483,052.61       | 239,394,864.97      |

|               |               |                  |
|---------------|---------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 12,234,988.46 | 252,090,236.26   |
| 本报告期基金总申购份额   | 11,456,981.45 | 7,463,353,975.90 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 15,035,452.24 | 3,891,739,504.58 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -             | -                |
| 本报告期期末基金份额总额  | 8,656,517.67  | 3,823,704,707.58 |

## 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，本基金管理人未发生重大人事变动。

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

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 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

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 |    |
| 招商证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 中泰证券 | 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 |
| 招商证券 | -             | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中泰证券 | 50,007,216.43 | 100.00%      | -    | -            | -    | -            |

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金注册的批复
- 2、国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同
- 3、国泰利优 30 天滚动持有短债债券型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

### 11.2 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。

基金托管人住所。

### 11.3 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

二〇二二年八月三十日