

国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金
2023 年第 1 季度报告
2023 年 3 月 31 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年四月二十二日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国泰盛合三个月定期开放债券
基金主代码	007532
交易代码	007532
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 10 月 25 日
报告期末基金份额总额	2,492,008,499.61 份
投资目标	在注重风险和流动性管理的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	1、封闭期投资策略：（1）久期策略；（2）收益率曲线策略；（3）类属配置策略；（4）利率品种策略；（5）信用债策略；（6）资产支持证券投资策略；（7）国债期货投资策略。

	2、开放期投资策略：开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低预期风险和预期收益的产品。
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	11,621,126.75
2.本期利润	19,170,088.35
3.加权平均基金份额本期利润	0.0077
4.期末基金资产净值	2,629,738,077.61
5.期末基金份额净值	1.0553

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。

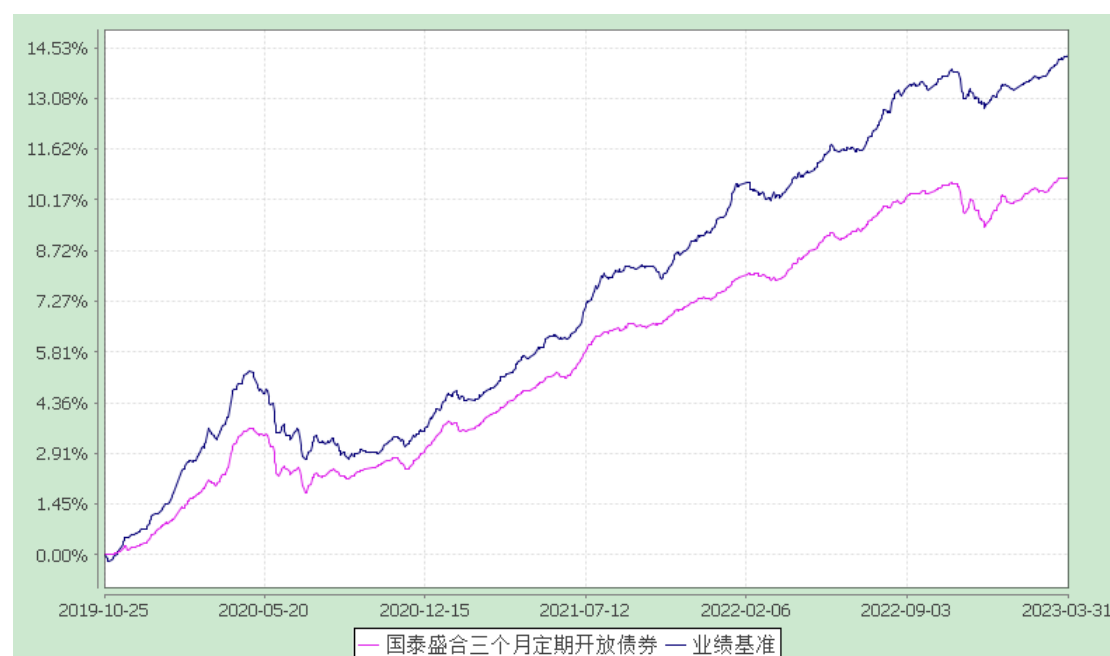
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.74%	0.04%	0.93%	0.03%	-0.19%	0.01%
过去六个月	0.46%	0.06%	0.89%	0.06%	-0.43%	0.00%
过去一年	2.57%	0.04%	3.49%	0.05%	-0.92%	-0.01%
过去三年	8.30%	0.04%	10.14%	0.06%	-1.84%	-0.02%
自基金合同生效起至今	10.84%	0.04%	14.33%	0.06%	-3.49%	-0.02%

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

国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019 年 10 月 25 日至 2023 年 3 月 31 日)



注：本基金合同生效日为2019年10月25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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄志翔	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、国泰瑞安三个月定期开放债券、国泰兴富三个月定期开放债券、国泰惠丰	2019-10-25	-	13 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，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

	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的基金经理				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）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 3 月至 2022 年 11 月任国泰惠富纯债债券型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 月至 2022 年 5 月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。
李铭一	国泰惠丰纯债债券、国泰丰盈纯债债券、国泰盛合三个月定期开放债券、国泰惠盈纯债债券、国泰民安增益纯债债券、国泰润泰纯债债券的基金经理	2023-04-11	-	6 年	硕士研究生。曾任职于兴业经济研究咨询股份有限公司、华泰证券股份有限公司。2020 年 4 月加入国泰基金，历任信用研究员。2023 年 4 月起任国泰惠丰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、国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠盈纯债债券型证券投资基金、国泰民安增益纯债债券型证券投资基金和国泰润泰纯债债券型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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年一季度利率债和信用债走势分化明显，10 年国债在 10BP 区间内震荡。2022 年底理财赎回冲击带来的流动性回归与估值已基本修复，信用利差沿着高等级到低等级、短期限到长期限逐步修复。组合在一季度内增持部分商金债，并维持中性久期和杠杆操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为 0.74%，同期业绩比较基准收益率为 0.93%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-

	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	3,371,347,247.21	97.55
	其中：债券	3,253,290,144.19	94.14
	资产支持证券	118,057,103.02	3.42
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	84,526,231.01	2.45
7	其他各项资产	30,206.22	0.00
8	合计	3,455,903,684.44	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,378,252,382.48	90.44
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	775,961,766.31	29.51
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	99,075,995.40	3.77
9	其他	-	-
10	合计	3,253,290,144.19	123.71

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	2122022	21 华夏租赁债 02	2,000,000	207,424,328.77	7.89
2	2026005	20 南洋银行 01	2,000,000	204,086,378.08	7.76
3	2228045	22 兴业银行 04	2,000,000	202,043,353.42	7.68
4	185512	22 东吴 03	2,000,000	200,889,972.60	7.64
5	2228050	22 光大银行	2,000,000	200,404,865.75	7.62

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

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	2389013	23 融腾 2B_bc	680,000.00	68,130,075.62	2.59
2	2289047	22 融腾 2B_bc	500,000.00	49,927,027.40	1.90

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1"本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“国泰君安、交通银行、华夏租赁、农业银行、光大银行、汇丰银行、兴业银行、华夏银行”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。

国泰君安证券股份有限公司及其下属分支机构因投资银行类业务内部控制不完善，质控、内核把关不严，部分债券项目立项申请被否再次申请立项时，未对前后差异作出充分比较说明，且存在内核意见回复前即对外报出的情况；廉洁从业风险防控机制不完善，聘请第三方廉洁从业风险防控不到位等原因，受到监管机构公开处罚。

交通银行股份有限公司及其下属分支机构因流动资金贷款发放不审慎；国内信用证贸易背景审查不严，严重违反审慎经营规则；未按规定报送监管数据；贷款风险分类不真实、涉企违规收费；转嫁抵押物评估费，增加企业综合融资成本；未严格监控贷款用途，流动资金贷款违规流入房地产领域；贷款支付管理与控制不到位；个人消费贷款、信用卡透支资金流入房地产领域或用于生产经营；向购买主体结构未封顶住房的个人发放个人住房贷款；贷款“三查”不到位、贷款资金流入股市，贷款“三查”不到位、贷款资金流入房市，未区分押品风险状况、强制要求购买财产保险并承担相应保费；未按规定报送案件（风险）信息；发生员工诈骗案件，员工行为管理不到位；个人经营贷款挪用至房地产市场；个人消费贷款违规流入房地产市场；总行对分支机构管控不力承担管理责任；办理贸易背景不真实的银行承兑汇票；内控制度及执行严重违反审慎经营规则；案防管理不到位；未依法合规使用客户信息；违规办理同业业务；信贷业务违规；未按规定对保险代理机构从业人员进行执业登记和管理；保险代理业务档案不完整；违反规定开展互联网保险业务；违规向小微企业转嫁保险成本；信贷资金未按约定用途使用，

信贷资金流入第三方存管账户等原因，受到监管机构公开处罚。

华夏金融租赁有限公司因售后回租业务管理不审慎，部分资金用于缴纳土地出让金或支付土地拆迁补偿款；直租业务不审慎，资金被挪用，租赁物长期未建成；租赁物不符合监管要求；融资租赁资产风险分类不准确；直租项目未取得租赁物所有权；回租项目接受所有权存在瑕疵的财产作为租赁物等原因，受到监管机构公开处罚。

中国农业银行股份有限公司及其下属分支机构因信贷管理制度执行不力、员工行为管理不到位、内部监督履职不到位；以贷转存，虚增存款规模；业外涉刑案件迟漏报；违规浮利分费、服务收费质价不符；流动资金贷款押品管理不到位；存在员工参与非法吸收公众存款；贷后管理不尽职，流动资金贷款流入房地产领域；银行员工违规借用客户信贷资金；未按规定报送涉刑案件（风险）信息；部分房地产贷款未纳入房地产贷款科目；部分业务数据统计失真；发放无真实资金需求的流动资金贷款；未受托支付；对关联企业未进行统一授信；贷后管理不到位；未能有效识别虚假交易；未严格核实资料真实性；贷款审批不尽职；押品抵押登记办理不规范；对二手房中介合作管理不到位；未对资产评估机构实行有效的准入管理；押品评估不审慎；发放首付比例不足的按揭贷款；向商用房发放住房按揭贷款；未严格落实贷款审批要求；质价不符，收取投资银行顾问服务费；转嫁经营成本，由借款人支付评估费；通过违规调整企业规模规避授权管理要求；两家企业授信调查、审查不尽职；房地产贷款管理严重违反审慎经营规则；未按规定进行固定资产贷款资金支付管理与控制；未能有效监测贷款资金用途，贷款资金违规流入房地产领域等原因，受到监管机构公开处罚。

光大银行及其下属分支机构因未落实授信条件发放贷款、信贷资金回流借款人、贷款五级分类不准确；违规宣传理财产品预期收益率；内控制度不健全、执行不严导致案件发生；迟报案件信息；信贷业务违规；贷款“三查”管理不审慎、不良贷款管理不审慎；贷款业务严重违反审慎经营规则；未按监管规定报送案件信息；贷款管理不到位；贷前调查不尽职、贷后管理不到位；违反区域限购政策发放个人住房按揭贷款、对房地产开发贷款资金用途管理不尽职、流动资金贷款违规流入房地产企业；案防管理不到位；违规办理个人贷款，未严格落实保证合同面签制度；向客户转嫁经营成本；存贷挂钩、个人经营性贷款用途监控不到位、表外

业务管理不严；信用卡催收严重不审慎；违规办理贷款业务；内控制度执行不到位；违规办理票据业务导致信贷资金损失等原因，受到监管机构公开处罚。

汇丰银行（中国）有限公司及其下属分支机构向小型企业收取银行承兑汇票风险敞口管理费，受到监管机构公开处罚。

兴业银行股份有限公司及下属分支机构因未按规定落实重要岗位人员轮岗，严重违反审慎经营规则；个别销售人员在不清楚投资者风险承受能力的情况下宣传推介基金产品；个别销售人员向投资者发送未经审核的基金宣传推介材料，评价某基金经理和某基金产品时无客观证据支撑；未对支行互联网营销行为进行统一管理并监控留痕；理财销售行为不合规；未落实授信批复条件，违规向房地产企业提供融资；违规发放项目贷款实质用于土地储备；贷后管理不尽职，流动资金贷款违规流入房地产领域；违规为“四证”不全且资本金不实的项目提供融资；未严格执行受托支付和实贷实付；贷前调查、贷后管理不尽职，信贷资金被挪用于归还贷款；贷后管理不尽职，部分信贷资金未按约定用途使用；违规发放贷款偿还银行承兑汇票垫款，通过借新还旧和关联企业承接贷款延缓风险暴露；商业汇票办理不审慎，形成垫款；严重违反审慎经营规则；借贷搭售保险产品，严重违反审慎经营规则；违规开展代理保险业务。贷款管理不到位；房地产开发贷款管理不审慎；同业投资业务投前调查、投后管理不到位。未按要求报备反洗钱工作相关材料；贷款资金受托支付不规范、未严格落实“实贷实付”要求；非标债权投资资金支付管理不到位；汇票业务开展不规范；资产风险分类不准确；贷款业务严重违反审慎经营规则；债券承销业务严重违反审慎经营规则；未按规定报送案件（风险）信息；贷款资金转存用于质押开立银行汇票。老产品规模在部分时点出现反弹；未按规定开展理财业务内部审计；同业理财产品未持续压降；单独使用区间数值展示业绩比较基准；理财托管业务违反资产独立性原则要求；以存款作为审批和发放贷款的前提条件；贷后管理不尽职，信贷资金被挪作他用；托管业务内控不审慎，对划款指令形式审核、定期交易复核不到位；委托贷款协助监督委托资金使用不到位；代理销售保险业务过程中严重违反审慎经营规则行为；委托贷款挪用于购买理财产品；贷款管理不到位；信贷管理不到位；贷后管理严重违反审慎经营规则；房地产理财非标融资贷后管理不到位，未有效检查监督贷款的使用情况；个人经营贷款违规流入房地产市场；信用卡透支资金违规用于购

房；流动资金贷款贷后检查不尽职；非标准化债权资产投后管理不到位导致资金被挪用、回流。贷款资金流向缺乏有效管控，线上消费类贷款资金流入证券市场。贷款资金被挪用；违规发放流动资金贷款形成案件并迟报；违规发放虚假商用房按揭贷款；同业投资严重不审慎，资金违规投向土地收储；违规向资本金未真实到位的棚改项目提供融资。为无真实交易背景的公司办理银行承兑汇票业务。贷后管理严重违反审慎经营规则；因管理不善导致金融许可证遗失；为无真实交易背景的公司办理银行承兑汇票业务等原因，多次受到监管机构公开处罚。

华夏银行及下属分支机构因贷后管理不到位；个人贷款调查不尽职；流动资金贷款贷前调查不尽职、授信审批不审慎；信用证开证前调查不尽职；员工行为管理不到位；办理无真实贸易背景的银行承兑汇票；贷后管理不到位，未有效监控贷款资金使用情况；贷款调查不审慎，首付款来源真实性审核不到位；贷款五级分类不准确；贴现资金管理不到位；员工违规与中介合作揽储；集团统一授信管理不审慎、信贷管理不审慎；贷款资金被挪用于支付土地出让金、土拍保证金和拆迁补偿款；虚增存贷款；与融资租赁公司业务合作开展不审慎；违规发放固定资产贷款；贷款管理不到位，流动资金贷款被挪用于借款人子公司小额贷款公司购买理财和放贷；因管理不善导致金融许可证遗失；贴现资金回流至出票人用作保证金，滚动签发银行承兑汇票；贷后管理不到位，信贷资金未按约定用途使用；贷前调查不审慎；信贷资金流入证券市场，严重违反审慎经营规则；转嫁经营成本，违规由客户承担抵押登记费；违规向有足值抵押物的借款人销售人身保险；部分非现场监管统计数据不真实、不准确；贷前调查不到位，发放贸易背景不真实的贷款；保理融资业务贷前调查审查不尽职；银行承兑汇票业务贸易背景审查不严；个人按揭贷款未核实借款人首付款资金来源；银信通道业务资金回流借款人；流动资金贷款被挪用于房地产领域；滚动开票虚增存贷款规模；通过“第三方存单质押”业务虚增存贷款规模；个人住房贷款首付款审核不严；贷款转定期存单质押滚动开票虚增存贷款规模；内控制度执行不严格、信贷管理不尽职，发生业内案件且形成信贷业务资金损失；迟报案件风险信息；贷款资金违规回流；开立存单，质押用于发放流动资金贷款；未监督贷款资金用途，贷款资金违规流入房地产领域；对借款人收入认定不审慎；对公贷款资金用途管控不到位、个人贷款业务管理不到位；贷款管理不到位流动资金贷款被挪用于房地产开发企业；

贷款管理不到位信用卡资金被挪用于限控领域；违规以贷转存滚动办理存单质押贷款；贷款管理不到位形成不良；员工消费贷款违规挪用于限控领域；侵害消费者合法权益；利用同业存款虚增一般性存款问题屡查屡犯等原因，受到监管机构公开处罚。

本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。"

5.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	30,206.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,206.22

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	2,492,008,500.57
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	0.96
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,492,008,499.61

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.40

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额 总数	持有份额占 基金总份额 比例	发起份额 总数	发起份额占 基金总份额 比例	发起份额承诺 持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	0.40%	10,000,000.00	0.40%	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	0.40%	10,000,000.00	0.40%	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 03 月 31 日	2,482,008,307.17	-	-	2,482,008,307.17	99.60%
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同
- 2、国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

10.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

基金托管人住所。

10.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司
二〇二三年四月二十二日