国泰瑞泰纯债债券型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告 2025 年 9 月 30 日

基金管理人: 国泰基金管理有限公司 基金托管人: 中国邮政储蓄银行股份有限公司 报告送出日期: 二〇二五年十月二十八日

§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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同约定,于 2025 年 10 月 24 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 2025 年 07 月 01 日起至 2025 年 09 月 30 日止。

№ 基金产品概况

基金简称	国泰瑞泰纯债债券	
基金主代码	010836	
交易代码	010836	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年7月8日	
报告期末基金份额总额	800,015,199.32 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、久期策略; 2、类属配置策略; 3、利率品种策略; 4、 信用债策略; 5、回购交易策略; 6、信用衍生品投资策略	
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,理论上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。	

基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§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 (2025年7月1日-2025年9月30日)
1.本期已实现收益	273,422.37
2.本期利润	-404,393.52
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0005
4.期末基金资产净值	814,963,167.36
5.期末基金份额净值	1.0187

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	-0.05%	0.04%	-0.92%	0.08%	0.87%	-0.04%
过去六个月	1.01%	0.04%	0.82%	0.09%	0.19%	-0.05%
过去一年	2.74%	0.04%	2.87%	0.10%	-0.13%	-0.06%
过去三年	10.01%	0.04%	13.21%	0.08%	-3.20%	-0.04%
自基金合同 生效起至今	15.28%	0.04%	20.28%	0.07%	-5.00%	-0.03%

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

国泰瑞泰纯债债券型证券投资基金 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图 (2021年7月8日至2025年9月30日)



注:本基金的合同生效日为2021年7月8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。

84 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

41. A 111 A		任本基金的基金经理期限		证券从业年	2H BB
姓名	职务	任职日期	离任日期	限	说明
刘嵩扬	国 惠 开 券 泰 纯 券 泰 定 放 、 丰 债 、 惠 债 国 鑫 债 国 信	2021-08-27	-	13年	硕士研究生。曾任职于北京 鹏扬投资管理有限公司、鹏 扬基金管理有限公司、长江 养老保险股份有限公司, 2020年4月加入国泰基金。 2020年7月起任国泰农惠 定期开放债券型证券投资 基金、国泰丰鑫纯债债券型

三年定期开放债券。国家連合学的资基金、国家基合产产,是明开放债券型工产企业的资金。国家基金,国家基金,国家基金、国家基金、国家基金、国家基金、国家基金、国家基金、国家基金、国家基金、			
债券。国泰聚盈三年定期 开放债券型步转投资基金。国家聚盈一年定期 开放债券型步转设置基金。国家是有公司工务,投资基金和组国泰自会。国家是有公司工务,投资基金和组工务,投资基金和组工务,投资基金的基金经理,2020年7月至2023年5月 任国泰海岛战绩债务。国泰信利	三年定		证券投资基金、国泰惠信三
国泰聚	期开放		年定期开放债券型证券投
盈三年 定期开放债券型发起率, 投资基金和低债券型发起率, 为人员	债券、		资基金、国泰聚盈三年定期
定期开放债券型发起式。	国泰聚		开放债券型证券投资基金、
放债 券、国	盈三年		国泰合融纯债债券型证券
等、国家合融统债债券。国家信利	定期开		投资基金和国泰信利三个
秦合融 纯债债 券、国 泰信利 三个月 2023 年 5 月 任国泰添瑞一年定期开放 债券型及起式证券投资基金的基金经理, 2021 年 1 月起兼任国泰瑞泰纯债券型 放债 赛型证券投资基金的基金经理, 2021 年 12 月至 2023 年 6 月任国泰春元一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理, 2021 年 12 月至 2023 年 6 月任国泰春元一年定期开放债券也 发达。年 9 月至 2024 年 1 月任国泰春鸿一年定期开放债券 型发起或证证券投资基金经理。2023 年 5 月起兼任国泰督鸿一年定期开放债券 型发起或证证券投资基金经理。2023 年 5 月起兼任国泰自瑞纯债债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月起兼任国泰担证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月起兼任国泰担证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月起兼任国泰担证券投资基金的基金经理。2024 年 8 月起兼任国泰型公司证券投资基金的基金经理。2024 年 8 月起来企工证券投资基金的基金经理。2024 年 8 月起来企工证券投资基金的基金经理。2024 年 8 月起来企业,次债券发记式证券投资基金的基金经理。2025 年 3 月起兼任国泰主盈的基金经理,2025 年 3 月起兼任国泰丰盈的基金经理。2025 年 5 月起兼任国泰丰盈的基金经理。2025 年 5 月起兼任国泰丰盈,发债债券、国泰主盈的基金经理。2025 年 5 月起兼任国泰丰盈,发债债债券、国泰全投债债债费,国泰丰盈,经债债债费,国泰丰盈,经债债债费,国泰丰盈,经债债债费,国泰丰盈,经债债债费,国泰县经理。2025 年 5 月起兼任国泰丰盈,发起流证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月起兼任国泰丰盈,发起流证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月起兼任国泰丰盈,发起流证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月起兼任国泰丰盈,发起流证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月起兼任国泰丰盈,发起资证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月起兼任国泰丰盈,发起流证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月起兼任国泰主经债债债费,国泰任国泰全经理。2025 年 5 月起来任国泰主经债债债费,国泰任国泰全经理。2025 年 5 月起来任国泰全经理。2025 年 5 月起来任国泰主经债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债	放债		月定期开放债券型发起式
秦合融 纯债债 券、国 泰信利 三个月 2023 年 5 月 任国泰添瑞一年定期开放 债券型及起式证券投资基金的基金经理, 2021 年 1 月起兼任国泰瑞泰纯债券型 放债 赛型证券投资基金的基金经理, 2021 年 12 月至 2023 年 6 月任国泰春元一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理, 2021 年 12 月至 2023 年 6 月任国泰春元一年定期开放债券也 发达。年 9 月至 2024 年 1 月任国泰春鸿一年定期开放债券 型发起或证证券投资基金经理。2023 年 5 月起兼任国泰督鸿一年定期开放债券 型发起或证证券投资基金经理。2023 年 5 月起兼任国泰自瑞纯债债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月起兼任国泰担证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月起兼任国泰担证券投资基金的基金经理。2023 年 7 月起兼任国泰担证券投资基金的基金经理。2024 年 8 月起兼任国泰型公司证券投资基金的基金经理。2024 年 8 月起来企工证券投资基金的基金经理。2024 年 8 月起来企工证券投资基金的基金经理。2024 年 8 月起来企业,次债券发记式证券投资基金的基金经理。2025 年 3 月起兼任国泰主盈的基金经理,2025 年 3 月起兼任国泰丰盈的基金经理。2025 年 5 月起兼任国泰丰盈的基金经理。2025 年 5 月起兼任国泰丰盈,发债债券、国泰主盈的基金经理。2025 年 5 月起兼任国泰丰盈,发债债债券、国泰全投债债债费,国泰丰盈,经债债债费,国泰丰盈,经债债债费,国泰丰盈,经债债债费,国泰丰盈,经债债债费,国泰县经理。2025 年 5 月起兼任国泰丰盈,发起流证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月起兼任国泰丰盈,发起流证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月起兼任国泰丰盈,发起流证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月起兼任国泰丰盈,发起流证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月起兼任国泰丰盈,发起资证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月起兼任国泰丰盈,发起流证券投资基金的基金经理。2025 年 5 月起兼任国泰主经债债债费,国泰任国泰全经理。2025 年 5 月起来任国泰主经债债债费,国泰任国泰全经理。2025 年 5 月起来任国泰全经理。2025 年 5 月起来任国泰主经债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债债	券、国		证券投资基金的基金经理,
無债债			2020年7月至2023年5月
赛、国家信利 三个月 定期开放债务型。2021年8 月起兼任国泰瑞泰纯债债券型证券投资基金的基金经理,2021年12月至2023 筹、国泰瑞泰 纯债债			任国泰添瑞一年定期开放
泰信利 三个月 定期开 放债 券型证券投资基金的基金 经理,2021年12月至2023 寿、国 泰瑞泰 纯债债 券、国 泰信瑞 纯债债 券、国 泰信瑞 纯债债 券、国 泰信瑞 纯债债 券、国 泰信瑞 统债债 券、国 泰信瑞 统债债 券、国 泰兴富 三个月 定期开 放债 券、国 泰兴高 三个月 定期开 放债 费、国 泰市益 18个 月持有 期混 合、国 泰育元 一年定 期开放 债券发基金的基金 经理,2023年1月 月起兼任国秦中 发起式证券投资基金的基金 经理,2023年1月 月起兼任国秦中 发起式证券投资基金的基金 经理,2023年1月 月起, 发起式证券投资基金的基金 经理,2024年5月 起, 发起式证券投资基金的 基金经理,2024年5月 起, 发起式证券投资基金的 基金经理,2025年3月 起, 新任国秦帝元 一年定 期开放 债券发 起式、国泰金 龙债 券、国 秦春元 一年定 期开放 债券发 起式、 国泰全 龙债 券、国 秦春元 一年定 期开放 债券发 起式。 《参型证券投资基金的 基金经理,2025年3月 起, 新任国秦帝之龙债券证券投资基金的 基金经理,2025年3月 起, 新任国秦帝上、2025年3月 起, 新任国秦帝上、2025年5月 资级信用 债券型证券投资基金的基金经理。2025年5月 资级信用 债券型证券投资基金的基金经理。2025年5月 资级信用 债券型证券投资基金的基金经理。2025年5月 资级信用			
三个月 定期开 放债 券、国 泰瑞泰 纯债债 券、国 泰信瑞 纯债债 券、国 泰信瑞 纯债债 券、国 泰信瑞 纯债债 券、国 泰信瑞 纯债债 券、国 泰之经理,2023年1月任国 秦李四一年定期开放债券 型处起式证券投资基金的基金 经理,2023年5月起兼 任国泰信瑞纯债券型证券投资基金的基金 经理或证券投资基金的基金 经理或证券投资基金的基 发起式证券投资基金的基 发起式证券投资基金的基 发起式证券投资基金的基 在国泰同益 18个 月持有 期混 合、国 泰容元 一年定 期开放债券发 起式证券投资基金的人工证券投资基金的人工证券投资基金的人工证券投资基金的人工证券投资基金的人工证券投资基金的人工证券投资基金的人工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工工			
定期开放债券型证券投资基金的基金经理,2021年12月至2023年6月任国泰睿元一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2022年9月至2024年1月任国泰睿鸿一年定期投资基金的基金经理,2022年9月至2024年1月任国泰睿鸿一年定期投资基金的基金经理,2023年5月起兼任国泰信瑞统债债券型发起式证券投资基金的基金经理,2023年7月起兼任国泰信瑞统债债券型点式证券投资基金的基金经理,2023年7月起兼任国泰司益第个月定期开放债券基金的基金经理,2023年11月起期报。18个月持有期混。6、国泰帝元一年定期开放债务型发起式证券投资基金的基金经理,2024年5月起兼任国泰睿元一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2024年8月投资基金的基金经理,2024年8月投资基金的基金经理,2025年5月起兼任国泰全发度,2025年5月起来任国泰全发度,2025年5月起来任国泰全发债券、国泰全发理,2025年5月起来任国泰全发度,2025年5月起来任国泰全发度,2025年5月起来任国泰全经理,2025年5月起来任国泰全经理,2025年5月起来任国泰全经理,2025年5月起来任国泰全经理,2025年5月起来任国泰全经理。			
放债券、国泰瑞泰 统债债 经理, 2021 年 12 月至 2023 年 6月任国泰睿元一年定期 开放债券型发起式证券投资基金的基金经理, 2022 年 9 月至 2024 年 1 月任国泰睿鸿一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理, 2023 年 5 月起兼任国泰常鸿一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理, 2023 年 7 月起兼任国泰兴 富三个月定期开放债券外国泰兴国泰同益 18 个月声有期混 6、国泰睿元 一年定期开放债务基金的基金经理, 2024 年 5 月起兼任国泰睿元一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理, 2024 年 5 月起兼任国泰睿元一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理, 2024 年 8 月起兼任国泰金之遗务证券投资基金的基金经理, 2025 年 5 月起兼任国泰幸企业债券工产。 6 基金经理,2025 年 5 月起兼任国泰丰盈纯债券型证券投资基金的基金经理,2025 年 5 月起兼任国泰丰盈,在经理,2025 年 5 月起兼任国泰丰盈,在经理,2025 年 5 月起来任国泰丰盈,在经理,2025 年 5 月起来任国泰丰盈,在经理,2025 年 5 月起来任国泰丰盈,在经理,2025 年 5 月起来任国泰丰盈,在经过,2025 年 5 月起来任国泰兴。2025 年 5 月起来,2025 年 5 月起来日本经验证。2025 年 5 月起来任国泰兴。2025 年 5 月起来任国泰兴。2025 年 5 月起来在是在国泰兴。2025 年 5 月起来在是在是在基础,2025 年 5 月起来,2025 年 5 月起来在是在国泰兴,2025 年 5 月起来,2025 年 5 月起来,2025 年 5 月起来在是在国泰兴,2025 年 5 月起来,			
等、国 索瑞泰 纯债债			
泰瑞泰 (2022			
9. 少			
等、国家信瑞 经债债 整发起式证券投资基金的 基金经理,2023年5月起兼 任国家信瑞纯债债券型证 是 经 是 是 经 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是			· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·
泰信瑞			
理债债			
券、国 基金经理,2023年5月起兼任国泰代债债券型证券投资基金的基金经理,2023年7月起兼任国泰兴 放债 第三个月定期开放债券型 发起式证券投资基金的基金经理,2023年11月起兼 金经理,2023年11月起兼 18个月持有 混合型证券投资基金的基 金经理,2024年5月起兼任 国泰睿元 一年定期开放债券型发起式证券投资基金 的基金经理,2024年8月起 兼任国泰金 龙债券证券投资基金 的基金经理,2024年8月起 兼任国泰金 龙债券 资基金 的基金经理,2025年3月起兼任国泰全 龙债券 型证券投资基金 的基金经理,2025年3月起兼任 国泰中债优选投资级信用 泰丰盈 纯债债券 太国 泰丰盈 纯债债券 太国 泰丰盈 纯债债券 太国 泰丰盈 纯债债费 工证券投资基金 的基金经理。			
 素兴富 三个月 定期开 放债 券、国 泰同益 18个 月持有 期混 合、国 泰睿元 一年定 期开放 债券发 起式 起去 是理,2024年5月起兼任 国泰睿元 一年定 期开放 债券发 起式、 国泰金 龙经理,2024年8月起 兼任国泰全尤债券证券投资基金的基金经理,2024年8月起 兼任国泰全之债券证券投资基金的基金经理,2025年3月起兼任国泰主盈纯债 券型证券投资基金的基金经理,2025年5月起兼任 国泰全 龙债 券、国 泰丰盈 纯债债 券、国 泰年盈 纯债债 券、国 本的基金经理。 			
三个月 定期开 放债 券、国 泰同益 18 个 月持有 期混 合、国 泰睿元 一年定 期开放 债券发 起式证券投资基金的基金经理,2024年5月起兼任 国泰睿元 一年定 期开放 债券发 起式、 国泰金 龙债券证券投资基金的基金经理,2024年8月起 兼任国泰金之难,2024年8月起 兼任国泰金之难,2024年8月起 兼任国泰金之难,2024年8月起 兼任国泰金之难,2025年3月起兼任国泰丰盈纯债 债券型证券投资基金的基金经理,2025年5月起兼任 国泰中债优选投资基金的基金经理,2025年5月起兼任国泰丰盈纯债 券、国 泰丰盈 纯债债 券、国			
定期开放债券型券、国泰同益 18个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理, 2023年11月起兼任国泰同益 18个月持有期混合型证券投资基金的基金经理, 2024年5月起兼任国泰睿元一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理, 2024年8月起期开放债券发起式证券投资基金的基金经理, 2024年8月起,并任国泰金龙债券证券投资基金的基金经理, 2025年3月起兼任国泰丰盈纯债债券型证券投资基金的基金经理, 2025年5月起兼任国泰丰盈纯债债券型证券投资基金的基金经理, 2025年5月起兼任国泰丰盈纯债债券型证券投资基金的基金经理, 2025年5月起兼任国泰丰盈纯债债券、国泰丰盈,使债优选投资级信用债指数发起式证券投资基金的基金经理。			
放债券、国泰同益 18个月起来 任国泰同益 18个月持有期 混合型证券投资基金的基金经理,2023年11月起来 任国泰同益 18个月持有期 混合型证券投资基金的基金经理,2024年5月起兼任 国泰睿元一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2024年8月起期开放债券发			
发起式证券投资基金的基金经理,2023年11月起兼任国泰同益18个月持有期混合型证券投资基金的基金经理,2024年5月起兼任国泰睿元一年定期开放债泰睿元一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2024年8月起兼任国泰金龙债券证券投资基金的基金经理,2024年8月起兼任国泰金龙债券证券投资基金的基金经理,2025年3月起兼任国泰丰盈纯债债券型证券投资基金的基金经理,2025年5月起兼任国泰丰盈纯债债券工证券投资基金的基金经理,2025年5月起兼任国泰丰盈纯债债券、国泰丰盈,债债选投资级信用债指数发起式证券投资基金的基金经理。			
秦同益 18个 月持有 月持有 期混 合型证券投资基金的基 金经理,2024年5月起兼任 国泰睿元 一年定期开放债 泰睿元 一年定期开放 债券发 债券发 债券发 起式、 国泰金 龙债 国泰金 龙债 等型发起式证券投资基金的基 全理,2024年8月起 兼任国泰金龙债券证券投资基金的基金经理,2025年3月起兼任国泰丰盈纯债 债券型证券投资基金的基金经理,2025年5月起兼任 国泰金 龙债 券、国 泰丰盈 纯债债 券、国 泰丰盈 纯债债 券、国			
日 18 个 月持有			
用持有 期混 合、国 泰睿元 一年定 期开放 债券发 债券发 起式、 国泰金 龙债 为型发起式证券投资基金 的基金经理,2024年8月起 兼任国泰金龙债券证券投 资基金的基金经理,2025年3月起兼任国泰丰盈纯债 债券型证券投资基金的基 金经理,2025年5月起兼任 国泰中债优选投资级信用 债指数发起式证券投资基 纯债债 券、国			
期混合、国泰睿元一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理,2024年8月起期开放债券发起式证券投资基金的基金经理,2024年8月起期开放债券发债券发展,2025年3月起兼任国泰丰盈纯债债券型证券投资基金的基金经理,2025年5月起兼任国泰中债优选投资级信用泰丰盈纯债债券、国泰丰盈纯债债债券、国泰丰盈纯债债债券、国泰丰盈			
□ 合、国 表容元 □ 国泰容元 □ 国泰容元 □ 年定 期开放债 券型发起式证券投资基金 的基金经理,2024年8月起 兼任国泰金龙债券证券投资基金的基金经理,2025年3月起兼任国泰丰盈纯债 国泰金 龙债 歩型证券投资基金的基金经理,2025年5月起兼任 国泰中债优选投资级信用 泰丰盈 纯债债 券、国 □ 参 □ 参 □ 参 □ 参 □ 参 □ 参 □ 参 □ 参 □ 参 □			
泰睿元 一年定 期开放 债券发 债券发 起式、 国泰金 龙债 为型证券投资基金的基金经理,2025年3月起兼任国泰丰盈纯债 债券型证券投资基金的基金经理,2025年5月起兼任 基本中债优选投资级信用 泰丰盈 纯债债 券、国			
一年定期开放债券发债券发度基金的基金经理,2024年8月起兼任国泰金龙债券证券投资基金的基金经理,2025年3月起兼任国泰丰盈纯债债券型证券投资基金的基金经理,2025年5月起兼任国泰中债优选投资级信用债指数发起式证券投资基金的基金经理。			
期开放 债券发 起式、 国泰金 龙债 券、国 秦丰盈 纯债债 券、国			
债券发起式、国泰金 龙债 券、国 泰丰盈 纯债债 券、国			
起式、 国泰金 龙债 券、国 泰丰盈 纯债债 券、国			
国泰金 龙债 券、国 泰丰盈 纯债债 券、国			
龙债 卷 经理,2025 年 5 月起兼任 国泰中债优选投资级信用 泰丰盈	, - ,		
券、国 国泰中债优选投资级信用 泰丰盈 债指数发起式证券投资基 纯债债 金的基金经理。			
泰丰盈 纯债债 券、国			
纯债债 金的基金经理。			
券、国			
			並 即至並红生。

优别	选投		
资4	级信		
用作	债指		
数数	发起		
的	基金		
经	全理		

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法律法规及行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资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所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所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

三季度债券市场整体呈现单边上行的调整行情,同时伴随着信用利差和期限利差的扩张,赚钱效应较差。组合在本季度久期维持中性偏低水平,杠杆率明显下降来应对可能出现的负债不稳定。持仓以中短期限信用债为主,收益来源于票息收益,但受到资本利得亏损的拖累,单季度来看净值回报较低。

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-0.05%,同期业绩比较基准收益率为-0.92%。

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	828,465,936.52	98.34
	其中:债券	828,465,936.52	98.34
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	19,400.00	0.00
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	L	ı
6	银行存款和结算备付金合计	13,928,258.95	1.65
7	其他各项资产	18,135.79	0.00
8	合计	842,431,731.26	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	1,912,539.13	0.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	310,726,825.76	38.13
	其中:政策性金融债	114,834,342.47	14.09
4	企业债券	240,632,225.22	29.53
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	225,249,833.08	27.64
7	可转债 (可交换债)	-	-
8	同业存单	49,944,513.33	6.13
9	其他	-	-
10	合计	828,465,936.52	101.66

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	230203	23 国开 03	500,000	52,133,547.95	6.40
2	2422002	24 永赢金 租债 01	500,000	51,143,336.99	6.28
3	102484130	24 中油股 MTN002	500,000	49,998,750.68	6.14

4	112512153	25 北京银 行 CD153	500,000	49,944,513.33	6.13
5	250201	25 国开 01	420,000	42,297,221.92	5.19

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明 细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中,北京银行股份有限公司、永赢金融租赁有限公司、中国工商银行股份有限公司、江苏金融租赁股份有限公司、国家开发银行、中国石油天然气股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。

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 基金投资的前十名证券中,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	18,135.79
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	18,135.79

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。

% 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	800,015,217.34
报告期期间基金总申购份额	1.96
减: 报告期期间基金总赎回份额	19.98
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	800,015,199.32

87 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

本报告期內本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末,本基金管理人未持有本基金。

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。

88 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况			
投资者 类别	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	2025年07月01 日至2025年09月 30日	799,99 9,000.0 0	-	-	799,999,000. 00	100.00%	
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。

89 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰瑞泰纯债债券型证券投资基金注册的批复
- 2、国泰瑞泰纯债债券型证券投资基金基金合同
- 3、国泰瑞泰纯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

9.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉

昱大厦 15-20 层。

基金托管人住所。

9.3 查阅方式

可咨询本基金管理人; 部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话: (021) 31089000, 400-888-8688

客户投诉电话: (021) 31089000

公司网址: http://www.gtfund.com

国泰基金管理有限公司 二〇二五年十月二十八日