

# 国泰金龙债券证券投资基金

## 2024 年第 2 季度报告

2024 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年七月十九日

## §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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2024 年 07 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 04 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	国泰金龙债券
基金主代码	020002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 12 月 5 日
报告期末基金份额总额	66,891,272.47 份
投资目标	在保证投资组合低风险和高流动性的前提下，追求较高的当期收入和总回报，力求基金资产的稳定增值。
投资策略	1、债券投资策略（以长期利率趋势分析为基础，兼顾中短期经济周期、政策方向及收益率曲线分析，通过债券置换和收益率曲线策略等方法，实施积极的债券投资管理。在有效控制利率和信用风险的前提下，为投资者谋求稳定的低风险收益）；2、选券标准；3、债券增值技术；4、债券组合的建立与调整；5、投资组合的流动性管理；6、拟公开发行业股票的申购及可转债转股持有策略；7、存托

	凭证投资策略。	
业绩比较基准	中证综合债指数收益率	
风险收益特征	本基金属于收益稳定、风险较低的品种。	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国泰金龙债券 A	国泰金龙债券 C
下属分级基金的交易代码	020002	020012
报告期末下属分级基金的份 额总额	60,891,695.38 份	5,999,577.09 份

### §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 (2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	国泰金龙债券 A	国泰金龙债券 C
1.本期已实现收益	452,476.35	39,093.25
2.本期利润	790,638.79	75,280.80
3.加权平均基金份额本期利润	0.0130	0.0117
4.期末基金资产净值	66,666,762.55	6,145,963.14
5.期末基金份额净值	1.095	1.024

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

1、国泰金龙债券 A:

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	1.20%	0.09%	1.74%	0.07%	-0.54%	0.02%
过去六个月	2.24%	0.11%	3.87%	0.07%	-1.63%	0.04%
过去一年	2.15%	0.11%	5.98%	0.06%	-3.83%	0.05%
过去三年	9.50%	0.15%	15.83%	0.06%	-6.33%	0.09%
过去五年	3.89%	0.28%	25.07%	0.06%	-21.18%	0.22%
自基金合同 生效起至今	127.15%	0.22%	126.53%	0.08%	0.62%	0.14%

2、国泰金龙债券 C:

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	1.09%	0.10%	1.74%	0.07%	-0.65%	0.03%
过去六个月	1.99%	0.11%	3.87%	0.07%	-1.88%	0.04%
过去一年	1.79%	0.11%	5.98%	0.06%	-4.19%	0.05%
过去三年	8.47%	0.15%	15.83%	0.06%	-7.36%	0.09%
过去五年	2.29%	0.28%	25.07%	0.06%	-22.78%	0.22%
自基金合同 生效起至今	116.75%	0.22%	126.53%	0.08%	-9.78%	0.14%

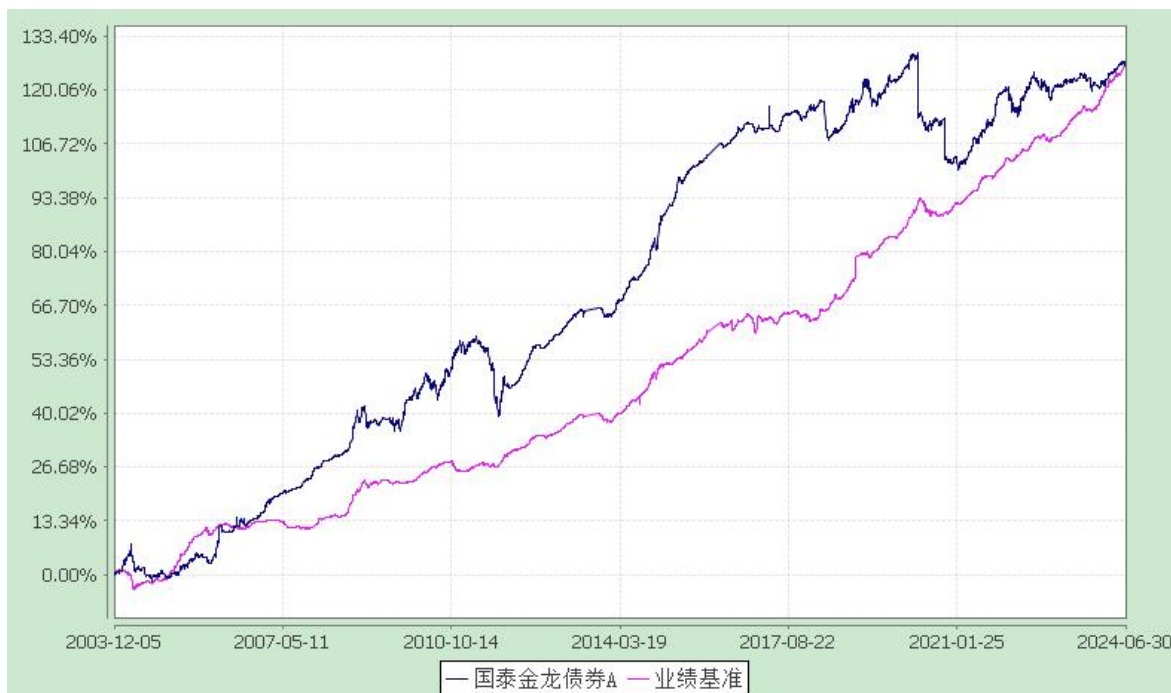
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰金龙债券证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003 年 12 月 5 日至 2024 年 6 月 30 日)

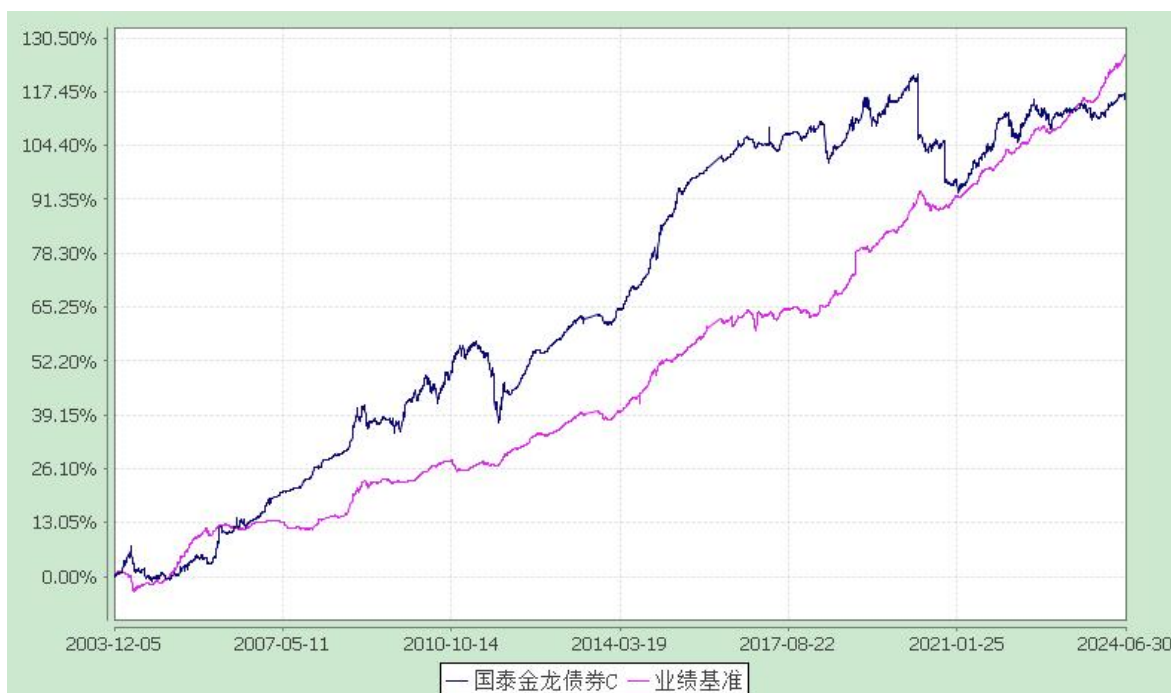
1. 国泰金龙债券 A:



注：1、本基金自 2003 年 12 月 5 日合同生效日起，在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

2、自 2015 年 9 月 1 日起，本基金的业绩比较基准由“中信全债指数收益率”，变更为“中证综合债指数收益率”。

## 2. 国泰金龙债券 C:



注：1、本基金自 2003 年 12 月 5 日合同生效日起，在六个月建仓期结束时，各项资产配置

配置比例符合合同约定。

2、自 2015 年 9 月 1 日起，本基金的业绩比较基准由“中信全债指数收益率”，变更为“中证综合债指数收益率”。

## §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		
王玉	国泰上证 5 年期国债 ETF、上证 10 年期国债 ETF、国泰金龙债券、国泰信用互利债券、国泰中债 1-3 年国开债、国泰中证细分化工产业主题 ETF、国泰中证环保产业 50ETF、国泰中证光伏产业 ETF 发起联	2020-03-13	-	8 年	硕士研究生。曾任职于光大银行上海分行。2016 年 1 月加入国泰基金，历任交易员、基金经理助理。2019 年 12 月起任上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金和上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 3 月起兼任国泰金龙债券证券投资基金和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）的基金经理，2020 年 4 月至 2021 年 7 月任国泰聚瑞纯债债券型证券投资基金的基金经理，2020 年 6 月至 2021 年 7 月任国泰惠泰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 8 月至 2021 年 8 月任国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金和国泰惠瑞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 8 月起兼任国泰中债 1-3 年国开债债券指数证券投资基金的基金经理，2021 年 3 月起兼任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和国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 6 月至 2023 年 5 月任国泰中证环保产业 50 交易型

	接、国泰中证影视主题 ETF、国泰中证新材料主题 ETF、国泰上证科创板 100ETF 的基金经理				开放式指数证券投资基金发起式联接基金和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的基金经理，2021 年 10 月起兼任国泰中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金和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的基金经理，2021 年 11 月起兼任国泰中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 12 月至 2023 年 5 月任国泰中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2022 年 2 月至 2023 年 5 月任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的基金经理，2023 年 9 月起兼任国泰上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
刘波	国泰信用互利债券、国泰可转债债券、国泰金龙债券、国泰鑫享稳健 6 个月滚动持有债券、国泰信利三个月定期开放债券的基金经理	2021-02-09	-	16 年	硕士研究生。曾任职于太平养老保险、长信基金、中欧基金。2020 年 5 月加入国泰基金，拟任基金经理。2020 年 9 月起任国泰信用互利债券型证券投资基金和国泰可转债债券型证券投资基金的基金经理，2021 年 2 月至 2022 年 10 月任国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2021 年 2 月起兼任国泰金龙债券证券投资基金的基金经理，2021 年 5 月起兼任国泰鑫享稳健 6 个月滚动持有债券型证券投资基金的基金经理，2023 年 4 月起兼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。
茅利伟	国泰聚鑫纯债债券、	2023-08-25	-	11 年	硕士研究生。曾任职于杉杉青骛投资管理有限公司和上海海通证券资产管理有限公司。2022 年 12 月

	国泰鑫享稳健6个月滚动持有债券、国泰金龙债券、国泰惠盈纯债债券、国泰安康定期支付混合、国泰安璟债券、国泰浓益灵活配置混合、国泰浩益混合的基金经理			加入国泰基金，拟任基金经理。2023年6月起任国泰聚鑫纯债债券型证券投资基金的基金经理，2023年7月起兼任国泰鑫享稳健6个月滚动持有债券型证券投资基金的基金经理，2023年8月起兼任国泰金龙债券证券投资基金的基金经理，2023年10月起兼任国泰惠盈纯债债券型证券投资基金的基金经理，2024年1月起兼任国泰安康定期支付混合型证券投资基金、国泰安璟债券型证券投资基金和国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2024年5月起兼任国泰浩益混合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合规守信情况的说明

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

二季度，宏观经济整体向好，我国经济长期向好的趋势进一步确认。新质生产力相关的经济有较好的恢复，但受地产投资拖累，宏观经济主要还是呈现弱复苏的态势。

债券方面，在支持性的货币政策基调下，光谱利率整体下行，尤其是贷款利率明显下行，有力支持了实体经济。操作方面，组合积极参与了利率债的行情。

转债方面，二季度转债整体微涨，但总体财富效应较弱。操作方面，账户审慎选择一些个券参与。

#### 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 1.20%，同期业绩比较基准收益率为 1.74%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为 1.09%，同期业绩比较基准收益率为 1.74%。

### 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	92,578,447.48	98.04
	其中：债券	92,578,447.48	98.04
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	450,000.00	0.48
	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	1,397,279.20	1.48
7	其他各项资产	4,672.12	0.00
8	合计	94,430,398.80	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	18,465,276.02	25.36
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	34,889,949.92	47.92

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	22,496,063.15	30.90
7	可转债（可交换债）	16,727,158.39	22.97
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	92,578,447.48	127.15

### 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	230028	23 付息国债 28	90,000	9,358,347.54	12.85
2	137646	22 苏金 K1	60,000	6,176,598.58	8.48
3	115417	23 大兴 01	60,000	6,099,626.30	8.38
4	115032	23 江公 01	50,000	5,169,886.30	7.10
5	137589	22 穗投 02	50,000	5,120,317.81	7.03

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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。

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	1,384.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,287.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,672.12

**5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123212	立中转债	1,410,034.85	1.94
2	123191	智尚转债	1,213,918.90	1.67
3	113050	南银转债	627,060.41	0.86
4	113059	福莱转债	534,060.27	0.73
5	113053	隆 22 转债	508,751.78	0.70
6	127035	濮耐转债	497,666.85	0.68
7	127090	兴瑞转债	493,559.67	0.68
8	123150	九强转债	478,848.77	0.66
9	128131	崇达转 2	443,305.75	0.61
10	127050	麒麟转债	402,955.48	0.55
11	113657	再 22 转债	400,165.48	0.55
12	118040	宏微转债	394,894.79	0.54
13	110090	爱迪转债	385,984.08	0.53
14	113048	晶科转债	378,027.40	0.52
15	113676	荣 23 转债	349,766.88	0.48
16	123158	宙邦转债	341,143.97	0.47

17	113652	伟 22 转债	337,072.54	0.46
18	113661	福 22 转债	319,065.95	0.44
19	118031	天 23 转债	278,553.70	0.38
20	113634	珀莱转债	270,518.63	0.37
21	113675	新 23 转债	259,690.01	0.36
22	113658	密卫转债	257,052.05	0.35
23	127043	川恒转债	246,915.89	0.34
24	127074	麦米转 2	239,812.05	0.33
25	118028	会通转债	230,553.70	0.32
26	128141	旺能转债	229,048.77	0.31
27	113666	爱玛转债	228,260.55	0.31
28	127091	科数转债	226,010.30	0.31
29	127073	天赐转债	224,295.89	0.31
30	127085	韵达转债	220,202.03	0.30
31	127056	中特转债	218,677.10	0.30
32	123202	祥源转债	215,098.25	0.30
33	111014	李子转债	212,264.11	0.29
34	118035	国力转债	211,661.64	0.29
35	127025	冀东转债	206,971.95	0.28
36	123165	回天转债	206,201.37	0.28
37	123179	立高转债	204,403.40	0.28
38	113641	华友转债	202,934.03	0.28
39	123012	万顺转债	187,401.40	0.26
40	118034	晶能转债	169,864.23	0.23
41	123222	博俊转债	130,899.75	0.18
42	123219	宇瞳转债	126,223.04	0.17
43	127032	苏行转债	125,703.01	0.17
44	110079	杭银转债	120,767.23	0.17
45	127082	亚科转债	118,904.93	0.16
46	127041	弘亚转债	115,205.89	0.16
47	111000	起帆转债	114,884.93	0.16
48	128138	侨银转债	114,210.68	0.16
49	123115	捷捷转债	110,735.62	0.15
50	123169	正海转债	108,102.88	0.15
51	123174	精锻转债	107,499.04	0.15
52	128124	科华转债	98,108.99	0.13
53	113633	科沃转债	3,202.41	0.00
54	110064	建工转债	1,115.84	0.00

#### 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

项目	国泰金龙债券A	国泰金龙债券C
本报告期期初基金份额总额	60,898,233.00	7,523,344.71
报告期期间基金总申购份额	776,585.22	156,865.76
减：报告期期间基金总赎回份额	783,122.84	1,680,633.38
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	60,891,695.38	5,999,577.09

### §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	34,926,383.23
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	34,926,383.23
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	52.21

#### 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 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

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	2024年04月01日至2024年06月30日	34,926,383.23	-	-	34,926,383.23	52.21%
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。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、关于同意设立国泰金龙系列证券投资基金的批复
- 2、国泰金龙系列证券投资基金基金合同
- 3、国泰金龙系列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  
二〇二四年七月十九日