

# 国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

## 2023 年第 3 季度报告

### 2023 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

## §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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 年 10 月 23 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	国泰瑞安三个月定期开放债券
基金主代码	006994
交易代码	006994
基金运作方式	契约型开放式。本基金以定期开放方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式。
基金合同生效日	2019 年 5 月 30 日
报告期末基金份额总额	1,594,878,612.47 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）中小企业私募债投资策略。

	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	平安银行股份有限公司

### §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 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	15,893,715.97
2.本期利润	23,853,741.05
3.加权平均基金份额本期利润	0.0150
4.期末基金资产净值	1,697,976,503.88
5.期末基金份额净值	1.0646

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	1.41%	0.03%	0.69%	0.05%	0.72%	-0.02%
过去六个月	2.52%	0.02%	2.49%	0.05%	0.03%	-0.03%
过去一年	3.58%	0.04%	3.39%	0.05%	0.19%	-0.01%
过去三年	11.14%	0.04%	13.82%	0.05%	-2.68%	-0.01%
自基金合同生效起至今	15.27%	0.05%	19.55%	0.06%	-4.28%	-0.01%

### 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

国泰瑞安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5月30日至2023年9月30日)



注：本基金的合同生效日为2019年5月30日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理(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		
魏伟	国泰添福一年定期开放债券、国泰润利纯债债券、国泰聚享纯债债券、国泰瑞安三个月定期开放债券、国泰润鑫纯债债券、国泰聚瑞纯债债券、国泰聚禾纯债债券、国泰添瑞一年定期开放债券、国泰合融纯债债券的基金经理	2023-03-27	-	8 年	硕士研究生。曾任职于上海光大证券资产管理有限公司,2020 年 3 月加入国泰基金,历任债券交易员。2023 年 3 月起任国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰聚享纯债债券型证券投资基金、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰润鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰聚瑞纯债债券型证券投资基金和国泰聚禾纯债债券型证券投资基金的基金经理,2023 年 5 月起兼任国泰添瑞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 6 月起兼任国泰合融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《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 3 季度以来各项稳增长政策频出，叠加 9 月资金利率中枢明显走高，利率债收益曲线平坦化上行，1 年期国债大幅上行 32.5BP，10 年期国债上行 3.5BP，中短期限信用债利差被动收窄。组合在 3 季度内维持低久期和杠杆，未来一段时间仍计划以票息策略为主，力求为组合获取稳定的收益回报。

### 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 1.41%，同期业绩比较基准收益率为 0.69%。

#### 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	1,998,802,256.78	99.99
	其中：债券	1,998,802,256.78	99.99
	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	-	-
	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	180,578.01	0.01
7	其他各项资产	-	-
8	合计	1,998,982,834.79	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	354,046,483.48	20.85
	其中：政策性金融债	334,159,805.88	19.68
4	企业债券	231,500,356.73	13.63
5	企业短期融资券	605,037,520.95	35.63
6	中期票据	729,393,692.41	42.96
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	78,824,203.21	4.64
9	其他	-	-
10	合计	1,998,802,256.78	117.72

#### 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	210402	21 农发 02	900,000	92,022,983.61	5.42
2	230401	23 农发 01	800,000	81,188,953.42	4.78
3	230201	23 国开 01	800,000	81,128,721.31	4.78
4	230211	23 国开 11	800,000	79,819,147.54	4.70
5	112310244	23 兴业银行 CD244	800,000	78,824,203.21	4.64

#### 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（除“国开行、农发行、兴业银行”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。

国家开发银行下属分支机构因项目贷款“三查”不到位；内控制度执行不到位；未严格执行内控制度,瞒报案件风险信息;员工管理不到位；违规收取小微企业贷款承诺费；违规转嫁抵押登记费和押品评估费；向不合规的项目发放贷款；流动资金贷款受托支付审查不尽职，对同一贸易背景进行重复融资；固定资产贷款受托支付未收集用途资料，信贷资金挪用；信贷资金被挪用于归还借款人本行前期贷款本金；银团贷款贷后管理不尽职等原因，受到监管机构公开处罚。

农业发展银行下属分支机构因未按工程进度发放贷款；未落实内部授信审批条件发放贷款；未严格按照公布的收费价目名录收取融资顾问费；未按规定进行贷款资金支付管理与控制；贷款“三查”不到位；违规发放贷款增加地方政府隐性债务；项目贷款管理不审慎，资金未按约定用途使用等原因，受到监管机构公开处罚。

兴业银行及下属分支机构因损坏金融许可证；部分未取得基金从业资格的员工从事基金销售业务相关工作；贷前调查未尽职，未发现个人收入流水造假；流动贷款资金偿还委托贷款；衍生品交易未严格审查交易对手的交易资格；对实际无贷款利率避险需求的客户提供代客 LPR 利率互换业务；代客 LPR 利率互换业务未按规定进行分类管理；债券交易超授权；通过资产管理产品开展不正当交易；超

比例投资本行主承销的债券；债券投资五级分类不准确；债券投资风险管理未独立于当地分支行；通过金融交易市场进行电子化交易的同业业务委托分支机构询价和项目发起；市场风险资本计量严重不审慎等原因，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

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 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	1,594,878,609.83
报告期期间基金总申购份额	6.60
减：报告期期间基金总赎回份额	3.96
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,594,878,612.47

## §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

本报告期内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。

## §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	2023年07月01日至2023年09月30日	1,594,878,413.35	-	-	1,594,878,413.35	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。							

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同
- 2、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

### 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16层-19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  
二〇二三年十月二十五日