

# 国泰君安现金管家货币市场基金

## 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:上海国泰君安证券资产管理有限公司

基金托管人:中国证券登记结算有限责任公司

送出日期:2022 年 08 月 31 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董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本基金合同约定，于2022年8月19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2022年6月30日止。

## 1.2 目录

|  |    |
|--|----|
| §1 重要提示及目录                               | 2  |
| 1.1 重要提示                                 | 2  |
| 1.2 目录                                   | 3  |
| §2 基金简介                                  | 5  |
| 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                               | 7  |
| 2.5 其他相关资料                               | 7  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现                         | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                          | 7  |
| 3.2 基金净值表现                               | 8  |
| §4 管理人报告                                 | 9  |
| 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合规守信情况的说明               | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                  | 12 |
| 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              | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望              | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                  | 13 |
| 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        | 14 |
| §5 托管人报告                                 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                   | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明  | 14 |
| 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        | 14 |
| §6 中期财务会计报告(未经审计)                        | 14 |
| 6.1 资产负债表                                | 14 |
| 6.2 利润表                                  | 16 |
| 6.3 净资产(基金净值)变动表                         | 18 |
| 6.4 报表附注                                 | 19 |
| §7 投资组合报告                                | 46 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                           | 46 |
| 7.2 债券回购融资情况                             | 47 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限                         | 47 |
| 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明          | 48 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                     | 48 |
| 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 | 49 |
| 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离       | 49 |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细   | 50 |
| 7.9 投资组合报告附注                             | 50 |
| §8 基金份额持有人信息                             | 51 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                    | 51 |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况                   | 51 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                 | 52 |
| 8.4 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情况         | 52 |

|   |    |
|---|----|
| §9 开放式基金份额变动.....                       | 52 |
| §10 重大事件揭示.....                         | 52 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 52 |
| 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.....   | 52 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 53 |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                     | 53 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 53 |
| 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.....      | 53 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 53 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....              | 54 |
| 10.9 其他重大事件.....                        | 54 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 55 |
| 11.1 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..... | 55 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 55 |
| §12 备查文件目录.....                         | 55 |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 55 |
| 12.2 存放地点.....                          | 56 |
| 12.3 查阅方式.....                          | 56 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 国泰君安现金管家货币市场基金     |
| 基金简称       | 国泰君安现金管家货币         |
| 基金主代码      | 952100             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2021年12月03日        |
| 基金管理人      | 上海国泰君安证券资产管理有限公司   |
| 基金托管人      | 中国证券登记结算有限责任公司     |
| 报告期末基金份额总额 | 23,059,274,076.68份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 安全性和流动性优先,在此基础上追求适度收益。  |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金根据宏观经济运行状况、政策形势、信用状况、利率走势、资金供求变化等的综合判断,并结合各类资产的估值水平、流动性特征、风险收益特征,决定各类资产的配置比例,并适时进行动态调整。</p> <p>2、久期管理策略</p> <p>本基金根据对未来短期利率走势的研判,结合基金资产流动性的要求动态调整组合久期。</p> <p>当预期短期利率上升时,降低组合久期,以规避资本损失或获得较高的再投资收益;在预期短期利率下降时,提高组合久期,以获得资本利得或锁定较高的利率水平。</p> <p>3、个券选择策略</p> <p>在个券选择上,本基金将综合运用收益率曲线分析、流动性分析、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值,发掘出具备相对价值的个券。</p> <p>4、利用短期市场机会的灵活策略</p> <p>由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级意</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>外变化等情况会造成短期内市场失衡；新股、新债发行以及年末效应等因素会使市场资金供求发生短时的失衡。这种失衡将带来一定市场机会。通过分析短期市场机会发生的动因，研究其中的规律，据此调整组合配置，改进操作方法，积极利用市场机会获得超额收益。</p> <p>5、现金流管理策略</p> <p>本基金将根据对申购赎回现金流情况变化的动态预测，结合对市场资金面等因素的分析，合理配置和动态调整组合现金流，在充分保持基金流动性的基础上争取较高收益。</p> <p>未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，本基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富基金投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）  |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，预期收益和预期风险低于债券型基金、股票型基金和混合型基金。   |

### 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      | 上海国泰君安证券资产管理有限公司            | 中国证券登记结算有限责任公司   |
| 信息披露负责人 | 姓名                          | 吕巍               |
|         | 联系电话                        | 021-38676022     |
|         | 电子邮箱                        | zgxxpl@gtjas.com |
| 客户服务电话  | 95521                       | 4008-058-058     |
| 传真      | 021-38871190                | -                |
| 注册地址    | 上海市黄浦区南苏州路381号409A10室       | 北京市西城区太平桥大街17号   |
| 办公地址    | 上海市静安区新闻路669号博华广场22-23层及25层 | 北京市西城区锦什坊街26号    |
| 邮政编码    | 200120                      | 100033           |

|       |     |     |
|-------|-----|-----|
| 法定代表人 | 谢乐斌 | 于文强 |
|-------|-----|-----|

## 2.4 信息披露方式

|                     |                             |
|---------------------|-----------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报                        |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.gtjazg.com              |
| 基金中期报告备置地点          | 上海市静安区新闸路669号博华广场22-23层及25层 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址           |
|--------|----------------|----------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街17号 |

## § 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<br>(2022年01月01日- 2022年06月30日) |
|---------------|-----------------------------------|
| 本期已实现收益       | 164,303,566.25                    |
| 本期利润          | 164,303,566.25                    |
| 本期净值收益率       | 0.7458%                           |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末<br>(2022年06月30日)             |
| 期末基金资产净值      | 23,059,274,076.68                 |
| 期末基金份额净值      | 1.0000                            |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末<br>(2022年06月30日)             |
| 累计净值收益率       | 0.8714%                           |

注：

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用（例如，开放式基金的转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差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     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去一个月      | 0.0949%  | 0.0014%     | 0.1125%    | 0.0000%       | -0.0176% | 0.0014% |
| 过去三个月      | 0.3645%  | 0.0016%     | 0.3413%    | 0.0000%       | 0.0232%  | 0.0016% |
| 过去六个月      | 0.7458%  | 0.0013%     | 0.6788%    | 0.0000%       | 0.0670%  | 0.0013% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.8714%  | 0.0012%     | 0.7875%    | 0.0000%       | 0.0839%  | 0.0012% |

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



国泰君安现金管家货币市场基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年12月03日-2022年06月30日)



注：本基金于2021年12月3日注册为公募基金，自合同生效日起至本报告期末不足一年。

## § 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

上海国泰君安证券资产管理有限公司正式成立于2010年10月18日，经中国证监会证监许可【2010】631号文批准，是业内首批券商系资产管理公司。公司注册资本金20亿元，注册地上海。

截至2022年6月30日，本基金管理人共管理了17只公开募集证券投资基金：国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安现金管家货币市场基金、国泰君安君得盛债券型证券投资基金、国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金、国泰君安中证500指数增强型证券投资基金、国泰君安1年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰君安创新医药混合型发起式证券投资基金、国泰君安信息行业混合型发起式证券投资基金、国泰君安善融稳健一年持有期混合型基金中基金(FOF)、国泰君安君得盈债券型证券投资基金、国泰君安君得诚混合型证券投资基金、国泰君安君得明混合型证券投资基金、国泰君安君得鑫两年持有期混合型证券投资基金、国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)、国泰君安60天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰君安君得利短债债券型证券投资基金、国泰君安君添利中短债债券型发起式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 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 |        |  |
| 杜浩然 | 本基金基金经理，国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理，国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理，国泰君安60天滚动持有中短债债券型证券投资基金基金经理，国泰君安君得利短债债券型证券投资基金基金经理，国泰君安君添利中短债债券型发起式证券投资基金基金经理 | 2021-12-03      | -    | 7年     | 杜浩然，复旦大学金融硕士，7年证券从业经历。现任本公司固定收益投资部基金经理，主要负责固定收益类产品的投资研究工作。自2017年9月5日至2022年3月2日担任“国泰君安君得利三号货币集合资产管理计划”投资经理，自2018年6月21日至2022年3月8日担任“国泰君安君得利一号货币增强集合资产管理计划”，自2018年6月21日起至2021年11月30日担任“国泰君安君得利二号货币增强集合资产管理计划”投资经理，自2018年11月6日起至2021年12月2日担任“国泰君安现金管家货币集合资产管理计划”投资经理，自2020年3月25日起至2021年8月17日担任“国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划”投资经理，自2020年9月28日起至2021年12月6日担任“国泰君安君得盛债券型集 |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  | <p>合资产管理计划”投资经理，自2021年1月28日起至2022年1月16日担任”国泰君安君得盈债券型集合资产管理计划”投资经理，自2021年5月25日至2021年12月6日担任”国泰君安君得惠中债1-3年政策性金融债指数集合资产管理计划”投资经理，自2021年9月1日起担任”国泰君安30天滚动持有中短债债券型证券投资基金”基金经理，自2021年12月3日起担任”国泰君安现金管家货币市场基金”基金经理，自2021年12月7日起至2022年3月9日担任”国泰君安君得盛债券型证券投资基金”基金经理，自2021年12月7日起担任”国泰君安中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金”基金经理，自2022年1月17日起至2022年3月9日担任”国泰君安君得盈债券型证券投资基金”基金经理，自2022年3月3日起担任”国泰君安60天滚动持有中短债债券型证券投资基金”基金经理，自2022年3月9日起担任”国泰君安君得利短债债券型证券投资基金”基金经理，自2022年6月17日起担任”国泰君安君添利中短债债</p> |
|--|--|--|--|--|

|  |  |  |  |  |                        |
|--|--|--|--|--|------------------------|
|  |  |  |  |  | 券型发起式证券投资基金<br>“基金经理”。 |
|--|--|--|--|--|------------------------|

注：1、上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《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，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规、相关规定以及基金合同、招募说明书约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法违规行为及违反基金合同、招募说明书约定的行为，无侵害基金份额持有人利益的行为。

## 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，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，确保公平对待所有的投资组合，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，本基金与本管理人管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况。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

上半年，国内经济受到多地疫情短期扰动影响存在一定压力。货币政策持续维持宽松，财政发力靠前。债券在宽货币基调和宽信用担忧中呈现震荡走势，曲线陡峭化。上半年地产需求端政策显著放松、专项债提前集中发行，经济一季度呈现弱复苏，二季度受到疫情多地爆发影响，下行压力加大。PMI从2月份50.2下滑到4月份的低点47.4，6月份重回50.2。货币政策方面，4月降准25BP，1月和5月份分别降低LPR10BP和15BP，资金价格相对稳定、显著低于OMO政策利率，R007、DR007的2季度中枢分别为1.8519%、

1.7248%，机构杠杆套息力度较大，带动信用利差大幅压缩。上半年同业存单利率震荡下行，1年期AAA级CD利率全年从2.60%下行到2.3%附近。

上半年，本产品在保证流动性、不影响委托人证券交易的前提下，主要投资于银行存款、同业存单、高评级短期债券、逆回购等。四季度，通过对货币市场利率的判断，结合本产品规模变化规律，适时在活期存款、定期存款、同业存单、高评级短期债券、逆回购等资产中做出投资安排，保持产品平稳运行。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国泰君安现金管家货币基金份额净值为1.000元，本报告期内，基金份额净值收益率为0.7458%，同期业绩比较基准收益率为0.6788%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，稳增长政策持续发力下经济将缓步复苏，不过在疫情持续扰动、地产下行压力拖累下复苏斜率或较为平缓，货币政策仍将持续保驾护航，流动性保持合理充裕，资金中枢缓慢向政策利率回归。政治局会议强调“保持经济运行在合理区间，力争实现最好结果”、“财政货币政策要有效弥补社会需求不足。用好地方政府专项债券资金，支持地方政府用足用好专项债务限额”，在稳增长政策持续发力下，经济基本面将持续修复，但短期在疫情时有扰动、地产行业仍面临下行压力的拖累下，经济修复斜率或较为平缓，货币政策将维持流动性合理充裕，易松难紧，但也需提防随着经济增长逐渐回归潜在增速，资金中枢也将缓慢回归政策利率带来的调整风险。

基于上述判断，下半年本产品将灵活调整组合久期和仓位，在活期存款、定期存款、同业存单、高评级短期债券、逆回购等资产中做出合适投资安排，继续保持产品平稳运行。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每季度集中支付收益。

本报告期累计收益分配金额164,303,566.25元。

#### 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

本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

### § 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

本报告期内，本托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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

本报告期内，本托管人根据《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有关规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了监督和复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人复核了本报告中的财务指标、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，认为其内容真实、准确和完整。

### § 6 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：国泰君安现金管家货币市场基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2022年06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 | 3,538,732,824.38   | 1,870,241,367.04    |
| 结算备付金      |         | 18,955,894.72      | 17,547,267.53       |
| 存出保证金      |         | 2,872.09           | 294,970.83          |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 12,745,988,635.62          | 16,768,557,830.30           |
| 其中：股票投资       |            | -                          | -                           |
| 基金投资          |            | -                          | -                           |
| 债券投资          |            | 12,745,988,635.62          | 16,768,557,830.30           |
| 资产支持证券投资      |            | -                          | -                           |
| 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    | 8,476,140,210.38           | 689,921,124.96              |
| 债权投资          |            | -                          | -                           |
| 其中：债券投资       |            | -                          | -                           |
| 资产支持证券投资      |            | -                          | -                           |
| 其他投资          |            | -                          | -                           |
| 其他债权投资        |            | -                          | -                           |
| 其他权益工具投资      |            | -                          | -                           |
| 应收清算款         |            | 1,178,413,550.95           | -                           |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | -                          | -                           |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                          | 24,189,209.27               |
| 资产总计          |            | 25,958,233,988.14          | 19,370,751,769.93           |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022年06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     |            | 2,865,079,146.29           | 1,685,581,217.21            |
| 应付清算款         |            | -                          | -                           |

|             |         |                   |                   |
|-------------|---------|-------------------|-------------------|
| 应付赎回款       |         | -                 | -                 |
| 应付管理人报酬     |         | 18,406,495.08     | 14,200,551.33     |
| 应付托管费       |         | 1,022,583.07      | 2,408,090.25      |
| 应付销售服务费     |         | 4,995,093.37      | 2,344,745.09      |
| 应付投资顾问费     |         | -                 | -                 |
| 应交税费        |         | 2,834.05          | 12,808.45         |
| 应付利润        |         | 8,962,473.78      | 24,518,700.25     |
| 递延所得税负债     |         | -                 | -                 |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 491,285.82        | 432,180.70        |
| 负债合计        |         | 2,898,959,911.46  | 1,729,498,293.28  |
| <b>净资产：</b> |         |                   |                   |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 23,059,274,076.68 | 17,641,253,476.65 |
| 其他综合收益      |         | -                 | -                 |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | -                 | -                 |
| 净资产合计       |         | 23,059,274,076.68 | 17,641,253,476.65 |
| 负债和净资产总计    |         | 25,958,233,988.14 | 19,370,751,769.93 |

注：截至本报告期末2022年06月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额23,059,274,076.68份。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰君安现金管家货币市场基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

| 项目             | 附注号     | 本期<br>2022年01月01日至2022年0<br>6月30日 |
|----------------|---------|-----------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b> |         | 313,084,172.71                    |
| 1. 利息收入        |         | 90,794,303.83                     |
| 其中：存款利息收入      | 6.4.7.9 | 60,958,043.32                     |
| 债券利息收入         |         | -                                 |
| 资产支持证券利息收入     |         | -                                 |



|                            |            |                |
|----------------------------|------------|----------------|
| 买入返售金融资产收入                 |            | 29,836,260.51  |
| 其他利息收入                     |            | -              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | 222,289,868.88 |
| 其中：股票投资收益                  |            | -              |
| 基金投资收益                     |            | -              |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.10   | 222,289,868.88 |
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.11   | -              |
| 贵金属投资收益                    |            | -              |
| 衍生工具收益                     |            | -              |
| 股利收益                       |            | -              |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益      |            | -              |
| 其他投资收益                     |            | -              |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     |            | -              |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -              |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.12   | -              |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 148,780,606.46 |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 98,993,009.43  |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 5,499,611.66   |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 19,609,759.10  |
| 4. 投资顾问费                   |            | -              |
| 5. 利息支出                    |            | 24,445,748.09  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 24,445,748.09  |
| 6. 信用减值损失                  |            | -              |
| 7. 税金及附加                   |            | 2,718.10       |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.13   | 229,760.08     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 164,303,566.25 |
| 减：所得税费用                    |            | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 164,303,566.25 |

|               |  |                |
|---------------|--|----------------|
| 五、其他综合收益的税后净额 |  | -              |
| 六、综合收益总额      |  | 164,303,566.25 |

注：国泰君安现金管家货币市场基金基金合同于2021年12月3日正式生效。无上年度同期可比数据。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰君安现金管家货币市场基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

| 项 目   | 本期<br>2022年01月01日至2022年06月30日 |            |                    |                        |
|---|-------------------------------|------------|--------------------|------------------------|
|   | 实收基金                          | 其他综合收<br>益 | 未分配利润              | 净资产合计                  |
| 一、上期期末净资产<br>(基金净值)                             | 17,641,253,4<br>76.65         | -          | -                  | 17,641,253,4<br>76.65  |
| 加：会计政策变更  | -                             | -          | -                  | -                      |
| 前期差错更<br>正                                      | -                             | -          | -                  | -                      |
| 其他  | -                             | -          | -                  | -                      |
| 二、本期期初净资产<br>(基金净值)                             | 17,641,253,4<br>76.65         | -          | -                  | 17,641,253,4<br>76.65  |
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填<br>列)                    | 5,418,020,60<br>0.03          | -          | -                  | 5,418,020,60<br>0.03   |
| (一)、综合收益总<br>额                                  | -                             | -          | 164,303,566.<br>25 | 164,303,566.<br>25     |
| (二)、本期基金份<br>额交易产生的基金<br>净值变动数(净值减<br>少以“-”号填列) | 5,418,020,60<br>0.03          | -          | -                  | 5,418,020,60<br>0.03   |
| 其中：1. 基金申购款                                     | 244,073,692,<br>786.05        | -          | -                  | 244,073,692,<br>786.05 |
| 2. 基金赎回   | -238,655,67                   | -          | -                  | -238,655,67            |

|  |                   |   |                 |                   |
|--|-------------------|---|-----------------|-------------------|
| 款  | 2,186.02          |   |                 | 2,186.02          |
| (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) | -                 | - | -164,303,566.25 | -164,303,566.25   |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                 | - | -               | -                 |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                          | 23,059,274,076.68 | - | -               | 23,059,274,076.68 |

注：国泰君安现金管家货币市场基金基金合同于2021年12月3日正式生效。无上年度同期可比数据。

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：

谢乐斌

陶耿

茹建江

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国泰君安现金管家货币市场基金由国泰君安现金管家货币集合资产管理计划变更注册而来。国泰君安现金管家货币集合资产管理计划于2012年6月15日取得中国证监会出具的《关于同意上海国泰君安证券资产管理有限公司开展现金管理产品试点并核准设立国泰君安现金管家货币集合资产管理计划的批复》（证监许可〔2012〕828号），自2012年6月28日起开始募集，于2012年8月3日结束募集工作，并于2012年8月6日成立。

根据《中华人民共和国基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》、《现金管理产品运作管理指引》的规定，国泰君安现金管家货币集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请变更注册。2021年10月11日，本基金经中国证券监督管理委员会《关于准予国泰君安现金管家货币集合资产管理计划变更注册的批复》（证监许可〔2021〕3214号文）注册。《国泰君安现金管家货币市场基金基金合同》于2021年12月3日生效，原《国泰君安现金管家货币集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，具体如下：

- (一) 现金；
  - (二) 期限在1年以内（含1年）的银行存款、中央银行票据、同业存单；
  - (三) 期限在1个月以内的债券回购；
  - (四) 剩余期限在397天以内（含397天）的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券；
  - (五) 中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。
- 本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

#### 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》、《现金管家货币市场基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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于2022年6月30日的财务状况以及自2022年1月1日起至2022年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本会计期间为自2022年1月1日至2022年6月30日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 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商业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

本基金持有的金融资产主要为债务工具，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商业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2022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。

本基金以交易目的持有的债券投资和资产支持证券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。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券投资起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资或资产支持证券投资的账面价值中。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。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率每日计提应计利息，同时在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。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。对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券投资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。

债券投资和资产支持证券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。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

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。基金管理人应根据相关法律法规控制影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：

(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。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由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。

债券投资和资产支持证券投资处置时处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

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则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他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按直线法近似计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、每一基金份额享有同等分配权；

2、本基金收益“每日计提、按季支付”。收益支付方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益支付方式是红利再投资；

3、本基金采用1.00元固定份额净值列示，自基金合同生效之日起，本基金根据每日收益情况，以每万份基金暂估收益为基准，为投资者计算当日暂估收益，并在季度分红日根据实际未付收益按季支付；

4、本基金根据每日暂估收益情况，将当日暂估收益计入投资人账户，每一基金份额计提的收益相等，若当日暂估净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日暂估净收益小于零时，为投资人记负收益；若当日暂估净收益等于零时，当日投资人不记收益；

5、收益季度支付时，如投资者的累计实际未结转收益为正，则根据基金份额持有人选择的收益支付方式，为基金份额持有人增加相应的基金份额或支付相应的现金收益；如投资者的累计实际未结转收益等于零时，基金份额持有人的基金份额保持不变且不支付现金收益；如投资者的累计实际未结转收益为负，则为基金份额持有人缩减相应的基金份额，遇投资者剩余基金份额不足以扣减的情形，基金管理人将根据内部应急机制保障基金平稳运行；

6、投资者赎回基金份额时，按本金支付，赎回份额当期对应的收益，于当期季度分红日支付；

7、投资者解约情形下，按照当期收益分配期间收益率与解约日银行活期存款利率孰低的原则计付收益；

8、T日申购的基金份额不享有当日收益分配权益，自下一工作日起享有收益分配权益；T日赎回的基金份额享有当日收益分配权益，自下一工作日起不享有收益分配权益；

9、在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会；

10、如需召开基金份额持有人大会，基金份额持有人的表决权以登记机构在权益登记日登记的份额体现其持有的权益；

11、法律、法规或中国证监会另有规定的从其规定。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.14 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，本基金计算影子价格过程中确定债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。

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

本基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

##### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在2018年1月1

日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

### 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

### 4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### 5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基

金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 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              |  |
|--------------|------------------|--|
|              | 2022年06月30日      |  |
| 活期存款         | 3,038,649,491.04 |  |
| 等于：本金        | 3,034,327,501.48 |  |
| 加：应计利息       | 4,321,989.56     |  |
| 减：坏账准备       | -                |  |
| 定期存款         | 500,083,333.34   |  |
| 等于：本金        | 500,000,000.00   |  |
| 加：应计利息       | 83,333.34        |  |
| 减：坏账准备       | -                |  |
| 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    | 500,083,333.34   |  |
| 其他存款         | -                |  |
| 等于：本金        | -                |  |
| 加：应计利息       | -                |  |
| 减：坏账准备       | -                |  |
| 合计           | 3,538,732,824.38 |  |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末          |      |      |         |
|----|--------------|------|------|---------|
|    | 2022年06月30日  |      |      |         |
|    | 按实际利率计算的账面价值 | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 (%) |
|    |              |      |      |         |

|        |       |                   |                   |               |         |
|--------|-------|-------------------|-------------------|---------------|---------|
| 债券     | 交易所市场 | 185,590,674.49    | 185,076,726.02    | -513,948.47   | -0.0022 |
|        | 银行间市场 | 12,560,397,961.13 | 12,572,130,430.14 | 11,732,469.01 | 0.0509  |
|        | 合计    | 12,745,988,635.62 | 12,757,207,156.16 | 11,218,520.54 | 0.0487  |
| 资产支持证券 |       | -                 | -                 | -             | -       |
| 合计     |       | 12,745,988,635.62 | 12,757,207,156.16 | 11,218,520.54 | 0.0487  |

注：

1. 偏离金额=影子定价-摊余成本
2. 偏离度=偏离金额/基金资产净值

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债余额。

#### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022年06月30日 |           |
|-------|--------------------|-----------|
|       | 账面余额               | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 2,530,835,380.01   | -         |
| 银行间市场 | 5,945,304,830.37   | -         |
| 合计    | 8,476,140,210.38   | -         |

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购中取得的债券。

#### 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         |  |
|-------------|-------------|--|
|             | 2022年06月30日 |  |
| 应付券商交易单元保证金 | -           |  |
| 应付赎回费       | -           |  |
| 应付交易费用      | 302,529.35  |  |
| 其中：交易所市场    | -           |  |
| 银行间市场       | 302,529.35  |  |
| 应付利息        | -           |  |
| 预提费用        | 108,807.37  |  |
| 预提费用-信息披露费  | 79,949.10   |  |
| 合计          | 491,285.82  |  |

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                      |                     |
|---------------|-------------------------|---------------------|
|               | 2022年01月01日至2022年06月30日 |                     |
|               | 基金份额（份）                 | 账面金额                |
| 上年度末          | 17,641,253,476.65       | 17,641,253,476.65   |
| 本期申购          | 244,073,692,786.05      | 244,073,692,786.05  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -238,655,672,186.02     | -238,655,672,186.02 |
| 本期末           | 23,059,274,076.68       | 23,059,274,076.68   |

#### 6.4.7.8 未分配利润

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        |
|----------------|----------------|-------|----------------|
| 本期期初           | -              | -     | -              |
| 本期利润           | 164,303,566.25 | -     | 164,303,566.25 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -              | -     | -              |
| 其中：基金申购款       | -              | -     | -              |



|         |                 |   |                 |
|---------|-----------------|---|-----------------|
| 基金赎回款   | -               | - | -               |
| 本期已分配利润 | -164,303,566.25 | - | -164,303,566.25 |
| 本期末     | -               | - | -               |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                      |  |
|-----------|-------------------------|--|
|           | 2022年01月01日至2022年06月30日 |  |
| 活期存款利息收入  | 53,812,227.40           |  |
| 定期存款利息收入  | 6,695,666.79            |  |
| 其他存款利息收入  | -                       |  |
| 结算备付金利息收入 | 450,149.13              |  |
| 其他        | -                       |  |
| 合计        | 60,958,043.32           |  |

#### 6.4.7.10 债券投资收益

##### 6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期                      |  |
|-------------------------------|-------------------------|--|
|                               | 2022年01月01日至2022年06月30日 |  |
| 债券投资收益——利息收入                  | 202,942,501.69          |  |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 19,347,367.19           |  |
| 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                            | 222,289,868.88          |  |

##### 6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期                      |  |
|----|-------------------------|--|
|    | 2022年01月01日至2022年06月30日 |  |

|                         |                   |
|-------------------------|-------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 30,231,393,480.94 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 30,173,000,000.00 |
| 减：应计利息总额                | 39,045,973.73     |
| 减：交易费用                  | 140.02            |
| 买卖债券差价收入                | 19,347,367.19     |

#### 6.4.7.11 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.11.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                       | 本期                      |   |
|--------------------------|-------------------------|---|
|                          | 2022年01月01日至2022年06月30日 |   |
| 资产支持证券投资收益——利息收入         |                         | - |
| 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                       |                         | - |

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.12 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期                      |  |
|----|-------------------------|--|
|    | 2022年01月01日至2022年06月30日 |  |
|    |                         |  |

|          |            |
|----------|------------|
| 审计费用     | 59,507.37  |
| 信息披露费    | 68,908.51  |
| 银行费用     | 82,594.20  |
| 银行间账户维护费 | 18,600.00  |
| 其他费用     | 150.00     |
| 合计       | 229,760.08 |

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要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

本报告期内与本基金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         |
|------------------|-----------------|
| 上海国泰君安证券资产管理有限公司 | 本基金的管理人         |
| 中国证券登记结算有限责任公司   | 本基金的托管人         |
| 国泰君安证券股份有限公司     | 本基金的代销机构、管理人的股东 |

#### 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

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金未进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金未进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

无。

#### 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                      |
|-----------------|-------------------------|
|                 | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 98,993,009.43           |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 46,963,013.51           |

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.90%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.90\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

当以0.90%的管理费计算的七日年化暂估收益率小于或等于2倍活期存款利率，基金管理人将调整管理费为0.30%，以降低每万份基金暂估净收益为负并引发销售机构交收透支的风险，直至该类风险消除，基金管理人方可恢复计提0.90%的管理费。基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                      |
|----------------|-------------------------|
|                | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 5,499,611.66            |

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

##### 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 | 本期 |
|--------------|----|
|              |    |

|              |                         |
|--------------|-------------------------|
| 名称           | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|              | 当期发生的基金应支付的销售服务费        |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 19,609,673.40           |
| 合计           | 19,609,673.40           |

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的销售服务费

E为前一日的基金资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

| 项目                          | 本期                      |
|-----------------------------|-------------------------|
|                             | 2022年01月01日至2022年06月30日 |
| 基金合同生效日（2021年12月03日）持有的基金份额 | 150,000,000.00          |
| 报告期初持有的基金份额                 | 150,000,000.00          |
| 报告期间申购/买入总份额                | 1,257,648.44            |
| 报告期间因拆分变动份额                 | 0.00                    |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额              | 704,227.20              |
| 报告期末持有的基金份额                 | 150,553,421.24          |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例         | 0.65%                   |

注：本基金合同生效日为2021年12月3日，无上年度同期对比数据。

##### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

| 关联方名称        | 本期末<br>2022年06月30日 |                  | 上年度末<br>2021年12月31日 |                  |
|--------------|--------------------|------------------|---------------------|------------------|
|              | 持有的基金份额            | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额             | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 261,032,020.00     | 1.1300%          | 313,286,624.00      | 1.7800%          |

#### 6.4.10.5 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01月01日至2022年06月30日 |              |
|----------------|-------------------------------|--------------|
|                | 期末余额                          | 当期利息收入       |
| 中国证券登记结算有限责任公司 | 28,258,363.32                 | 5,336,888.05 |

注：国泰君安现金管家货币市场基金基金合同于2021年12月3日正式生效。无上年度同期可比数据。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金

单位：人民币元

| 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动   | 本期利润<br>分配合计   | 备注 |
|------------------|-------------------|----------------|----------------|----|
| 176,837,440.48   | -                 | -12,533,874.23 | 164,303,566.25 | -  |

6.4.12 期末（2022年06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。

6.4.12.3 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

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称        | 回购到期日      | 期末估值单价 | 数量（张）     | 期末估值总额         |
|-----------|-------------|------------|--------|-----------|----------------|
| 112104035 | 21中国银行CDO35 | 2022-07-01 | 99.90  | 100,000   | 9,989,907.33   |
| 112109230 | 21浦发银行CD230 | 2022-07-01 | 99.81  | 1,000,000 | 99,812,351.97  |
| 112212075 | 22北京银行CDO75 | 2022-07-01 | 97.95  | 550,000   | 53,870,804.72  |
| 112213066 | 22浙商银行CDO66 | 2022-07-01 | 97.98  | 2,950,000 | 289,032,470.16 |
| 112213073 | 22浙商银行CDO73 | 2022-07-01 | 97.98  | 1,000,000 | 97,983,815.27  |
| 112213076 | 22浙商银行CDO76 | 2022-07-01 | 97.95  | 1,850,000 | 181,202,318.58 |
| 112213087 | 22浙商银行CDO87 | 2022-07-01 | 99.06  | 1,500,000 | 148,590,148.13 |
| 112214074 | 22江苏银行CDO74 | 2022-07-01 | 97.97  | 300,000   | 29,390,814.66  |
| 112214082 | 22江苏银行CDO82 | 2022-07-01 | 97.93  | 2,000,000 | 195,864,465.36 |
| 112214084 | 22江苏银行CDO84 | 2022-07-01 | 97.75  | 2,000,000 | 195,505,571.06 |

|           |               |            |        |            |                  |
|-----------|---------------|------------|--------|------------|------------------|
| 112281708 | 22厦门国际银行CD115 | 2022-07-01 | 99.05  | 2,200,000  | 217,904,041.35   |
| 112298761 | 22杭州银行CD128   | 2022-07-01 | 99.78  | 2,800,000  | 279,370,297.10   |
| 112299006 | 22江西银行CDO91   | 2022-07-01 | 97.93  | 2,200,000  | 215,452,624.82   |
| 190214    | 19国开14        | 2022-07-01 | 102.28 | 750,000    | 76,710,826.01    |
| 210312    | 21进出12        | 2022-07-01 | 101.62 | 1,000,000  | 101,621,519.87   |
| 210407    | 21农发07        | 2022-07-01 | 101.86 | 2,200,000  | 224,088,697.04   |
| 210411    | 21农发11        | 2022-07-01 | 101.49 | 500,000    | 50,742,791.98    |
| 220201    | 22国开01        | 2022-07-01 | 100.95 | 3,600,000  | 363,417,291.31   |
| 220301    | 22进出01        | 2022-07-01 | 100.47 | 1,400,000  | 140,660,369.47   |
| 220401    | 22农发01        | 2022-07-01 | 100.43 | 900,000    | 90,389,668.87    |
| 合计        |               |            |        | 30,800,000 | 3,061,600,795.06 |

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了由董事会（含内部控制委员会）、经营管理层（含风险控制委员会、首席风险官）、风险管理部门，以及业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。



本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 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06月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | 230,182,036.97      |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 1,222,863,163.60   | 1,558,898,057.77    |
| 合计     | 1,222,863,163.60   | 1,789,080,094.74    |

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2022年06月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 11,113,423,118.19  | 14,799,637,862.47   |
| 合计     | 11,113,423,118.19  | 14,799,637,862.47   |

#### 6.4.13.2.3 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06月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 185,590,674.49     | -                   |
| AAA以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 224,111,679.34     | 179,839,873.09      |
| 合计     | 409,702,353.83     | 179,839,873.09      |

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有

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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

#### 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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022 年<br>06 月 30<br>日 | 1 个月以内           | 1-3 个月           | 3 个月-1 年          | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息              | 合计                |
|-------------------------------|------------------|------------------|-------------------|-------|-------|------------------|-------------------|
| 资产                            |                  |                  |                   |       |       |                  |                   |
| 银行存款                          | 3,038,649,491.04 | -                | 500,083,333.34    | -     | -     | -                | 3,538,732,824.38  |
| 结算备付金                         | 18,955,894.72    | -                | -                 | -     | -     | -                | 18,955,894.72     |
| 存出保证金                         | 2,872.09         | -                | -                 | -     | -     | -                | 2,872.09          |
| 交易性金融资产                       | 1,326,691,330.57 | 1,081,538,457.71 | 10,337,758,847.34 | -     | -     | -                | 12,745,988,635.62 |
| 买入返售金融资产                      | 8,476,140,210.38 | -                | -                 | -     | -     | -                | 8,476,140,210.38  |
| 应收清算款                         | -                | -                | -                 | -     | -     | 1,178,413,550.95 | 1,178,413,550.95  |
| 资产总计                          | 12,860,439,79    | 1,081,538,45     | 10,837,842,18     | -     | -     | 1,178,413,55     | 25,958,233,98     |

## 国泰君安现金管家货币市场基金 2022 年中期报告

|                                |                  |                  |                   |       |       |                  |                   |
|--------------------------------|------------------|------------------|-------------------|-------|-------|------------------|-------------------|
| 计                              | 8.80             | 7.71             | 0.68              |       |       | 0.95             | 8.14              |
| 负债                             |                  |                  |                   |       |       |                  |                   |
| 卖出回购金融资产款                      | 2,865,079,146.29 | -                | -                 | -     | -     | -                | 2,865,079,146.29  |
| 应付管理人报酬                        | -                | -                | -                 | -     | -     | 18,406,495.08    | 18,406,495.08     |
| 应付托管费                          | -                | -                | -                 | -     | -     | 1,022,583.07     | 1,022,583.07      |
| 应付销售服务费                        | -                | -                | -                 | -     | -     | 4,995,093.37     | 4,995,093.37      |
| 应交税费                           | -                | -                | -                 | -     | -     | 2,834.05         | 2,834.05          |
| 应付利润                           | -                | -                | -                 | -     | -     | 8,962,473.78     | 8,962,473.78      |
| 其他负债                           | -                | -                | -                 | -     | -     | 491,285.82       | 491,285.82        |
| 负债总计                           | 2,865,079,146.29 | -                | -                 | -     | -     | 33,880,765.17    | 2,898,959,911.46  |
| 利率敏感度缺口                        | 9,995,360,652.51 | 1,081,538,457.71 | 10,837,842,180.68 | -     | -     | 1,144,532,785.78 | 23,059,274,076.68 |
| 上年度末<br>2021 年<br>12 月 31<br>日 | 1 个月以内           | 1-3 个月           | 3 个月-1 年          | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息              | 合计                |
| 资产                             |                  |                  |                   |       |       |                  |                   |
| 银行存款                           | 1,270,241,367.04 | -                | 600,000,000.00    | -     | -     | -                | 1,870,241,367.04  |
| 结算备付金                          | 17,547,267.53    | -                | -                 | -     | -     | -                | 17,547,267.53     |
| 存出保证金                          | 294,970.83       | -                | -                 | -     | -     | -                | 294,970.83        |
| 交易性金融资产                        | 3,175,386,123.77 | 3,693,771,492.39 | 9,899,400,214.14  | -     | -     | -                | 16,768,557,830.30 |
| 买入返售金融资产                       | 689,921,124.96   | -                | -                 | -     | -     | -                | 689,921,124.96    |
| 应收利息                           | -                | -                | -                 | -     | -     | 24,189,209.27    | 24,189,209.27     |
| 资产总计                           | 5,153,390,854.13 | 3,693,771,492.39 | 10,499,400,214.14 | -     | -     | 24,189,209.27    | 19,370,751,769.93 |
| 负债                             |                  |                  |                   |       |       |                  |                   |
| 卖出回购金融资产款                      | 1,685,581,217.21 | -                | -                 | -     | -     | -                | 1,685,581,217.21  |
| 应付管理人报酬                        | -                | -                | -                 | -     | -     | 14,200,551.33    | 14,200,551.33     |

|         |                  |                  |                   |   |   |                |                   |
|---------|------------------|------------------|-------------------|---|---|----------------|-------------------|
| 应付托管费   | -                | -                | -                 | - | - | 2,408,090.25   | 2,408,090.25      |
| 应付销售服务费 | -                | -                | -                 | - | - | 2,344,745.09   | 2,344,745.09      |
| 应付交易费用  | -                | -                | -                 | - | - | 170,910.51     | 170,910.51        |
| 应交税费    | -                | -                | -                 | - | - | 12,808.45      | 12,808.45         |
| 应付利息    | -                | -                | -                 | - | - | 200,929.60     | 200,929.60        |
| 应付利润    | -                | -                | -                 | - | - | 24,518,700.25  | 24,518,700.25     |
| 其他负债    | -                | -                | -                 | - | - | 60,340.59      | 60,340.59         |
| 负债总计    | 1,685,581,217.21 | -                | -                 | - | - | 43,917,076.07  | 1,729,498,293.28  |
| 利率敏感度缺口 | 3,467,809,636.92 | 3,693,771,492.39 | 10,499,400,214.14 | - | - | -19,727,866.80 | 17,641,253.476.65 |

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动 |                             |                     |
|----|---------------------------|-----------------------------|---------------------|
| 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影响金额（单位：人民币元） |                     |
|    |                           | 本期末<br>2022年06月30日          | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|    | 基准利率点利率增加0.1%             | -7,827,349.73               | -5,976,826.45       |
|    | 基准利率点利率减少0.1%             | 7,840,074.52                | 5,993,595.01        |

上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场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汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大的市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的

分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 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06月30日 |                          | 上年度末<br>2021年12月31日 |                          |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|               | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>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—债券投资  | 12,745,988,635.62  | 55.27                    | 16,768,557,830.30   | 95.05                    |
| 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            | 12,745,988,635.62  | 55.27                    | 16,768,557,830.30   | 95.05                    |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无

#### 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

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022年06月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | -                  | -                   |
| 第二层次          | 12,745,988,635.62  | 16,768,557,830.30   |
| 第三层次          | -                  | -                   |
| 合计            | 12,745,988,635.62  | 16,768,557,830.30   |

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期无公允价值所属层次间的重大变动。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期无非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金本报告期无不以公允价值计量的金融工具。

#### 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  | 固定收益投资   | 12,745,988,635.62 | 49.10         |
|    | 其中：债券    | 12,745,988,635.62 | 49.10         |
|    | 资产支持证券   | -                 | -             |
| 2  | 买入返售金融资产 | 8,476,140,210.38  | 32.65         |

|   |                   |                   |        |
|---|-------------------|-------------------|--------|
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                 | -      |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计      | 3,557,688,719.10  | 13.71  |
| 4 | 其他各项资产            | 1,178,416,423.04  | 4.54   |
| 5 | 合计                | 25,958,233,988.14 | 100.00 |

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值比例 (%)    |               |
|----|--------------|------------------|---------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 10.83            |               |
|    | 其中：买断式回购融资   | -                |               |
| 序号 | 项目           | 金额               | 占基金资产净值比例 (%) |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | 2,865,079,146.29 | 12.42         |
|    | 其中：买断式回购融资   | -                | -             |

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

注：本报告期内本基金不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的情况。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数  |
|-------------------|-----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 115 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 120 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 68  |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值的比例 (%) |
|----|--------|---------------------|---------------------|
|----|--------|---------------------|---------------------|

|    |                      |        |       |
|----|----------------------|--------|-------|
| 1  | 30天以内                | 60.82  | 12.42 |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -      | -     |
| 2  | 30天(含)—60天           | 4.67   | -     |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -      | -     |
| 3  | 60天(含)—90天           | -      | -     |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -      | -     |
| 4  | 90天(含)—120天          | 4.41   | -     |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -      | -     |
| 5  | 120天(含)—397天(含)      | 42.55  | -     |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -      | -     |
| 合计 |                      | 112.45 | 12.42 |

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注：本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

#### 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      | 19,978,907.39     | 0.09          |
| 2  | 央行票据      | -                 | -             |
| 3  | 金融债券      | 1,154,581,820.77  | 5.01          |
|    | 其中：政策性金融债 | 1,154,581,820.77  | 5.01          |
| 4  | 企业债券      | 185,590,674.49    | 0.80          |
| 5  | 企业短期融资券   | 272,414,114.78    | 1.18          |
| 6  | 中期票据      | -                 | -             |
| 7  | 同业存单      | 11,113,423,118.19 | 48.20         |



|    |                    |                   |       |
|----|--------------------|-------------------|-------|
| 8  | 其他                 | -                 | -     |
| 9  | 合计                 | 12,745,988,635.62 | 55.27 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | -                 | -     |

### 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 债券数量(张)   | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 112212075 | 22北京银行CD075   | 5,000,000 | 489,734,588.32 | 2.12         |
| 2  | 112213066 | 22浙商银行CD066   | 4,000,000 | 391,908,434.12 | 1.70         |
| 3  | 220201    | 22国开01        | 3,600,000 | 363,417,291.31 | 1.58         |
| 4  | 112281708 | 22厦门国际银行CD115 | 3,000,000 | 297,141,874.57 | 1.29         |
| 5  | 112297992 | 22中原银行CD096   | 3,000,000 | 294,010,151.29 | 1.28         |
| 6  | 112213069 | 22浙商银行CD069   | 3,000,000 | 293,946,911.86 | 1.27         |
| 7  | 112299006 | 22江西银行CD091   | 3,000,000 | 293,799,033.85 | 1.27         |
| 8  | 112298761 | 22杭州银行CD128   | 2,800,000 | 279,370,297.10 | 1.21         |
| 9  | 112291066 | 22厦门国际银行CD007 | 2,500,000 | 246,429,777.93 | 1.07         |
| 10 | 112297352 | 22昆仑银行CD015   | 2,500,000 | 244,936,048.46 | 1.06         |

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|----|------|
|----|------|

|                              |          |
|------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | 0        |
| 报告期内偏离度的最高值                  | 0.0966%  |
| 报告期内偏离度的最低值                  | -0.0095% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值       | 0.0421%  |

注：以上数据按工作日统计

### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注：本报告期内本基金不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注：本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为人民币 1.00 元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

7.9.2 本基金投资前十名证券的发行主体中，北京银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、昆仑银行股份有限公司、国家开发银行等受到中国银行保险监督管理委员会或地方银保监局、中国人民银行罚款的行政处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

#### 7.9.3 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 | 2,872.09         |
| 2  | 应收清算款 | 1,178,413,550.95 |
| 3  | 应收利息  | -                |

|   |       |                  |
|---|-------|------------------|
| 4 | 应收申购款 | -                |
| 5 | 其他应收款 | -                |
| 6 | 待摊费用  | -                |
| 7 | 其他    | -                |
| 8 | 合计    | 1,178,416,423.04 |

#### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

### § 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

| 持有人户数<br>(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             | 占总份额比例 | 持有份额              | 占总份额比例 |
| 207,159      | 111,311.96 | 2,120,633,023.64 | 9.20%  | 20,938,641,053.04 | 90.80% |

#### 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额(份)        | 占总份额比例 |
|----|-------|----------------|--------|
| 1  | 券商类机构 | 261,032,020.00 | 1.13%  |
| 2  | 券商类机构 | 150,553,421.24 | 0.65%  |
| 3  | 基金类机构 | 139,814,260.25 | 0.61%  |
| 4  | 基金类机构 | 104,151,272.08 | 0.45%  |
| 5  | 个人    | 83,760,133.95  | 0.36%  |
| 6  | 个人    | 75,762,959.20  | 0.33%  |
| 7  | 个人    | 68,661,219.50  | 0.30%  |
| 8  | 基金类机构 | 66,522,086.85  | 0.29%  |
| 9  | 其他机构  | 65,403,562.22  | 0.28%  |

|    |    |               |       |
|----|----|---------------|-------|
| 10 | 个人 | 64,731,385.92 | 0.28% |
|----|----|---------------|-------|

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员（包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理）均未持有本基金份额。

### 8.4 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情况

| 项目                             | 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 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                    |
|----------------------------|--------------------|
| 基金合同生效日(2021年12月03日)基金份额总额 | 19,129,811,430.73  |
| 本报告期期初基金份额总额               | 17,641,253,476.65  |
| 本报告期基金总申购份额                | 244,073,692,786.05 |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 238,655,672,186.02 |
| 本报告期期末基金份额总额               | 23,059,274,076.68  |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内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

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2022年1月17日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告》，谢乐斌同志担任公司董事长，江伟同志不再担任公司董事长。

2022年3月12日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于董事会成员变更事宜的公告》，谢乐斌同志担任公司董事和董事长，江伟同志不再担任

公司董事和董事长职务。陶耿同志担任公司董事和副董事长；王吉学、刘敬东、韩志达、王新宇同志担任公司董事，蒋忆明、喻健同志不再兼任公司董事职务。经过上述变更，公司现任董事会成员为谢乐斌、陶耿、王吉学、刘敬东、韩志达、王新宇。

2022年3月30日，本基金管理人发布了《关于上海国泰君安证券资产管理有限公司监事变更的公告》，董博阳同志担任公司监事，傅南平同志不再担任公司监事职务；王红莲同志担任公司职工监事。

2022年4月8日，本基金管理人发布了《上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告》，吕巍同志担任公司合规总监、督察长，叶明同志不再担任公司合规总监。

2、本报告期内，本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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期未发生投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期未改聘会计师事务所。

### 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

本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚情况。

### 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 |    |
| 国泰君安 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

### 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           |              | 债券回购交易        |                | 权证交易 |              | 基金交易 |              |
|------|----------------|--------------|---------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额          | 占当期债券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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 国泰君安 | 288,888,853.03 | 100.00%      | 74,830,465.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |

### 10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

注：本基金本报告期内无偏离度绝对值超过0.5%的情况。

### 10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                           | 法定披露方式                             | 法定披露日期     |
|----|--------------------------------|------------------------------------|------------|
| 1  | 关于调整旗下基金对账单服务规则的公告             | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网 | 2022-01-19 |
| 2  | 上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告   | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网 | 2022-01-19 |
| 3  | 关于国泰君安现金管家货币市场基金销售费率优惠活动的公告    | 证券时报、证监会指定网站、公司官网                  | 2022-01-27 |
| 4  | 关于国泰君安现金管家货币市场基金销售费率优惠活动的公告    | 证券时报、证监会指定网站、公司官网                  | 2022-02-28 |
| 5  | 上海国泰君安证券资产管理有限公司关于董事会成员变更事宜的公告 | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网 | 2022-03-12 |
| 6  | 国泰君安现金管家货币市场基金收益支付公告           | 证券时报、证监会指定网站、公司官网                  | 2022-03-22 |
| 7  | 关于上海国泰君安证券资产管理有限公司监事变更的公告      | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网 | 2022-03-30 |

|    |                                   |                                    |            |
|----|-----------------------------------|------------------------------------|------------|
| 8  | 关于国泰君安现金管家货币市场基金销售费率优惠活动的公告       | 证券时报、证监会指定网站、公司官网                  | 2022-03-31 |
| 9  | 上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告      | 上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报、证监会指定网站、公司官网 | 2022-04-08 |
| 10 | 国泰君安现金管家货币市场基金2022年第一季度报告         | 证监会指定网站、公司官网                       | 2022-04-22 |
| 11 | 上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分公募基金季度报告提示性公告 | 证券时报                               | 2022-04-22 |
| 12 | 关于国泰君安现金管家货币市场基金销售费率优惠活动的公告       | 证券时报、证监会指定网站、公司官网                  | 2022-04-29 |
| 13 | 国泰君安现金管家货币市场基金收益支付公告              | 证券时报、证监会指定网站、公司官网                  | 2022-06-22 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰君安现金管家货币集合资产管理计划变更注册的批复；
- 2、《国泰君安现金管家货币市场基金基金合同》；
- 3、《国泰君安现金管家货币市场基金托管协议》；
- 4、《国泰君安现金管家货币市场基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、法律意见书；

8、中国证监会要求的其他文件。

## 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站<http://www.gtjazg.com>。

## 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

上海国泰君安证券资产管理有限公司

二〇二二年八月三十一日