前海开源现金增利货币市场基金

2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：前海开源基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 01 月 22 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 01 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 2023 年 10 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	前海开源货币
基金主代码	001870
基金运作方式	契约型普通开放式
基金合同生效日	2015 年 09 月 29 日
报告期末基金份额总额	6,655,866,282.95 份
投资目标	在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金根据对未来短期利率变动的预测，确定和调整基金投资组合的平均剩余期限。对各类投资品种进行定性分析和定量分析，确定和调整参与的投资品种和各类投资品种的配置比例。在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。 1、资产配置策略 本基金通过对宏观经济形势、财政与货币政策、金融监管政策、短期资金市场状况等因素的分析，综合判断未来短期利率变动，评估各类投资品种的流动性和风险收益特征，确定各类投资品种的配置比例及期限组合，并适时进行动态调整。 2、利率预期策略 通过对通货膨胀、GDP、货币供应量、国际利率水平、金融监管政策取向等跟踪分析，形成对基本面的宏观研判。同时，结合微观层面研究，主要考察指标包括：央行公开市场操作、主要机构投资者的短期投资倾向、债券供给、回购抵押数量等，合理预期

	货币市场利率曲线动态变化，动态配置货币资产。 3、期限配置策略 根据利率预期分析，动态确定并控制投资组合平均剩余期限在 120 天以内。当市场利率看涨时，适度缩短投资组合平均剩余期限，即减持剩余期限较长投资品种增持剩余期限较短品种，降低组合整体净值损失风险；当市场看跌时，则相对延长投资组合平均剩余期限，增持较长剩余期限的投资品种，获取超额收益。 4、流动性管理策略 本基金作为现金管理工具，必须具备较高的流动性。基金管理人在密切关注基金的申购赎回情况、季节性资金流动情况和日历效应等因素基础上，对投资组合的现金比例进行优化管理。基金管理人将在遵循流动性优先的原则下，综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例，通过现金留存、持有高流动性券种、正向回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性，以满足日常的基金资产变现需求。 5、收益增强策略 通过分析各类投资品种的相对收益、利差变化、市场容量、信用等级情况、流动性风险、信用风险等因素来确定配置比例和期限组合，寻找具有投资价值的投资品种，增持相对低估、价格将上升的，能给组合带来相对较高回报的类属；减持相对高估、价格将下降的，给组合带来相对较低回报的类属，借以取得较高的总回报。		
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）。		
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。		
基金管理人	前海开源基金管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	前海开源货币 A	前海开源货币 B	前海开源货币 E
下属分级基金的交易代码	001870	001871	004210
报告期末下属分级基金的份额总额	60,506,250.20 份	6,532,532,569.72 份	62,827,463.03 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（2023 年 10 月 01 日-2023 年 12 月 31 日）		
	前海开源货币 A	前海开源货币 B	前海开源货币 E
1.本期已实现收益	271,624.59	42,090,704.09	190,562.58

2.本期利润	271,624.59	42,090,704.09	190,562.58
3.期末基金资产净值	60,506,250.20	6,532,532,569.72	62,827,463.03

注：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

前海开源货币 A

阶段	净值收益率①	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
过去三个月	0.4913%	0.0038%	0.3450%	0.0000%	0.1463%	0.0038%
过去六个月	0.9098%	0.0038%	0.6900%	0.0000%	0.2198%	0.0038%
过去一年	1.8188%	0.0031%	1.3688%	0.0000%	0.4500%	0.0031%
过去三年	5.5289%	0.0026%	4.1063%	0.0000%	1.4226%	0.0026%
过去五年	10.0361%	0.0025%	6.8475%	0.0000%	3.1886%	0.0025%
自基金合同生效起至今	21.4037%	0.0030%	11.3100%	0.0000%	10.0937%	0.0030%

前海开源货币 B

阶段	净值收益率①	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
过去三个月	0.5523%	0.0038%	0.3450%	0.0000%	0.2073%	0.0038%
过去六个月	1.0320%	0.0038%	0.6900%	0.0000%	0.3420%	0.0038%
过去一年	2.0635%	0.0031%	1.3688%	0.0000%	0.6947%	0.0031%
过去三年	6.2922%	0.0026%	4.1063%	0.0000%	2.1859%	0.0026%
过去五年	11.3652%	0.0025%	6.8475%	0.0000%	4.5177%	0.0025%
自基金合同生效起至今	23.8361%	0.0030%	11.3100%	0.0000%	12.5261%	0.0030%

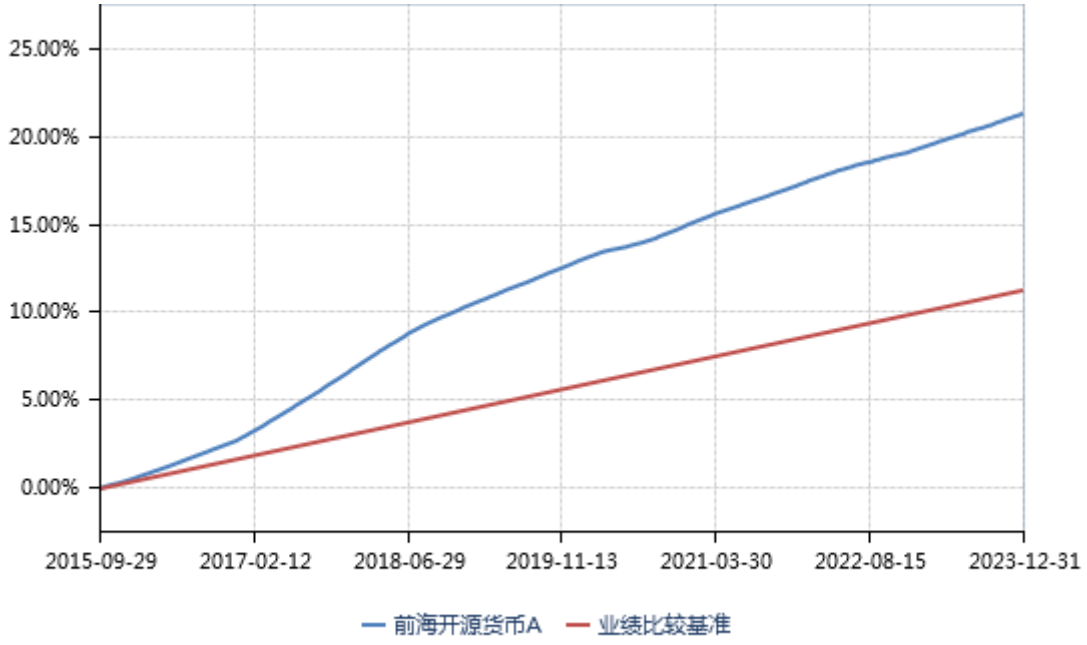
前海开源货币 E

阶段	净值收益率①	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
过去三个月	0.4917%	0.0038%	0.3450%	0.0000%	0.1467%	0.0038%
过去六个月	0.9082%	0.0038%	0.6900%	0.0000%	0.2182%	0.0038%
过去一年	1.8193%	0.0031%	1.3688%	0.0000%	0.4505%	0.0031%

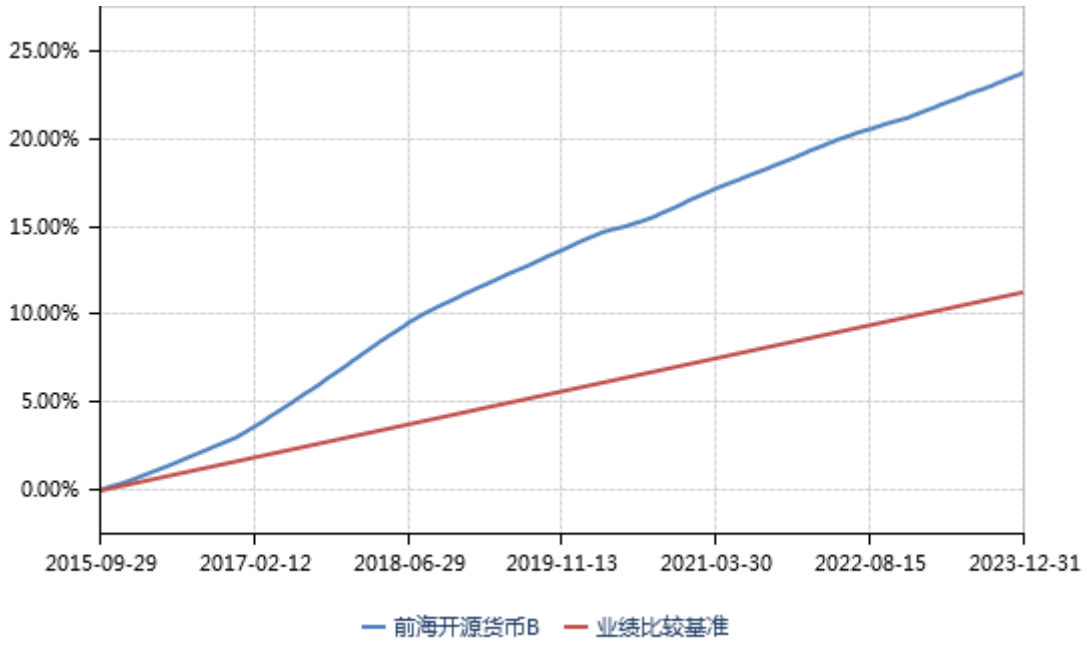
过去三年	5.5252%	0.0026%	4.1063%	0.0000%	1.4189%	0.0026%
过去五年	10.0285%	0.0025%	6.8475%	0.0000%	3.1810%	0.0025%
自基金合同生效起至今	17.8651%	0.0032%	9.5288%	0.0000%	8.3363%	0.0032%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

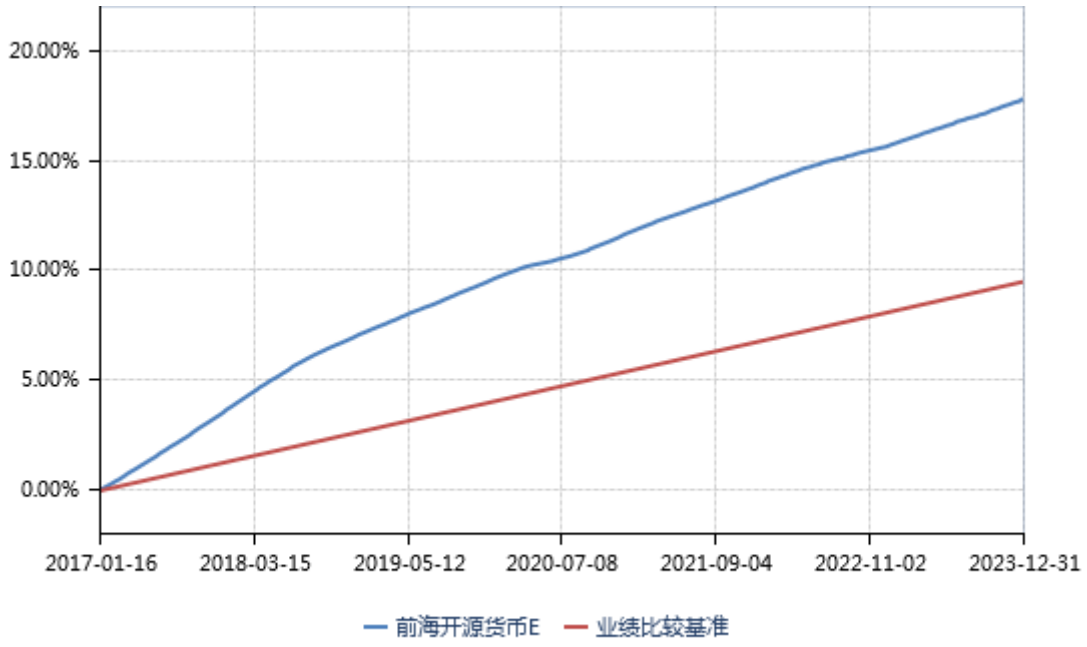
前海开源货币 A



前海开源货币 B



前海开源货币 E



注：本基金自 2017 年 1 月 13 日起，增加 E 类基金份额并设置对应基金代码；2017 年 1 月 13 日、2017 年 1 月 14 日、2017 年 1 月 15 日 E 类基金份额为零。前海开源货币 E 基金份额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起始日为 2017 年 1 月 16 日。

§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		
刘静	本基金的基金经理、公司董事总经理	2015 年 09 月 29 日	-	21 年	刘静女士，中央财经大学硕士。历任长盛基金管理有限公司债券高级交易员、基金经理助理、长盛货币市场基金基金经理、长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛积极配置债券投资基金基金经理；2014 年 1 月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司董事总经理、基金经理。
林悦	本基金的基金经理	2019 年 07 月 29 日	-	9 年	林悦先生，厦门大学硕士。2014 年至 2016 年任汇添富基金管理股份有限公司投资研究总部债券交易员；2016 年 9 月加盟前海开源基金管理有限公司，现任公司基金经理。

注：①对基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的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没有超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本报告期内，流动性、政策预期、机构行为是主导债券走势的关键因素。具体来看：10 月份，由于特殊再融资债大量发行，银行配债资金被挤占，市场对政策刺激预期进一步升温，收益率上行，曲线快速扁平化，10 月底因特殊再融资债发行告一段落，国债增发落地，政策刺激预期兑现，资金面阶段性转松，收益率见顶回落，曲线陡峭化。11 月，由于增发国债大量发行，曲线再度平坦化，而由于资本新规落地后市场对二级资本债的担忧下降，长久期二级资本债表现强势。11 月下旬因地产刺激预期升温，债市出现了一轮调整，但 12 月上旬强势品种很快修复失地。12 月中旬后，因没有超预期的刺激政策，存款利率下调后降息预期升温，且临近年末机构抢跑，债市大涨，前期强势品种收益率快速下行后，在跨年资金面快速转松的带动下，前期弱势的中短端品种快速补涨。整个 4 季度来看，长久期二级资本债表现最佳，长久期利率债亦有较好的表现，而中短久期利率债则表现较弱。

四季度，债券市场收益率呈现先震荡，后快速下行的态势。10 年期国债到期收益率由 9 月底的 2.68%上行至 10 月底的 2.72%，11 月初一度回落至 2.64%后又再度在 11 月底上行至 2.71%。随后一路震荡下行至 12 月底的 2.56%。3 个月和 1 年期的存单受银行负债压力和资金面收紧的影响，分别从 9 月底的 2.33%和 2.44%一路上行至 12 月中旬的 2.74%和 2.67%，后在资金面改善的作用下快速回到了 2.14%和 2.4%。

本基金四季度延续了对资金面谨慎的态度。整个报告期内，组合平均剩余期限大部分时间保持在较低水平，并保持良好的流动性。12 月中旬开始组合对流动性判断逐渐乐观，开始逐步配置 3 个月的存单、存款，以提高组合静态收益。整个报告期内，本产品保持较好的流动性，以持有高等级高流动性存单为主，严格控制信用风险和流动性风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末前海开源货币 A 基金份额净值为 1.000 元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为

0.4913%，同期业绩比较基准收益率为 0.3450%；截至报告期末前海开源货币 B 基金份额净值为 1.000 元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为 0.5523%，同期业绩比较基准收益率为 0.3450%；截至报告期末前海开源货币 E 基金份额净值为 1.000 元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为 0.4917%，同期业绩比较基准收益率为 0.3450%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内，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或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	固定收益投资	3,637,383,172.41	52.76
	其中：债券	3,635,382,764.74	52.73
	资产支持证券	2,000,407.67	0.03
2	买入返售金融资产	1,735,319,024.39	25.17
	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	1,103,165,922.92	16.00
4	其他资产	418,834,721.90	6.07
5	合计	6,894,702,841.62	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	2.36	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	216,112,244.58	3.25
	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

无。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	55
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	58
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	12

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

无。

5.3.2 报告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	28.97	3.55
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	16.41	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	45.79	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	5.35	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	0.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		97.30	3.55

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

无。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	27,373,241.02	0.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	317,176,880.89	4.77
	其中：政策性金融债	317,176,880.89	4.77

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	313,537,113.82	4.71
6	中期票据	61,781,300.18	0.93
7	同业存单	2,915,514,228.83	43.80
8	其他	-	-
9	合计	3,635,382,764.74	54.62
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112317089	23 光大银行 CD089	3,000,000	298,479,512.39	4.48
2	112315483	23 民生银行 CD483	2,000,000	199,140,387.21	2.99
3	112309246	23 浦发银行 CD246	2,000,000	198,771,692.18	2.99
4	112388418	23 北京农商银行 CD197	1,500,000	149,841,338.78	2.25
5	112311023	23 平安银行 CD023	1,500,000	149,473,190.24	2.25
6	230201	23 国开 01	1,000,000	102,007,904.08	1.53
7	012381852	23 国电 SCP003	1,000,000	101,420,572.10	1.52
8	112384556	23 成都银行 CD171	1,000,000	99,705,877.25	1.50
9	112385995	23 徽商银行 CD134	1,000,000	99,647,014.01	1.50
10	112311158	23 平安银行 CD158	1,000,000	99,601,329.60	1.50

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”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	0.0355%
报告期内偏离度的最低值	0.0033%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0151%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

无。

5.8 报告期末按摊余成本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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	261567	京诚 112A	20,000	2,000,407.67	0.03

注：本基金本报告期末仅持有以上资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用"摊余成本法"计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定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。

5.9.2 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	17,290.06
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	418,817,431.84
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	418,834,721.90

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	前海开源货币 A	前海开源货币 B	前海开源货币 E
报告期期初基金份额总额	78,745,802.88	10,510,570,333.30	45,060,943.00
报告期期间基金总申购份额	122,041,803.70	29,465,447,263.15	53,275,730.01
减：报告期期间基金总赎回份额	140,281,356.38	33,443,485,026.73	35,509,209.98
报告期期末基金份额总额	60,506,250.20	6,532,532,569.72	62,827,463.03

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2023 年 10 月 17 日	40,000,000.00	40,000,000.00	0.0000
2	红利再投	2023 年 10 月 18 日	1,499.66	1,499.66	0.0000
3	红利再投	2023 年 10 月 19 日	2,034.92	2,034.92	0.0000
4	红利再投	2023 年 10 月 20 日	1,711.75	1,711.75	0.0000
5	红利再投	2023 年 10 月 23 日	5,339.98	5,339.98	0.0000
6	红利再投	2023 年 10 月 24 日	2,504.68	2,504.68	0.0000
7	红利再投	2023 年 10 月 25 日	3,765.37	3,765.37	0.0000
8	红利再投	2023 年 10 月 26 日	2,064.19	2,064.19	0.0000
9	红利再投	2023 年 10 月 27 日	1,683.76	1,683.76	0.0000
10	红利再投	2023 年 10 月 30 日	6,342.88	6,342.88	0.0000
11	红利再投	2023 年 10 月 31 日	1,701.65	1,701.65	0.0000
12	红利再投	2023 年 11 月 01 日	8,912.03	8,912.03	0.0000
13	红利再投	2023 年 11 月 02 日	1,949.76	1,949.76	0.0000
14	红利再投	2023 年 11 月 03 日	1,784.06	1,784.06	0.0000
15	红利再投	2023 年 11 月 06 日	4,779.18	4,779.18	0.0000
16	红利再投	2023 年 11 月 07 日	1,532.97	1,532.97	0.0000
17	红利再投	2023 年 11 月 08 日	5,289.18	5,289.18	0.0000
18	红利再投	2023 年 11 月 09 日	1,821.87	1,821.87	0.0000
19	红利再投	2023 年 11 月 10 日	1,750.99	1,750.99	0.0000
20	红利再投	2023 年 11 月 13 日	5,144.21	5,144.21	0.0000
21	红利再投	2023 年 11 月 14 日	1,740.50	1,740.50	0.0000
22	红利再投	2023 年 11 月 15 日	2,687.06	2,687.06	0.0000
23	红利再投	2023 年 11 月 16 日	2,425.45	2,425.45	0.0000
24	红利再投	2023 年 11 月 17 日	1,738.11	1,738.11	0.0000
25	红利再投	2023 年 11 月 20 日	5,996.61	5,996.61	0.0000
26	红利再投	2023 年 11 月 21 日	1,801.89	1,801.89	0.0000

27	红利再投	2023 年 11 月 22 日	2,634.51	2,634.51	0.0000
28	红利再投	2023 年 11 月 23 日	2,567.50	2,567.50	0.0000
29	红利再投	2023 年 11 月 24 日	1,805.33	1,805.33	0.0000
30	红利再投	2023 年 11 月 27 日	6,096.07	6,096.07	0.0000
31	红利再投	2023 年 11 月 28 日	1,832.71	1,832.71	0.0000
32	红利再投	2023 年 11 月 29 日	3,038.23	3,038.23	0.0000
33	红利再投	2023 年 11 月 30 日	1,952.36	1,952.36	0.0000
34	红利再投	2023 年 12 月 01 日	6,241.13	6,241.13	0.0000
35	红利再投	2023 年 12 月 04 日	6,322.86	6,322.86	0.0000
36	红利再投	2023 年 12 月 05 日	1,961.29	1,961.29	0.0000
37	红利再投	2023 年 12 月 06 日	1,808.17	1,808.17	0.0000
38	红利再投	2023 年 12 月 07 日	1,388.86	1,388.86	0.0000
39	红利再投	2023 年 12 月 08 日	2,444.07	2,444.07	0.0000
40	红利再投	2023 年 12 月 11 日	5,172.63	5,172.63	0.0000
41	红利再投	2023 年 12 月 12 日	2,527.74	2,527.74	0.0000
42	红利再投	2023 年 12 月 13 日	1,572.78	1,572.78	0.0000
43	红利再投	2023 年 12 月 14 日	1,530.22	1,530.22	0.0000
44	红利再投	2023 年 12 月 15 日	1,567.94	1,567.94	0.0000
45	红利再投	2023 年 12 月 18 日	4,844.52	4,844.52	0.0000
46	红利再投	2023 年 12 月 19 日	2,980.32	2,980.32	0.0000
47	红利再投	2023 年 12 月 20 日	1,795.09	1,795.09	0.0000
48	红利再投	2023 年 12 月 21 日	1,318.91	1,318.91	0.0000
49	红利再投	2023 年 12 月 22 日	1,427.52	1,427.52	0.0000
50	红利再投	2023 年 12 月 25 日	6,259.31	6,259.31	0.0000
51	红利再投	2023 年 12 月 26 日	11,974.13	11,974.13	0.0000
52	红利再投	2023 年 12 月 27 日	6,580.18	6,580.18	0.0000
53	红利再投	2023 年 12 月 28 日	2,833.24	2,833.24	0.0000
54	红利再投	2023 年 12 月 29 日	3,910.79	3,910.79	0.0000
55	红利再投	2023 年 12 月 30 日	2,860.62	2,860.62	0.0000
56	红利再投	2023 年 12 月 31 日	2,420.10	2,420.10	0.0000
合计			40,179,671.84	40,179,671.84	

§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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况

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	20231026-20231030	205,409,019.91	1,502,016,411.41	1,707,425,431.32	-	-
	2	20231031-20231101,20231129-20231204,20231225-20231227	815,140,545.38	4,632,231.00	-	819,772,776.38	12.32%
产品特有风险							
1. 巨额赎回风险 （1）本基金单一投资者所持有的基金份额占比较大，单一投资者的巨额赎回，可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，对本基金的投资运作及净值表现产生较大影响； （2）单一投资者大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定延缓支付赎回款项、部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务的办理； 2. 转换运作方式或终止基金合同的风险 个别投资者大额赎回后，若本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决，其他投资者可能面临相应风险； 3.流动性风险 单一投资者巨额赎回可能导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险； 4.巨额赎回可能导致基金资产规模过小，导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（1）中国证券监督管理委员会批准前海开源现金增利货币市场基金设立的文件

（2）《前海开源现金增利货币市场基金基金合同》

（3）《前海开源现金增利货币市场基金托管协议》

（4）基金管理人业务资格批件、营业执照

（5）前海开源现金增利货币市场基金在指定报刊上各项公告的原稿

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

9.3 查阅方式

（1）投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

（2）投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人前海开源基金管理有限公司，客户服务电话：4001-666-998

（3）投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.qhkyfund.com

前海开源基金管理有限公司

2024 年 01 月 22 日