

国泰利是宝货币市场基金

2022 年中期报告

2022 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

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独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2022 年 8 月 26 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 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 |
| 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..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明..... | 14 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 14 |
| 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..... | 15 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 15 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| 5 托管人报告 | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 17 |
| 6.1 资产负债表..... | 17 |
| 6.2 利润表..... | 18 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表..... | 19 |
| 6.4 报表附注..... | 21 |
| 7 投资组合报告 | 47 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 47 |
| 7.2 债券回购融资情况..... | 48 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限 | 48 |
| 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..... | 49 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 49 |
| 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..... | 50 |
| 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..... | 50 |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 | 53 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 53 |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况..... | 54 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 54 |
| 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的情况..... | 54 |

| | |
|---------------------------------------|----|
| 9 开放式基金份额变动 | 54 |
| 10 重大事件揭示 | 54 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 54 |
| 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..... | 54 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 55 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 55 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 55 |
| 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..... | 55 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 55 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况..... | 56 |
| 10.9 其他重大事件..... | 56 |
| 11 备查文件目录 | 56 |
| 11.1 备查文件目录..... | 56 |
| 11.2 存放地点..... | 56 |
| 11.3 查阅方式..... | 56 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|----------------------|
| 基金名称 | 国泰利是宝货币市场基金 |
| 基金简称 | 国泰利是宝货币 |
| 基金主代码 | 003515 |
| 交易代码 | 003515 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 12 月 22 日 |
| 基金管理人 | 国泰基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 129,667,497,147.48 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。 本基金主要投资策略包括：1、滚动配置策略；2、久期控制策略；3、套利策略；4、时机选择策略；5、逆回购策略；6、资产支持证券投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 同期七天通知存款利率（税后） |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场证券投资基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。 |

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 | | 国泰基金管理有限公司 | 兴业银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 刘国华 | 李真 |
| | 联系电话 | 021-31081600转 | 021-52629999-212051 |
| | 电子邮箱 | xinxipilu@gtfund.com | tgb_lizhen@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | | (021)31089000, 400-888-8688 | 95561 |
| 传真 | | 021-31081800 | 021-62159217 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室 | 福建省福州市台江区江滨中大 道398号兴业银行大厦 |
| 办公地址 | | 上海市虹口区公平路18号8号 | 上海市银城路167号兴业大厦4 |

| | | |
|-------|--------------|--------|
| | 楼嘉昱大厦16层-19层 | 楼 |
| 邮政编码 | 200082 | 200120 |
| 法定代表人 | 邱军 | 吕家进 |

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 | http://www.gtfund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层和本基金托管人住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------------|-----------------------------------|
| 注册登记机构 | 国泰基金管理有限公司注册登记中心 | 上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层 |

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（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 1,256,832,609.00 |
| 本期利润 | 1,256,832,609.00 |
| 本期净值收益率 | 0.9512% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 期末基金资产净值 | 129,667,497,147.48 |
| 期末基金份额净值 | 1.000 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 累计净值收益率 | 16.0519% |

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)本基金为货币市场基金，由于公允价值变动收益为零，故本期已实现收益和本期利润的金额相等。

(4)本基金收益分配按日结转份额。

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

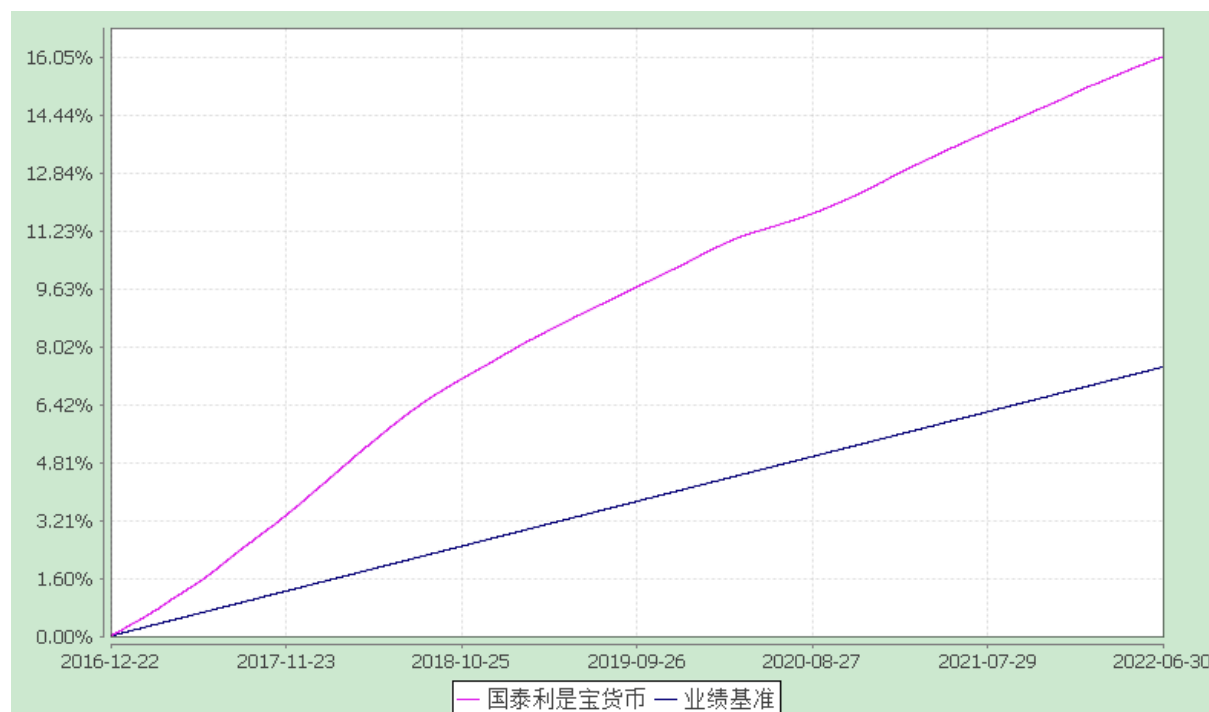
| 阶段 | 份额净值收 益率① | 份额净值收 益率标准差 ② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|---------|---------|
| 过去一个月 | 0.1415% | 0.0007% | 0.1110% | 0.0000% | 0.0305% | 0.0007% |
| 过去三个月 | 0.4558% | 0.0005% | 0.3366% | 0.0000% | 0.1192% | 0.0005% |
| 过去六个月 | 0.9512% | 0.0006% | 0.6695% | 0.0000% | 0.2817% | 0.0006% |
| 过去一年 | 1.9951% | 0.0005% | 1.3500% | 0.0000% | 0.6451% | 0.0005% |
| 过去三年 | 6.4199% | 0.0009% | 4.0500% | 0.0000% | 2.3699% | 0.0009% |
| 自基金合同生效 起至今 | 16.0519% | 0.0023% | 7.4563% | 0.0000% | 8.5956% | 0.0023% |

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

国泰利是宝货币市场基金

自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016 年 12 月 22 日至 2022 年 6 月 30 日)



注：本基金合同生效日为 2016 年 12 月 22 日。本基金在 6 个月建仓结束时，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

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 220 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长灵活配置混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、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）、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰灵活配置混合型证券投资基金（由国泰金泰平衡混合型证券投资基金变更注册而来，国泰金泰平衡混合型证券投资基金由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型证券投资基金（由国泰民安增利债券型发起式证券投资基金变更注册而来）、国证房地产行业指数证券投资基金（由国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数证券投资基金（由国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来）、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康定期支付混合型证券投资基金（由国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金更名而来）、国泰金鑫股票型证券投资基金（由

金鑫证券投资基金转型而来)、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数证券投资基金(由国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来)、国泰国证有色金属行业指数证券投资基金(由国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金终止分级运作变更而来)、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联接基金、国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(由国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来)、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金(LOF)(由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来,国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来)、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金(LOF)、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰润利纯债债券型证券投资基金、国泰润泰纯债债券型证券投资基金、国泰融信灵活配置混合型证券投资基金(LOF)(由国泰融信定增灵活配置混合型证券投资基金转换而来)、国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证航天军工指数证券投资基金(LOF)、国泰中证申万证券行业指数证券投资基金(LOF)、国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金(由国泰保本混合型证券投资基金变更而来)、国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金、国泰大农业股票型证券投资基金、国泰智能装备股票型证券投资基金、国泰融安多策略灵活配置混合型证券投资基金、国泰智能汽车股票型证券投资基金、上证 10 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰民安增益纯债债券型证券投资基金(由国泰民安增益定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来)、国泰聚优价值灵活配置混合型证券投资基金、国泰可转债债券型证券投资基金、国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金、国泰江源优势精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰聚利价值定期开放灵活配置混合型证券投资基金、国泰量化成长优选混合型证券投资基金、国泰优势行业混合型证券投资基金、国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金、国泰瑞和纯债债券型证券投资基金、国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金、国泰恒生港股通指数证券投资基金(LOF)、国泰聚禾纯债债券型证券投资基金、国泰丰祺纯债债券型证券投资基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金、国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金(由国泰新目标收益保本混合型证券投资基金变更而来)、国泰聚享纯债债券型证券投资基金、国泰丰盈纯债债券型证券投资基金、国泰量化策略收益混合型证券投资基金(由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来,国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来)、国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基

金（由国泰鑫保本混合型证券投资基金变更而来）、国泰价值优选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（由国泰价值优选灵活配置混合型证券投资基金转换而来）、国泰金鹿混合型证券投资基金（由国泰金鹿保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰消费优选股票型证券投资基金、国泰惠盈纯债债券型证券投资基金、国泰润鑫定期开放债券型发起式证券投资基金（由国泰润鑫纯债债券型证券投资基金变更注册而来）、国泰惠富纯债债券型证券投资基金、国泰农惠定期开放债券型证券投资基金、国泰信利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰民福策略价值灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民福保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金（由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金转型而来）、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰中证生物医药交易型开放式指数证券投资基金、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金更名而来）、国泰中证 500 指数增强型证券投资基金（由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册而来）、国泰瑞安三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰民安养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、国泰民利策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰民利保本混合型证券投资基金保本期到期变更而来）、国泰兴富三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠丰纯债债券型证券投资基金、国泰惠融纯债债券型证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金、国泰裕祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰丰鑫纯债债券型证券投资基金、国泰盛合三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰惠信三年定期开放债券型证券投资基金、国泰鑫睿混合型证券投资基金、国泰 CES 半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（由国泰 CES 半导体行业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更名而来）、国泰惠享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰添瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰研究精选两年持有期混合型证券投资基金、国泰聚盈三年定期开放债券型证券投资基金、国泰合融纯债债券型证券投资基金、国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证煤炭交易型开放式指数证券投资基金、国泰鑫利一年持有期混合型证券投资基金、国泰中证钢铁交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金、国泰蓝筹精选混合型证券投资基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰聚鑫纯债债券型证券投资基金、国泰聚

瑞纯债债券型证券投资基金、国泰大制造两年持有期混合型证券投资基金、国泰惠泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰宏益一年持有期混合型证券投资基金、国泰民泽平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、国泰致远优势混合型证券投资基金、国泰添福一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰浩益混合型证券投资基金（原国泰浩益 18 个月封闭运作混合型证券投资基金）、国泰惠瑞一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰医药健康股票型证券投资基金、国泰中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、国泰研究优势混合型证券投资基金、国泰民裕进取灵活配置混合型证券投资基金、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金（由国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型而来）、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金、国泰金福三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、国泰上证综合交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰合益混合型证券投资基金、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金、国泰通利 9 个月持有期混合型证券投资基金、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、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、国泰价值先锋股票型证券投资基金、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金、国泰成长价值混合型证券投资基金、国泰中证细分机械设备产业主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金、国泰同益 18 个月持有期混合型证券投资基金、国泰诚益混合型证券投资基金、国泰鑫享稳健 6 个月滚动持有债券型证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰核心价值两年持有期股票型证券投资基金、国泰中证环保产业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证细分机械设备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、国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金、国泰佳益混合型证券投资基金、国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、国泰中证医疗交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指软件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、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、国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰瑞泰纯债债券型证券投资基金、国泰中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证 800 汽车与零部件交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证全指建筑材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国

泰利泽 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、国泰中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰价值领航股票型证券投资基金、国泰价值远见两年封闭运作混合型证券投资基金、国泰中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、国泰兴泽优选一年持有期混合型证券投资基金、国泰中证影视主题交易型开放式指数证券投资基金、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、国泰中证 500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰惠元混合型证券投资基金、国泰中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、国泰景气优选混合型证券投资基金、国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、国泰中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、国泰睿元一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国泰富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金、国泰瑞鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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、国泰优选领航一年持有期混合型基金中基金（FOF）、国泰中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、国泰致和两年封闭运作混合型证券投资基金、国泰中证基建交易型开放式指数证券投资基金、国泰瑞丰纯债债券型证券投资基金、国泰中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、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、国泰科创板两年定期开放混合型证券投资基金、国泰中证沪港深动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、国泰睿毅三年持有期混合型证券投资基金、国泰标普 500 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、国泰中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、国泰中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 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 | | |
| 丁士恒 | 国泰利是宝货币、国泰惠鑫 | 2020-05-15 | - | 8 年 | 硕士研究生。2014 年 1 月加入国泰基金，任交易员。2020 年 5 月起任国泰货币市场证券投资基 |

| | | | | | |
|----|--|------------|---|------|--|
| | 一年定期 开放债 券、国泰 货币、国 泰现金管 理货币、 国泰瞬利 货币 ETF、国 泰利享中 短债债券 的基金经 理 | | | | 金、国泰现金管理货币市场基金、 国泰利是宝货币市场基金、国泰 瞬利交易型货币市场基金、国泰 利享中短债债券型证券投资基金 和国泰惠鑫一年定期开放债券型 发起式证券投资基金的基金经 理。 |
| 陶然 | 国泰利是 宝货币、 国泰货 币、国泰 现金管理 货币、国 泰瞬利货 币 ETF、 国泰利享 中短债债 券、国泰 利优 30 天滚动持 有短债债 券、国泰 利泽 90 天滚动持 有中短债 债券、国 泰中证同 业存单 AAA 指 数 7 天持 有期的基 金经理 | 2020-07-07 | - | 11 年 | 硕士研究生，CFA。曾任职于海富 通基金管理有限公司、华安基金 管理有限公司、汇添富基金管理 股份有限公司。2020 年 3 月加入 国泰基金，拟任基金经理。2020 年 7 月至 2022 年 8 月任国泰惠鑫 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 7 月起任国泰货币市场证券投资基 金、国泰现金管理货币市场基金、 国泰利是宝货币市场基金、国泰 瞬利交易型货币市场基金和国泰 利享中短债债券型证券投资基 金的基金经理，2021 年 6 月起兼任 国泰利优 30 天滚动持有短债债券 型证券投资基金的基金经理， 2021 年 8 月起兼任国泰利泽 90 天 滚动持有中短债债券型证券投资 基金的基金经理，2022 年 5 月起 兼任国泰中证同业存单 AAA 指 数 7 天持有期证券投资基金的基 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，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 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，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，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。

（一）本基金管理人管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同向交易记录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值都在 1%数量级及以下，且大多数溢价率均值都可以通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

（二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 ≥ 30 ），溢价率均值普遍在 1%数量级及以下。为稳妥起见，对于溢价率均值过大的基金或组合配对，我们也进行了模拟溢价金额计算。

（三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，基金经理也对价差作出了解释，公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

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 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

2022 年上半年债市整体呈现窄幅震荡走势。一月，央行下调 7 天逆回购和 1 年期 MLF 利率 10BP，宽货币态度明显，降准降息预期升温，收益率快速下行；二月，信贷和社融数据超预期，叠加部分城市因城施策，推出房地产优惠政策，而月中的降准降息落空，收益率自低位反弹；三月两会召开后，全年增长目标明确，债市交易逻辑转向稳增长，中下旬上海、吉林等多地疫情散发，债市担忧稳增长面临挑战，收益率窄幅震荡。四月，上海疫情爆发，经济活动受到明显制约，央行通过降准和上缴利润加码宽松，货币市场资金利率大幅度下行，因市场期待的降息落空，且担忧月底政治局会议出台稳增长政策，债市小幅度调整；五月，上海复工复产进度低于预期，北京疫情加重，稳增长措施受多重因素约束未能见效，市场对经济预期较为悲观，债市收益率下行；六月，上海宣布复工复产，北京疫情解除，经济转入疫后修复，市场风险偏好抬升，债市收益率温和上行。上半年资金面合理充裕，资金价格整体处于较低水平，3M shibor 利率在低位窄幅波动。

操作上，本基金采取相对灵活的投资策略，将组合剩余期限维持在合理区间，适当提升组合杠杆水平，维持组合信用持仓的高评级策略，规避信用风险暴露。同时，主动把握短期利率震荡的机会，在控制组合风险的前提下为持有人获取稳定回报。

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 0.9512%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，全国疫情控制良好，防疫政策根据形势逐步放松，稳增长政策持续发力，疫后复苏态势延续，但疫情长尾效应仍会制约修复斜率，稳增长、稳就业的压力依然较大，预计货币政策将为经济稳增长保驾护航，流动性将继续维持在合理充裕水平。

我们将在密切跟踪基本面、政策面和资金面的前提下，做好各类别资产配置以及比例的动态调整。同时，严防信用风险，规避高风险主体。组合将延续积极的投资策略，为持有人在管理好流动性的前提下获取持续稳定的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员

会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金利润分配按日结转份额。本基金管理人已根据本基金基金合同和相关法律法规的规定对分配利润进行了分配。

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

无。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国泰利是宝货币市场基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资 产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 49,526,735,757.55 | 59,141,422,734.86 |
| 结算备付金 | | 132,164,710.56 | 507,727,301.81 |
| 存出保证金 | | - | 2,407.53 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 52,481,295,034.65 | 44,913,082,181.64 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 52,481,295,034.65 | 44,913,082,181.64 |
| 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 | 35,412,289,304.18 | 37,233,157,538.95 |
| 应收清算款 | | 689,977,169.20 | 204,745,764.33 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 2,832,280.75 | 4,597,328.82 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | 125.00 | 341,405,028.37 |
| 资产总计 | | 138,245,294,381.89 | 142,346,140,286.31 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | | |
| 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 | | 8,504,354,877.31 | 9,429,006,096.35 |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 1,970.44 | - |
| 应付管理人报酬 | | 29,013,274.60 | 30,458,749.59 |
| 应付托管费 | | 5,372,828.62 | 5,640,509.17 |
| 应付销售服务费 | | 26,864,143.18 | 28,202,545.91 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 1,723,403.87 | 1,060,283.17 |

| | | | |
|-------------|---------|--------------------|--------------------|
| 应付利润 | | 9,211,059.22 | 9,051,567.78 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 1,255,677.17 | 5,553,063.14 |
| 负债合计 | | 8,577,797,234.41 | 9,508,972,815.11 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 129,667,497,147.48 | 132,837,167,471.20 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | - | - |
| 净资产合计 | | 129,667,497,147.48 | 132,837,167,471.20 |
| 负债和净资产总计 | | 138,245,294,381.89 | 142,346,140,286.31 |

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 129,667,497,147.48 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰利是宝货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 1,655,619,667.20 | 1,961,292,841.90 |
| 1.利息收入 | | 997,656,070.64 | 1,941,254,032.36 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 681,721,914.08 | 850,504,658.12 |
| 债券利息收入 | | - | 696,990,496.96 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | 2,064,844.74 |
| 买入返售金融资产收入 | | 315,934,156.56 | 391,694,032.54 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 657,963,596.56 | 20,038,479.54 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 657,963,596.56 | 20,038,479.54 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.14 | - | - |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.15 | - | 330.00 |

| | | | |
|----------------------------|----------|-------------------------|-------------------------|
| 减：二、营业总支出 | | 398,787,058.20 | 406,641,637.34 |
| 1. 管理人报酬 | | 177,697,754.30 | 186,613,518.29 |
| 2. 托管费 | | 32,906,991.57 | 34,558,059.03 |
| 3. 销售服务费 | | 164,534,957.71 | 172,790,294.65 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 22,379,528.81 | 12,081,987.13 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 22,379,528.81 | 12,081,987.13 |
| 6. 信用减值损失 | | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 1,066,457.32 | 390,397.44 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.16 | 201,368.49 | 207,380.80 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 1,256,832,609.00 | 1,554,651,204.56 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 1,256,832,609.00 | 1,554,651,204.56 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 1,256,832,609.00 | 1,554,651,204.56 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰利是宝货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | |
|-------------------------------------|---------------------------------------|------------------|--------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 132,837,167,471.20 | - | 132,837,167,471.20 |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 132,837,167,471.20 | - | 132,837,167,471.20 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -3,169,670,323.72 | - | -3,169,670,323.72 |
| （一）、综合收益总额 | - | 1,256,832,609.00 | 1,256,832,609.00 |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -3,169,670,323.72 | - | -3,169,670,323.72 |

| | | | |
|--|---------------------------------|-------------------|-----------------------|
| 其中：1.基金申购款 | 819,536,429,470.59 | - | 819,536,429,470.59 |
| 2.基金赎回款 | -822,706,099,794.31 | - | -822,706,099,794.31 |
| (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) | - | -1,256,832,609.00 | -1,256,832,609.00 |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 129,667,497,147.48 | - | 129,667,497,147.48 |
| 项目 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 121,777,948,304.95 | - | 121,777,948,304.95 |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 121,777,948,304.95 | - | 121,777,948,304.95 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 18,450,295,755.83 | - | 18,450,295,755.83 |
| (一)、综合收益总额 | - | 1,554,651,204.56 | 1,554,651,204.56 |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | 18,450,295,755.83 | - | 18,450,295,755.83 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,376,878,096,998.22 | - | 1,376,878,096,998.22 |
| 2.基金赎回款 | -1,358,427,801,242.39 | - | -1,358,427,801,242.39 |
| (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) | - | -1,554,651,204.56 | -1,554,651,204.56 |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 140,228,244,060.78 | - | 140,228,244,060.78 |

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：

基金管理人负责人：周向勇，主管会计工作负责人：倪葳，会计机构负责人：吴洪涛

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰利是宝货币市场基金(简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2278号《关于准予国泰利是宝货币市场基金注册的批复》准予注册，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰利是宝货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 200,017,220.16 元。业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1620 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰利是宝货币市场基金基金合同》于 2016 年 12 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,026,230.11 份基金份额，其中认购资金利息折合 9,009.95 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰利是宝货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行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：同期 7 天通知存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2022 年 8 月 26 日批准报出。

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》、《国泰利是宝货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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

本基金 2022 年半年度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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告不一致，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

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业务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业务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 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。

(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。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资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按票面利率或商定利率每日计提应收利息，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。

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净资产发生重大偏离，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。当影子价格确定的基金净资产与摊余成本法计算的基金净资产的偏离度绝对值达到或超过 0.25% 时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金净资产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债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(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。每份基金份额面值为 1.00 元。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 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

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债券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投资收益。

债券投资和资产支持证券投资处置时其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的则按直线法计算。

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。

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债券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其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的则按直线法计算。

6.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的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则按直线法计算。

6.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每日以红利再投资方式集中支付累计收益。

6.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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) 本基金的基金管理人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) 本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.12 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和资产支持证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，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

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。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 59,141,422,734.86 元、507,727,301.81 元、2,407.53 元、37,233,157,538.95 元、341,405,028.37 元、204,745,764.33 元和 4,597,328.82 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 59,286,780,409.45 元、507,978,626.84 元、2,408.74 元、37,246,895,326.03 元、0.00 元、204,745,764.33 元和 4,597,500.94 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 44,913,082,181.64 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 45,095,140,249.98 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付利润、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 9,429,006,096.35 元、30,458,749.59 元、5,640,509.17 元、28,202,545.91 元、9,051,567.78 元、981,069.28 元、4,271,185.23 元和 18,808.63 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付利润、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 9,433,277,281.58 元、30,458,749.59 元、5,640,509.17 元、28,202,545.91 元、9,051,567.78 元、981,069.28 元、0.00 元和 18,808.63 元。

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。

(b) 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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6月30日 |
|----------------|-------------------|
| 活期存款 | 18,344,148.13 |
| 等于：本金 | 18,310,951.61 |
| 加：应计利息 | 33,196.52 |
| 定期存款 | 49,508,391,609.42 |
| 等于：本金 | 49,300,000,000.00 |
| 加：应计利息 | 208,391,609.42 |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | 2,000,255,555.56 |
| 存款期限 1-3 个月 | 1,500,243,750.00 |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 存款期限 3 个月-1 年 | 46,007,892,303.86 |
| 存款期限 1 年以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 49,526,735,757.55 |

注：1. 定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

2. 本基金报告期内提前支取部分定期存款，根据约定，原定期存款利率不变，提前支取未造成利息损失。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2022年6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 | 41,007,453.13 | 41,033,479.4 | 26,026.32 | 0.0000 |

| | | | | | |
|--|--------|-------------------|-------------------|---------------|--------|
| | | | 5 | | |
| | 银行间市场 | 52,440,287,581.52 | 52,496,267,340.53 | 55,979,759.01 | 0.0432 |
| | 合计 | 52,481,295,034.65 | 52,537,300,819.98 | 56,005,785.33 | 0.0432 |
| | 资产支持证券 | - | - | - | - |
| | 合计 | 52,481,295,034.65 | 52,537,300,819.98 | 56,005,785.33 | 0.0432 |

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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 2022 年 6 月 30 日 | |
|-------|------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 8,647,482,909.12 | - |
| 银行间市场 | 26,764,806,395.06 | - |
| 合计 | 35,412,289,304.18 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|-------|------------------------|
| 应收利息 | - |
| 其他应收款 | - |
| 待摊费用 | - |
| 其他 | 125.00 |
| 合计 | 125.00 |

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

| | 2022 年 6 月 30 日 |
|-------------|-----------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 29.56 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 978,976.66 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 978,976.66 |
| 应付利息 | - |
| 其他应付款 | 12,292.00 |
| 预提费用 | 264,378.95 |
| 合计 | 1,255,677.17 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|---------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 132,837,167,471.20 | 132,837,167,471.20 |
| 本期申购 | 819,536,429,470.59 | 819,536,429,470.59 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -822,706,099,794.31 | -822,706,099,794.31 |
| 本期末 | 129,667,497,147.48 | 129,667,497,147.48 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

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 |
|----------------|-------------------|-------|-------------------|
| 上年度末 | - | - | - |
| 本期利润 | 1,256,832,609.00 | - | 1,256,832,609.00 |
| 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 | -1,256,832,609.00 | - | -1,256,832,609.00 |
| 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 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
| | 活期存款利息收入 |

| | |
|-----------|----------------|
| 定期存款利息收入 | 678,097,639.14 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 3,343,534.76 |
| 其他 | 2,987.14 |
| 合计 | 681,721,914.08 |

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 642,192,916.85 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 15,770,679.71 |
| 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 | 657,963,596.56 |

6.4.7.11.2 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1月1日至2022年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 115,756,585,063.60 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 115,136,768,625.83 |
| 减：应计利息总额 | 604,045,758.06 |
| 减：交易费用 | - |
| 买卖债券差价收入 | 15,770,679.71 |

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.14 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.15 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 审计费用 | 75,871.58 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 上清查询服务费 | 600.00 |
| 银行汇划费用 | 50,029.54 |
| 银行间账户维护费 | 15,360.00 |
| 合计 | 201,368.49 |

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作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 |
|--------------------|---------------------|
| 国泰基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司（“兴业银行”） | 基金托管人 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的交易。

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 | 上年度可比期间 |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 177,697,754.30 | 186,613,518.29 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 88,762,135.05 | 93,202,554.14 |

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.27%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.27% / 当年天数。

6.4.10.2.2基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 32,906,991.57 | 34,558,059.03 |

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.05% / 当年天数。

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名称 | 本期 |
|----------------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 国泰基金管理有限 公司 | 151,808.99 |
| 合计 | 151,808.99 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 |
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |

| | |
|----------------|------------|
| 国泰基金管理有限 公司 | 185,395.30 |
| 合计 | 185,395.30 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国泰基金管理有限公司，再由国泰基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。本基金约定的销售服务费年费率分别为 0.25%。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

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发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(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

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2022年1月1日至2022年6月30日 | | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|---------------|---------------------------------|---------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 兴业银行—活期 存款 | 18,344,148.13 | 277,753.04 | 16,232,393.15 | 518,732.76 |
| 兴业银行—定期 存款 | 3,501,594,444.48 | 59,158,333.41 | 5,000,000,000.00 | 63,258,778.98 |

注：（1）本基金的银行活期存款由基金托管人兴业银行保管，按银行利率计息。

（2）本基金部分定期存款由基金托管人兴业银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于 2022 年 06 月 30 日，本基金持有基金托管人兴业银行的同业存单 11,000,000.00 张，成本总额为人民币 1,100,000,000.00 元，估值总额为人民币 1,090,470,000.00 元，占基金资产净值的比例为 0.84%。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 已按再投资形式转 实收基金 | 直接通过应付 赎回款转出金额 | 应付利润 本年变动 | 本期利润分 配合计 | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|------------------|----|
| 1,256,673,117.56 | - | 159,491.44 | 1,256,832,609.00 | - |

注：本基金在本半年度累计分配收益 1,256,832,609.00 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 1,256,673,117.56 元，计入应付收益科目 159,491.44 元。

6.4.12 期末（2022 年 6 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限的股票。

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

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 8,504,354,877.31 元，是以如下债券作为质押：

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 |
|--------|----------|------------|------------|---------------|------------------|
| 180204 | 18 国开 04 | 2022-07-01 | 103.08 | 9,484,000.00 | 977,614,436.64 |
| 180204 | 18 国开 04 | 2022-07-04 | 103.08 | 3,526,000.00 | 363,461,461.79 |
| 190214 | 19 国开 14 | 2022-07-04 | 102.28 | 7,000,000.00 | 715,974,859.35 |
| 210216 | 21 国开 16 | 2022-07-01 | 101.53 | 5,263,000.00 | 534,363,550.89 |
| 210216 | 21 国开 16 | 2022-07-05 | 101.53 | 2,411,000.00 | 244,793,942.84 |
| 210216 | 21 国开 16 | 2022-07-06 | 101.53 | 10,526,000.00 | 1,068,727,101.78 |
| 210306 | 21 进出 06 | 2022-07-01 | 101.79 | 785,000.00 | 79,905,804.73 |
| 210306 | 21 进出 06 | 2022-07-05 | 101.79 | 1,315,000.00 | 133,854,946.77 |
| 210308 | 21 进出 08 | 2022-07-05 | 101.16 | 3,600,000.00 | 364,191,794.41 |

| | | | | | |
|--------|---------------|------------|--------|---------------|------------------|
| 210312 | 21 进出 12 | 2022-07-01 | 101.44 | 1,000,000.00 | 101,439,407.03 |
| 210411 | 21 农发 11 | 2022-07-01 | 101.57 | 6,000,000.00 | 609,398,892.22 |
| 220201 | 22 国开 01 | 2022-07-01 | 100.99 | 11,675,000.00 | 1,179,028,026.73 |
| 220201 | 22 国开 01 | 2022-07-05 | 100.99 | 10,526,000.00 | 1,062,993,491.17 |
| 220301 | 22 进出 01 | 2022-07-01 | 100.45 | 10,600,000.00 | 1,064,813,521.82 |
| 220401 | 22 农发 01 | 2022-07-05 | 100.38 | 3,200,000.00 | 321,223,494.28 |
| 229926 | 22 贴现国债 26 | 2022-07-01 | 99.65 | 2,700,000.00 | 269,057,400.57 |
| 合计 | | | | 89,611,000.00 | 9,090,842,133.02 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

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

本基金为货币市场证券投资基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。本基金投资的金融工具主要为各类货币市场工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，以实现在保证本金安全和资产流动性最大化的前提下，追求超过业绩比较基准的收益的投资目标。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人兴业银行，定期存款存放在中国银行、光大银行、厦门国际银行、华夏银行、兴业银行、徽商银行、广州农商银行、民生银行、广州银行、昆仑银行、北京银行、上海银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

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 2022年6月30日 | 上年末 2021年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1 | 243,056,915.47 | 200,000,151.73 |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 16,389,587,094.63 | 15,901,579,931.26 |
| 合计 | 16,632,644,010.10 | 16,101,580,082.99 |

注：本基金持有的未评级债券包括短期融资券、超短期融资券。

6.4.13.2.2 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 2022年6月30日 | 上年末 2021年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA | 605,281,979.21 | 90,794,370.52 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 9,495,303,279.36 | 6,825,982,102.36 |
| 合计 | 10,100,585,258.57 | 6,916,776,472.88 |

注：本基金持有的未评级债券包括国债、政策性金融债。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2022年6月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 25,748,065,765.98 | 20,461,735,504.72 |
| AAA 以下 | - | 1,432,990,121.05 |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 25,748,065,765.98 | 21,894,725,625.77 |

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 8,504,354,877.31 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动

性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20% 时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50% 时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。

本基金投资于一家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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 6 个月以内 | 6 个月-1 年 | 1-5 年 | 不计息 | 合计 |
|---------------------------|--------------------|------------------|-------|----------------|--------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 47,520,341,868.13 | 2,006,393,889.42 | - | - | 49,526,735,757.55 |
| 结算备付金 | 132,164,710.56 | - | - | - | 132,164,710.56 |
| 交易性金融资产 | 44,773,061,501.96 | 7,708,233,532.69 | - | - | 52,481,295,034.65 |
| 买入返售金融资产 | 35,412,289,304.18 | - | - | - | 35,412,289,304.18 |
| 应收清算款 | - | - | - | 689,977,169.20 | 689,977,169.20 |
| 应收申购款 | 1,201,072.55 | - | - | 1,631,208.20 | 2,832,280.75 |
| 其他资产 | - | - | - | 125.00 | 125.00 |
| 资产总计 | 127,839,058,457.38 | 9,714,627,422.11 | - | 691,608,502.40 | 138,245,294,381.89 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 8,504,354,877.31 | - | - | - | 8,504,354,877.31 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,970.44 | 1,970.44 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 29,013,274.60 | 29,013,274.60 |
| 应付托管费 | - | - | - | 5,372,828.62 | 5,372,828.62 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 26,864,143.18 | 26,864,143.18 |
| 应交税费 | - | - | - | 1,723,403.87 | 1,723,403.87 |
| 应付利润 | - | - | - | 9,211,059.22 | 9,211,059.22 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,255,677.17 | 1,255,677.17 |
| 负债总计 | 8,504,354,877.31 | - | - | 73,442,357.10 | 8,577,797,234.41 |
| 利率敏感度缺口 | 119,334,703,580.07 | 9,714,627,422.11 | - | 618,166,145.30 | 129,667,497,147.48 |
| 上年度末 2021 年 12 月 | 6 个月以内 | 6 个月-1 年 | 1-5 年 | 不计息 | 合计 |

| | | | | | |
|-----------|--------------------|------------------|---|----------------|--------------------|
| 31 日 | | | | | |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 54,041,422,734.86 | 5,100,000,000.00 | - | - | 59,141,422,734.86 |
| 结算备付金 | 507,727,301.81 | - | - | - | 507,727,301.81 |
| 存出保证金 | 2,407.53 | - | - | - | 2,407.53 |
| 交易性金融资产 | 41,613,001,866.82 | 3,300,080,314.82 | - | - | 44,913,082,181.64 |
| 买入返售金融资产 | 37,233,157,538.95 | - | - | - | 37,233,157,538.95 |
| 应收清算款 | - | - | - | 204,745,764.33 | 204,745,764.33 |
| 其他资产 | - | - | - | 341,405,028.37 | 341,405,028.37 |
| 应收申购款 | 741,846.05 | - | - | 3,855,482.77 | 4,597,328.82 |
| 资产总计 | 133,396,053,696.02 | 8,400,080,314.82 | - | 550,006,275.47 | 142,346,140,286.31 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 9,429,006,096.35 | - | - | - | 9,429,006,096.35 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 30,458,749.59 | 30,458,749.59 |
| 应付托管费 | - | - | - | 5,640,509.17 | 5,640,509.17 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 28,202,545.91 | 28,202,545.91 |
| 应交税费 | - | - | - | 1,060,283.17 | 1,060,283.17 |
| 应付利润 | - | - | - | 9,051,567.78 | 9,051,567.78 |
| 其他负债 | - | - | - | 5,553,063.14 | 5,553,063.14 |
| 负债总计 | 9,429,006,096.35 | - | - | 79,966,718.76 | 9,508,972,815.11 |
| 利率敏感度缺口 | 123,967,047,599.67 | 8,400,080,314.82 | - | 470,039,556.71 | 132,837,167,471.20 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | |
|----|--------------|
| 假设 | 除利率外其他市场条件不变 |
|----|--------------|

| 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：人民币万元） | |
|---------------|---------------|----------------------------------|--------------------------|
| | | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | 减少约 3,972 | 减少约 3,833 |
| 市场利率下降 25 个基点 | 增加约 3,980 | 增加约 3,842 | |

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资（2021 年 12 月 31 日：无），因此无其他价格风险敞口（2021 年 12 月 31 日：同）。

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

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------|
| 第一层次 | - |
| 第二层次 | 52,481,295,034.65 |
| 第三层次 | - |
| 合计 | 52,481,295,034.65 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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 | 52,481,295,034.65 | 37.96 |
| | 其中：债券 | 52,481,295,034.65 | 37.96 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 35,412,289,304.18 | 25.62 |

| | | | |
|---|-------------------|--------------------|--------|
| | 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 | 49,658,900,468.11 | 35.92 |
| 4 | 其他各项资产 | 692,809,574.95 | 0.50 |
| 5 | 合计 | 138,245,294,381.89 | 100.00 |

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例（%） | |
|----|--------------|------------------|---------------|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 1.48 | |
| | 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 | 8,504,354,877.31 | 6.56 |
| | 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比例取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

本基金本报告期末正回购的资金余额未超过基金资产的 20%。

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 | 89 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 90 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 64 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

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 | 38.78 | 6.56 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |

| | | | |
|----|----------------------------|--------|------|
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 3.50 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 12.91 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 12.04 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 39.04 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 106.28 | 6.56 |

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

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

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 | 310,064,853.70 | 0.24 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 9,185,238,425.66 | 7.08 |
| | 其中：政策性金融债 | 9,185,238,425.66 | 7.08 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 16,632,644,010.10 | 12.83 |
| 6 | 中期票据 | 605,281,979.21 | 0.47 |
| 7 | 同业存单 | 25,748,065,765.98 | 19.86 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 52,481,295,034.65 | 40.47 |
| 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 | 220201 | 22 国开 01 | 25,800,000 | 2,605,475,211.11 | 2.01 |
| 2 | 112212094 | 22 北京银行 CD094 | 20,000,000 | 1,997,166,256.52 | 1.54 |
| 3 | 210216 | 21 国开 16 | 18,200,000 | 1,847,884,595.51 | 1.43 |
| 4 | 112221245 | 22 渤海银行 CD245 | 15,000,000 | 1,493,116,115.84 | 1.15 |
| 5 | 112215106 | 22 民生银行 CD106 | 15,000,000 | 1,491,619,572.32 | 1.15 |
| 6 | 112282233 | 22 重庆农村商行 CD136 | 14,500,000 | 1,447,996,671.17 | 1.12 |
| 7 | 112294881 | 22 厦门银行 CD036 | 14,000,000 | 1,392,815,875.88 | 1.07 |
| 8 | 180204 | 18 国开 04 | 13,010,000 | 1,341,075,898.43 | 1.03 |
| 9 | 220301 | 22 进出 01 | 10,600,000 | 1,064,813,521.82 | 0.82 |
| 10 | 112282326 | 22 厦门国际银行 CD121 | 10,000,000 | 998,583,128.26 | 0.77 |

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 次 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0754% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0151% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0397% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未出现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

本基金本报告期内未出现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所有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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率或商定利率每日计提利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.00 元。

7.9.2 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“北京银行、民生银行、厦门银行、重庆农商行、渤海银行、厦门国际银行、国开行、进出口行”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。

北京银行股份有限公司及下属分支机构因服务收费管理不力，违规收费；理财和同业投资业务严重违反审慎经营规则；贷款管理不到位导致贷款资金被挪用；发生重要信息系统突发事件但未向监管部门报告，严重违反审慎经营规则；未落实贷款条件发放个人一手房按揭贷款、严重违反审慎经营规则；存贷挂钩；违反房地产行业政策；违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；未按规定进行执业登记和管理；违规向关系人发放信用贷款；固定资产贷款发放未执行实贷实付；贷后管理未尽职，个人经营性贷款未按约定用途使用；贴现资金管控不严，贴现资金回流出票人账户等原因，多次受到监管机构公开处罚。

厦门银行股份有限公司及下属分支机构因向四证不全的房地产项目发放委托贷款；违规要求地方政府为企业授信出具还款承诺；贷款“三查”不尽职；未按工程进度放款；发放流动资金贷款用于固定资产投资；政府融资平台贷款管理不审慎；信贷资金回流；同业投资资金回流等原因，多次受到监管机构公开处罚。

中国民生银行股份有限公司及下属分支机构因监管发现问题屡查屡犯；检查发现问题整改不到位；对责任人员的责任认定和问责不到位；内部制度管理不足，个别制度与监管要求冲突；配合现场检查不力；信息系统管控有效性不足；借款人贷款资金交由实际用款人集中使用；滚动签发银行承兑汇票，虚增存款规模；信用证业务贸易背景不真实，福费廷资金回流开证人；项目贷款“三查”不尽职；同业业务治理落实不到位，内部控制制衡性严重缺失，违规签订抽屉协议、假买断、假卖断，违规与票据中介办理票据业务等；因管理不善导致金融许可证遗失；违规办理无真实贸易背景的银行承兑汇票业务；部分客户未纳入集团统一授信管理；发放贷款用于承接不良贷款，掩盖资产质量，发放的贷款已形成不良；贷款用途审查不严，贷款资金被挪用；违规扣划客户账户资金等原因，多次受到监管机构公开处罚。

重庆农村商业银行股份有限公司因未按照规定履行客户身份识别义务；未按规定保存客户身份资料和交易记录；未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告；与身份不明的客户进行交易；信贷资金被挪用；个人经营性贷款未按规定受托支付等原因，多次受到监管机构公开处罚。

渤海银行股份有限公司及下属分支机构因贷款业务严重违反审慎经营规则；理财资金对接本行自营

资产；流动资金贷款被挪用于关联房企；贷后管理不审慎，个人经营性贷款资金回流；办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；违反规定办理结汇、售汇业务；擅自提供对外担保；违反外汇账户管理规定的；违反外汇业务综合头寸管理；内控管理不到位、员工从事违法活动；转嫁经营成本；未按规定履行客户身份识别义务等原因，多次受到监管机构公开处罚。

厦门国际银行股份有限公司及下属分支机构因贷款“三查”不到位；部分分支机构基金销售业务负责人未取得基金从业资格；未建立基金销售业务部门负责人离任审计或离任审查制度；未对个别基金宣传推介材料出具合规意见书等原因，多次受到监管机构公开处罚。

国家开发银行及下属分支机构因漏报、错报 EAST 数据；未按规定报送案件信息；为违规的政府购买服务项目提供融资；项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况；违规变相发放土地储备贷款；设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款；贷款风险分类不准确；向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产；违规进行信贷资产拆分转让，隐匿信贷资产质量；向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品；扶贫贷款存贷挂钩；易地扶贫搬迁贷款“三查”不尽职，部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁；未落实同业业务交易对手名单制监管要求；以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资，未纳入同业借款业务管理；以协定存款方式吸收同业存款，未纳入同业存款业务管理；风险隔离不到位，违规开展资金池理财业务；未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况；逾期未整改，屡查屡犯，违规新增业务；利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表；违规收取小微企业贷款承诺费；收取财务顾问费质价不符；利用银团贷款承诺费浮利分费；向检查组提供虚假整改说明材料；未如实提供信贷资产转让台账；案件信息迟报、瞒报；对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位等原因，多次受到监管机构公开处罚。

中国进出口银行及下属分支机构因贷款用途不合规；通过租金保理业务变相违规新增地方政府融资平台贷款；租金保理业务基础交易不真实；保理业务贷后管理不审慎；贷款管理不审慎，贷款形成不良；未严格落实“实贷实付”；贷后管理不尽职导致贷款被挪用；虚增收入和利润；个别高管人员未经核准实际履职；违规投资企业股权；监管数据漏报错报；违规向地方政府购买服务提供融资；违规变相发放土地储备贷款；向用地未获国务院批准的项目发放贷款；违规开展租金保理业务变相支持地方政府举债；向无实际用款需求的企业发放贷款导致损失；项目贷款未按规定设定抵质押担保；授信额度核定不审慎；贷款风险分类不审慎；向借款人转嫁评估费用；贸易背景审查不审慎；

同业业务交易对手名单制管理落实不到位；对以往监管通报问题整改不到位等原因，多次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。

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 | 应收清算款 | 689,977,169.20 |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 2,832,280.75 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | 125.00 |
| 8 | 合计 | 692,809,574.95 |

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(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 |
| 14,484,637 | 8,952.07 | 519,824.26 | 0.00% | 129,666,977,323.22 | 100.00% |

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 | 个人 | 26,266,130.58 | 0.02% |
| 2 | 个人 | 17,213,689.51 | 0.01% |
| 3 | 个人 | 14,608,049.62 | 0.01% |
| 4 | 个人 | 13,797,344.62 | 0.01% |
| 5 | 个人 | 13,304,836.06 | 0.01% |
| 6 | 个人 | 13,198,574.65 | 0.01% |
| 7 | 个人 | 11,820,905.22 | 0.01% |
| 8 | 个人 | 10,843,338.63 | 0.01% |
| 9 | 个人 | 10,169,956.56 | 0.01% |
| 10 | 个人 | 9,928,988.88 | 0.01% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 7,616,893.32 | 0.01% |

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的情况

| 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 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------------|--------------------|
| 基金合同生效日（2016 年 12 月 22 日）基金份额总额 | 200,026,230.11 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 132,837,167,471.20 |
| 本报告期基金总申购份额 | 819,536,429,470.59 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 822,706,099,794.31 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 129,667,497,147.48 |

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金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

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，本基金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

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

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

报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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 | |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资质雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

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 | | 回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|--------------|--------------------|--------------|------|--------------|
| | 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 |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | 406,155,315,000.00 | 100.00% | - | - |

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过 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 | 关于国泰利是宝货币市场基金调整大额申购（含定投）及转换转入业务金额限制的公告 | 《证券时报》 | 2022-03-25 |

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰利是宝货币市场基金注册的批复
- 2、国泰利是宝货币市场基金基金合同
- 3、国泰利是宝货币市场基金托管协议
- 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

11.2 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。

11.3 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

二〇二二年八月三十日