

# 中泰蓝月短债债券型证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:中泰证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 30 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规定，于2022年8月29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
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	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	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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
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	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.3 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	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.....	54
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 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
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.....	58
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中泰蓝月短债债券型证券投资基金	
基金简称	中泰蓝月短债	
基金主代码	007057	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年04月26日	
基金管理人	中泰证券（上海）资产管理有限公司	
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	86,222,831.07份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中泰蓝月短债A	中泰蓝月短债C
下属分级基金的交易代码	007057	007058
报告期末下属分级基金的份额总额	27,543,116.85份	58,679,714.22份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，重点投资短期债券主题证券，力争使基金份额持有人获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在充分考虑基金资产的安全性、收益性、流动性及严格控制风险的前提下，通过分析经济周期变化、货币政策、债券供求等因素，持续研究债券市场运行状况、研判市场风险，制定债券投资策略，挖掘价值被低估的标的券种，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	中债综合财富（1年以下）指数收益率*80%+一年期定期存款利率（税后）*20%
风险收益特征	本基金是债券型基金，属于较低预期风险、较低预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

### 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	中泰证券（上海）资产管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王洪懿
	联系电话	021-20521199
	电子邮箱	wanghy@ztzqzg.com
客户服务电话	400-821-0808	95561
传真	021-50933716	021-62159217
注册地址	上海市黄浦区延安东路175号24楼05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	上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1002-1003室	上海市银城路167号兴业大厦4楼
邮政编码	200120	200041
法定代表人	黄文卿	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	www.ztzqzg.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1002-1003室

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中泰证券（上海）资产管理有限公司	上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1002-1003室

## § 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01月01日-2022年06月30日)	
	中泰蓝月短债A	中泰蓝月短债C
本期已实现收益	364,691.26	681,196.51
本期利润	358,995.87	639,622.15
加权平均基金份额本期利润	0.0132	0.0113
本期加权平均净值利润率	1.21%	1.04%
本期基金份额净值增长率	1.22%	1.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	2,670,284.54	5,258,780.14
期末可供分配基金份额利润	0.0969	0.0896
期末基金资产净值	30,213,401.39	63,938,494.36
期末基金份额净值	1.0969	1.0896
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	9.69%	8.96%

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、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中泰蓝月短债A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④

过去一个月	0.15%	0.01%	0.15%	0.01%	0.00%	0.00%
过去三个月	0.61%	0.01%	0.66%	0.01%	-0.05%	0.00%
过去六个月	1.22%	0.01%	1.26%	0.01%	-0.04%	0.00%
过去一年	2.79%	0.01%	2.47%	0.01%	0.32%	0.00%
过去三年	9.16%	0.01%	7.81%	0.01%	1.35%	0.00%
自基金合同生效起至今	9.69%	0.01%	8.39%	0.01%	1.30%	0.00%

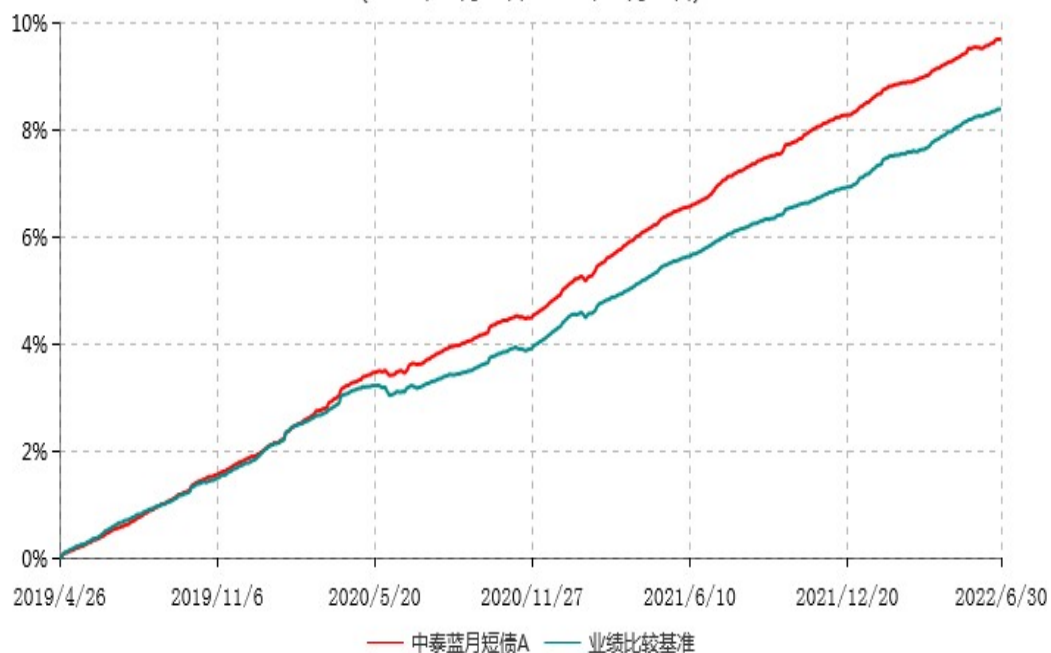
## 中泰蓝月短债C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.13%	0.01%	0.15%	0.01%	-0.02%	0.00%
过去三个月	0.54%	0.01%	0.66%	0.01%	-0.12%	0.00%
过去六个月	1.07%	0.01%	1.26%	0.01%	-0.19%	0.00%
过去一年	2.48%	0.01%	2.47%	0.01%	0.01%	0.00%
过去三年	8.48%	0.02%	7.81%	0.01%	0.67%	0.01%
自基金合同生效起至今	8.96%	0.02%	8.39%	0.01%	0.57%	0.01%

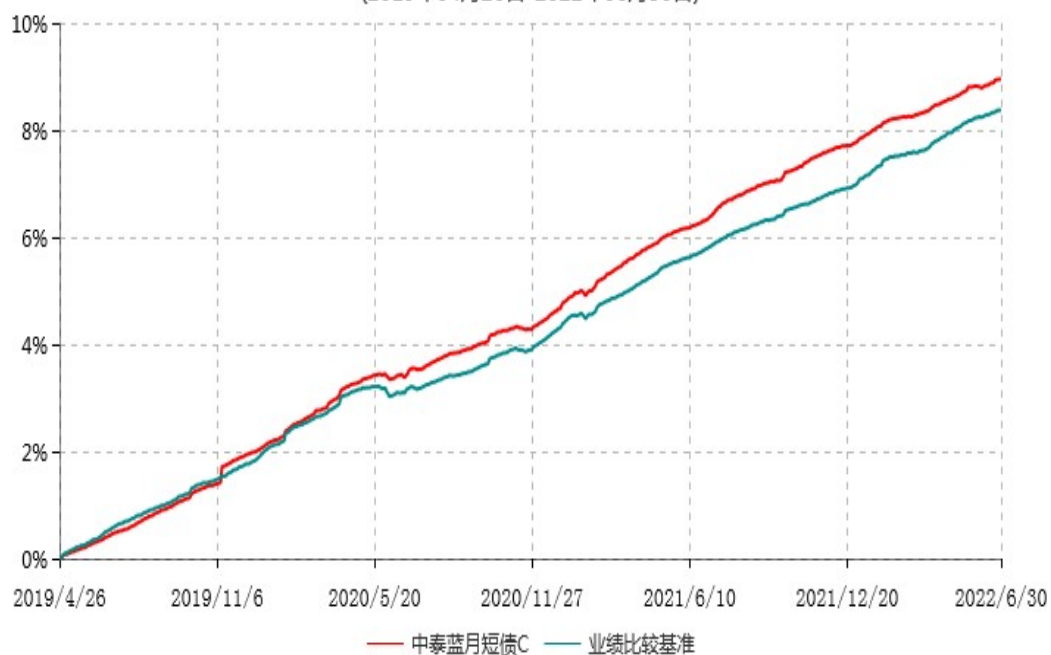
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



中泰蓝月短债A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年04月26日-2022年06月30日)



中泰蓝月短债C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年04月26日-2022年06月30日)



## § 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

中泰证券（上海）资产管理有限公司成立于2014年8月13日。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准齐鲁证券有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可[2014]355号）批准，是齐鲁证券有限公司（现已更名为“中泰证券股份有限公司”）出资设立的证券资产管理子公司。2017年12月，根据中国证券监督管理委员会《关于核准中泰证券（上海）资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可[2017]2342号）批准，公司获得开展公募基金业务资格。目前公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至2022年6月30日，公司作为基金管理人共管理中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰玉衡价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰蓝月短债债券型证券投资基金、中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰青月中短债债券型证券投资基金、中泰中证500指数增强型证券投资基金、中泰沪深300指数增强型证券投资基金、中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金、中泰兴诚价值一年持有期混合型证券投资基金、中泰星宇价值成长混合型证券投资基金、中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金、中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金、中泰安睿债券型证券投资基金、中泰安益利率债债券型证券投资基金、中泰锦泉汇金货币市场基金、中泰兴为价值精选混合型证券投资基金、中泰红利价值一年持有期混合型发起式证券投资基金、中泰红利优选一年持有期混合型发起式证券投资基金共十八只证券投资基金。

#### 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		
商园波	本基金基金经理；中泰青月中短债债券型证券投资基金基金经理；中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金基金经理；中泰锦泉汇金货币市场基金基金经理；基金业务部副总经理。	2019-04-26	-	10	国籍：中国。学历：上海财经大学硕士研究生。具备证券从业资格和基金从业资格。曾任上海银行理财产品交易员、投资经理；上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益部投资经理；2014年8月加入中泰证券（上海）资产管理

					有限公司金融市场部任副总经理、现任基金业务部副总经理。2019年4月26日起至今担任中泰蓝月短债债券型证券投资基金基金经理。2019年8月9日起至今担任中泰青月中短债债券型证券投资基金基金经理。2021年7月21日起至今担任中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金基金经理。2022年2月28日起至今担任中泰锦泉汇金货币市场基金基金经理。
臧洁	本基金基金经理；中泰青月中短债债券型证券投资基金基金经理；中泰安睿债券型证券投资基金基金经理。	2021-06-22	-	8	国籍：中国。学历：南京大学硕士研究生。具备证券从业资格和基金从业资格。曾任德邦证券有限公司债券投资与交易部交易员。2015年3月加入中泰证券（上海）资产管理有限公司固定收益部担任投资经理，2021年6月起任基金业务部高级基金经理。2021年6月22日起至今担任中泰蓝月短债债券型证券投资基金和中泰青月中短债债券型证券投资基金基金经理。2022年1月19日起至今担任中泰安睿债券型证券投资基金基金经理。

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金基金合同的约定，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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

## 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，各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未出现违反制度的情况。

本报告期内，我司旗下产品所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节均严格执行《中泰证券（上海）资产管理有限公司公平交易及异常交易制度》。

公司建立了针对公平交易进行事前控制、事中监控、事后分析的完整流程，形成有效的公平交易体系。

事前控制包括：通过建立投资研究沟通机制确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会；对各投资组合的重大非公开投资信息进行相互隔离；并通过投资交易系统进行公平交易和反向交易风控设置。

事中监控通过执行集中交易制度，将投资管理与交易执行相分离，交易由交易部集中执行。交易部以公平交易为原则，保证投资组合的交易得到公平、及时、准确、高效地执行，确保不同产品享有公平的交易执行机会；对不同账户的交易指令按照“时间优先、价格优先”原则执行；同时接收的交易指令在分配和执行过程中，避免因投资组合资产的大小、成交额的大小及交易难易等客观因素或个人主观好恶而出现执行时间及执行数量比例的明显不均现象；同时收到不同投资组合账户同种证券同向买卖指令时，避免交易因执行的时间、比例明显不同而出现交易均价明显差异的现象。

事后分析主要集中在对不同投资组合同日或者临近交易日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，监督检验公平交易原则实施情况，识别是否存在不公平交易和任何利益输送嫌疑的交易行为。

1、同向交易价差分析，主要是通过分析产品间不同时间窗口（1日、3日、5日）的同向交易价差，来分析判断同向交易是否存在违反公平交易原则和利益输送的行为，分析判断的方法和指标包括同向交易价差T检验、差价率均值、占优比率、差价贡献率等。

2、反向交易分析，主要通过分析产品不同时间窗口（同日、隔日、3日、5日）反向交易成交较少的单边交易量占相关证券当日成交量情况的分析，识别是否存在任何利益输送嫌疑的交易行为。

本报告期内，公平交易分析基本结论如下：

- 1、报告期内不存在产品间同向交易行为导致利益输送的结果；
- 2、报告期内不存在产品间反向交易行为导致利益输送的结果。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

异常交易，是指本公司所管理的各产品自身或产品之间所发生的交易对象、交易时间、交易价格、交易数量和交易理由等单项或多项出现异常。公司管理产品买卖法规、产品管理合同、交易制度等限制投资对象的交易均认定为交易对象异常型异常交易。公司管理的产品进行沪深京交易所股票场内竞价交易时，如果产品单独或共同在收盘前15分钟的单边交易量占该品种当日场内竞价交易总量比例超过15%，则认定为交易时间异常型异常交易。产品在连续竞价阶段委托价格超过最新价格的3%，则作为交易价格异常型异常交易。公司管理的产品进行沪深京交易所股票场内竞价交易时，如果产品单独或共同在交易当日的单边交易量占该品种当日场内竞价交易总量比例超过30%，即作为交易数量异常型异常交易。内幕交易，频繁申报与撤单，不能列示有充分投资研究成果支持的交易，以及投资管理人员受他人干预，未能就投资、交易等事项做出客观、公正的独立判断与决策的交易，均作为交易理由异常型异常交易。

风险管理部通过系统或人工手段，监控各产品的异常交易，如果发现某笔交易符合异常交易界定标准，将其列为异常交易，并建立异常交易档案，系统记录异常交易发生的时间、具体交易情况及认定人和认定依据，对于风险管理部识别出的异常交易，要求投资经理进行合理解释，并提交书面说明至风险管理部备案。

本报告期内，未发生异常交易行为。

#### 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

上半年货币政策维持宽松，经济基本面对债市非常有利，国内债券市场在较低的收益率水平呈现较低波动，10年国债活跃券收益率波动区间为2.67%~2.87%，仅20个基点，分阶段来看：

第一阶段：年初-1月底

去年底中央经济工作会议提出经济面临三重压力，1月货币政策降息落地，收益率全面下行，单月下行10BP，收益率最低点2.67%；

第二阶段：1月底-3月中

财政刺激政策的不断出台、各地房地产政策放松、信贷开门红压力下叠加美联储加息干扰，国内债市出现了一波回调，10年期国债从低点2.67%最高回调至2.87%；

第三阶段：3月下旬-6月底

3月的上海疫情爆发、4月的降准不及预期、5月的社融数据坍塌、6月的上海复工复产，债市进入了更加窄幅的震荡区间，10年国债活跃券向上、下未突破2.74%、2.86%，区间仅约10BP。截至6月底，10年国债活跃券收于2.83%。

回顾一、第二季度的操作，本基金维持精选个券及中性久期、杠杆策略，兼顾流动性、稳定性和收益性；随着资金面的变化及时调整仓位和杠杆策略的使用。配置上以AAA和AA+评级信用品种为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中泰蓝月短债A基金份额净值为1.0969元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.22%，同期业绩比较基准收益率为1.26%；截至报告期末中泰蓝月短债C基金份额净值为1.0896元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.07%，同期业绩比较基准收益率为1.26%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，我们预计债券市场很难突破窄幅震荡格局。随着疫情的缓解，财政政策或将会加大出台力度助推经济复苏，但由于疫情的长尾效应以及经济增长的重要板块房地产行业迟迟未见好转迹象，经济迅速回到潜在增速的概率不大。而货币政策在经济出现明显好转信号之前，收紧的概率很小。尽管欧美加息会对我国货币政策的进一步宽松形成制约，但由于我国目前经济环境与美国处于不同阶段，我国货币政策或将继续维持“以我为主”的态度，保持流动性合理充裕，这对债券市场仍将是有利条件。

#### 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》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

基金管理人设立了估值委员会，由公司总经理、主管基金运营的公司高管、合规负责人及投资管理、风险管理、基金运营等方面的专业人员担任委员。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会对经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，形成估值委员会决议。运营部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

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不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 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

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：中泰蓝月短债债券型证券投资基金

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	上年度末
----	-----	-----	------

		2022年06月30日	2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,024,434.18	1,315,902.24
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	91,169,888.55	94,120,884.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		91,169,888.55	94,120,884.00
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	1,000,002.50	7,000,025.00
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,992,448.94	458,696.70
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	1,416,658.09
资产总计		99,186,774.17	104,312,166.03
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年06月30日</b>	<b>上年度末 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		-	5,519,797.24
应付清算款		-	-
应付赎回款		4,889,985.73	889,224.13
应付管理人报酬		28,098.16	26,162.25
应付托管费		9,366.05	8,720.75
应付销售服务费		20,691.85	18,474.06
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7,489.13	11,189.89
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	79,247.50	56,861.57
负债合计		5,034,878.42	6,530,429.89
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.6	86,222,831.07	90,560,166.49
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	7,929,064.68	7,221,569.65
净资产合计		94,151,895.75	97,781,736.14
负债和净资产总计		99,186,774.17	104,312,166.03

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额总额86,222,831.07份，其中中泰蓝月短债A类份额27,543,116.85份，中泰蓝月短债C类份额58,679,714.22份。A类份额净值1.0969元，C类份额净值1.0896元。

## 6.2 利润表

会计主体：中泰蓝月短债债券型证券投资基金

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 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
----	-----	-----------------------------------	--

<b>一、营业总收入</b>		1,460,224.06	1,217,736.12
1. 利息收入		24,147.40	954,377.64
其中：存款利息收入	6.4.7.8	5,770.01	2,612.89
债券利息收入		-	948,543.76
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		18,377.39	3,220.99
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,426,133.28	202,206.89
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	1,426,133.28	202,206.89
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.11	-	-
股利收益	6.4.7.12	-	-
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）	6.4.7.13	-47,269.75	57,454.26
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	57,213.13	3,697.33
<b>减：二、营业总支出</b>		461,606.04	295,080.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	135,577.12	85,110.98

2. 托管费	6.4.10.2. 2	45,192.37	28,370.30
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	91,632.19	30,334.27
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		94,163.26	94,258.47
其中：卖出回购金融资产支出		94,163.26	94,258.47
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		5,835.85	3,247.90
8. 其他费用	6.4.7.15	89,205.25	53,758.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		998,618.02	922,655.44
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		998,618.02	922,655.44
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		998,618.02	922,655.44

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中泰蓝月短债债券型证券投资基金

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 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	90,560,166.49	-	7,221,569.65	97,781,736.14
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更	-	-	-	-

正				
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	90,560,166.49	-	7,221,569.65	97,781,736.14
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-4,337,335.42	-	707,495.03	-3,629,840.39
(一)、综合收益总额	-	-	998,618.02	998,618.02
(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)	-4,337,335.42	-	-291,122.99	-4,628,458.41
其中: 1. 基金申购款	169,944,828.92	-	14,715,622.06	184,660,450.98
2. 基金赎回款	-174,282,164.34	-	-15,006,745.05	-189,288,909.39
(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)	-	-	-	-
(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)	86,222,831.07	-	7,929,064.68	94,151,895.75
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	51,829,108.08	-	2,539,849.85	54,368,957.93
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更	-	-	-	-

正				
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	51,829,108.08	-	2,539,849.85	54,368,957.93
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	4,185,761.99	-	1,129,516.15	5,315,278.14
(一)、综合收益总额	-	-	922,655.44	922,655.44
(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)	4,185,761.99	-	206,860.71	4,392,622.70
其中: 1. 基金申购款	56,283,682.69	-	3,146,861.19	59,430,543.88
2. 基金赎回款	-52,097,920.70	-	-2,940,000.48	-55,037,921.18
(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)	-	-	-	-
(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)	56,014,870.07	-	3,669,366.00	59,684,236.07

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:

黄文卿

应晨奇

陈勇

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

中泰蓝月短债债券型证券投资基金(以下简称“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[2019]175号《关于准予中泰蓝月短债债券型证券投资基金注册的批复》注册,由中泰证券(上海)资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中泰蓝月短债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币4,010,313,419.20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(2019)第0265号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中泰蓝月短债债券型证券投资基金基金合同》于2019年04月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,010,666,963.38份基金份额,其中认购资金利息折合353,544.18份基金份额。本基金的基金管理人为中泰证券(上海)资产管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中泰蓝月短债债券型证券投资基金基金合同》和《中泰蓝月短债债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购费、申购费,赎回时根据持有期限收取赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资者认购、申购时不收取认购费、申购费,赎回时根据持有期限收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类两种收费模式并存,本基金A类基金份额和C类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中泰蓝月短债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括剩余期限在397天以内(含397天)的债券资产(国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可分离交易可转债的纯债部分、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债)、资产支持证券、期限在一年以内(含一年)的债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单、其他货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于股票、权证等资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为投资于债券的比例不低于基金资产的80%,其中投资于短期债券主题证券的比例不低于非现金资产的80%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中债综合财富(1年以下)指数收益率 $\times$ 80%+一年期定期存款利率(税后) $\times$ 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人中泰证券(上海)资产管理有限公司于2022年8月29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》、《中泰蓝月短债债券型证券投资基金基金合同》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年上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年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 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。除下述会计政策外,本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 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。

### 6.4.4.2 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。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；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。

#### 6.4.4.3 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应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得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在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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。

#### 6.4.5 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年上半年度财务报表，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、买入返售金融资产、应收利息和应收申购款，金额分别为1,315,902.24元、7,000,025.00元、1,416,658.09元和458,696.70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、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为1,316,486.55元、7,001,965.14元、0.00元和458,696.70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94,120,884.00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95,535,017.64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、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和应付利息，金额分别为5,519,797.24元、889,224.13元、26,162.25元、8,720.75元、18,474.06元、7,463.04元和398.53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、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-应付利息，金额分别为5,520,195.77元、889,224.13元、26,162.25元、8,720.75元、18,474.06元、7,463.04元和0.00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06月30日
活期存款	4,444,171.63
等于：本金	4,443,697.69
加：应计利息	473.94
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
其他存款	580,262.55
等于：本金	579,786.64
加：应计利息	475.91
减：坏账准备	-
合计	5,024,434.18

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

## 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			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	14,766,129.20	363,410.50	15,072,605.70	-56,934.00
	银行间市场	75,339,078.72	710,882.85	76,097,282.85	47,321.28
	合计	90,105,207.92	1,074,293.35	91,169,888.55	-9,612.72
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		90,105,207.92	1,074,293.35	91,169,888.55	-9,612.72

## 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。

## 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06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,000,002.50	-
银行间市场	-	-
合计	1,000,002.50	-

**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买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 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	11.11
应付交易费用	5,769.62
其中：交易所市场	-
银行间市场	5,769.62
应付利息	-
预提费用	73,466.77
合计	79,247.50

**6.4.7.6 实收基金****6.4.7.6.1 中泰蓝月短债A**

金额单位：人民币元

项目 (中泰蓝月短债A)	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	27,142,317.58	27,142,317.58
本期申购	2,960,676.01	2,960,676.01
本期赎回(以“-”号填列)	-2,559,876.74	-2,559,876.74
本期末	27,543,116.85	27,543,116.85

**6.4.7.6.2 中泰蓝月短债C**

金额单位：人民币元

项目 (中泰蓝月短债C)	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	63,417,848.91	63,417,848.91
本期申购	166,984,152.91	166,984,152.91
本期赎回（以“-”号填列）	-171,722,287.60	-171,722,287.60
本期末	58,679,714.22	58,679,714.22

#### 6.4.7.7 未分配利润

##### 6.4.7.7.1 中泰蓝月短债A

单位：人民币元

项目 (中泰蓝月短债A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,353,972.96	-82,312.54	2,271,660.42
本期利润	364,691.26	-5,695.39	358,995.87
本期基金份额交易产生的变动数	40,730.03	-1,101.78	39,628.25
其中：基金申购款	281,921.65	-8,052.26	273,869.39
基金赎回款	-241,191.62	6,950.48	-234,241.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,759,394.25	-89,109.71	2,670,284.54

##### 6.4.7.7.2 中泰蓝月短债C

单位：人民币元

项目 (中泰蓝月短债C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	5,143,777.40	-193,868.17	4,949,909.23
本期利润	681,196.51	-41,574.36	639,622.15
本期基金份额交易产生的变动数	-374,991.17	44,239.93	-330,751.24
其中：基金申购款	14,884,731.54	-442,978.87	14,441,752.67
基金赎回款	-15,259,722.71	487,218.80	-14,772,503.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,449,982.74	-191,202.60	5,258,780.14



## 6.4.7.8 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	2,408.65
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,361.36
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	5,770.01

## 6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

## 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	1,738,094.51
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-311,961.23
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	1,426,133.28

## 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）	92,018,594.04

及债券到期兑付) 成交总额	
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	90,272,958.56
减：应计利息总额	2,054,254.72
减：交易费用	3,341.99
买卖债券差价收入	-311,961.23

#### 6.4.7.11 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.12 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-47,269.75
——股票投资	-
——债券投资	-47,269.75
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-
合计	-47,269.75

**6.4.7.14 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	57,200.54
转换费收入	12.59
合计	57,213.13

**6.4.7.15 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	24,795.19
信息披露费	39,671.58
汇划手续费	6,438.48
账户维护费	17,700.00
其他费用	600.00
合计	89,205.25

**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
中泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称	基金管理人、注册登记机构、基

“中泰资管” )	金销售机构
中泰证券股份有限公司 (以下简称“中泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业银行股份有限公司 (以下简称“兴业银行”)	基金托管人、基金销售机构

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

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
中泰证券	20,816,989.19	100.00%	4,052,354.79	100.00%

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的

		比例		比例
中泰证券	238,950,000.00	100.00%	69,000,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中泰证券	1,202.04	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中泰证券	290.01	100.00%	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 管理人从关联方获得的服务包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究服务。

#### 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	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	135,577.12	85,110.98
其中：支付销售机构的客户维护费	45,095.41	17,502.10

注：支付基金管理人中泰资管的管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%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X0.30%/当年天数。

#### 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	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	45,192.37	28,370.30

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0.10%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X0.10%/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		
	中泰蓝月短债A	中泰蓝月短债C	合计
兴业银行 股份有限公司	0.00	2,091.33	2,091.33
中泰证券 股份有限公司	0.00	40,353.50	40,353.50
中泰证券 (上海)资 产管理有 限公司	0.00	1,783.97	1,783.97
合计	0.00	44,228.80	44,228.80
获得销售 服务费的	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日		

各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中泰蓝月短债A	中泰蓝月短债C	合计
兴业银行股份有限公司	0.00	2,871.03	2,871.03
中泰证券股份有限公司	0.00	14,497.75	14,497.75
中泰证券（上海）资产管理有限公司	0.00	3,126.76	3,126.76
合计	0.00	20,495.54	20,495.54

注：支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值0.30%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中泰证券（上海）资产管理有限公司，再由中泰证券（上海）资产管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日C类基金资产净值} \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

#### 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

本基金本报告期内未与关联方进行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

中泰蓝月短债A

份额单位：份

项目	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年06月30日
基金合同生效日（2019年04月26日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	1,910,941.25
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00

报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	1,910,941.25
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

中泰蓝月短债C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至 2022年06月30日	2021年01月01日至 2021年06月30日
基金合同生效日（2019年04月26日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注：本报告期基金管理人未持有本基金。

**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**

注：本报告期其他关联方未持有本基金。

**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		上年度可比期间	
	2022年01月01日至2022年06月30日		2021年01月01日至2021年06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	4,444,171.63	2,408.65	655,636.76	1,946.85
中泰证券	580,262.55	3,361.36	9,337.54	666.04



注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。本基金的其他存款由基金结算机构中泰证券保管，按协议约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

本基金未因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理包括事前控制、事中控制和事后控制。

事前控制流程包括：投资与研究部门根据宏观经济形势、财政与货币政策趋势、行业景气度、证券市场走势，提出资产配置策略建议，构建备选库。专业投资委员会根据投资与研究部门的研究成果，确立股票池、债券库和策略库的建立和调整方案，决定本委员会下属的各项资产管理产品的资产配置策略或者交易策略；评估本委员会下属的各项资产管理产品的风险。风险控制委员会负责建立公司全面风险管理体系，对公司重大业务和管理工作的风险进行评估并对重大风险的处理方案进行审核。风险管理部根据专

业投资委员会制定的投资策略和资产配置方案，协助专业投资委员会进行投资策略的风险检验，以及制定相应的投资风险控制标准。

事中控制流程包括：风险管理部根据本基金资产实际投资运作状况，实时测算各种风险指标，并监测本基金资产各项风险控制指标的变化，识别、分析和评价相关业务的风险状况，出具业务风险评估报告，提出风险预警。如在风险监测中发现异常现象或存在重大隐患时，需要立即对风险进行识别，明确风险种类并对其进行度量，测算该风险的危害程度，及时向专业投资委员会提出处理措施，控制风险程度的上升。

事后控制流程包括：在风险处理措施实施以后，风险管理部实时监控处理效果并提出阶段性总结报告，进一步提出改善整体和局部风险管理的建议。此外，对本基金资产的投资组合风险状况进行定期或不定期分析和总结，定期或不定期编写风险管理报告提交风险控制委员会和专业投资委员会及投资决策委员会。风险管理部应根据市场环境的变化对投资组合的风险进行情景分析或模拟分析，在估计可能产生重大风险隐患时，及时通报专业投资委员会和投资决策委员会，并提出降低风险的建议。当市场环境的变化导致风险控制模型的适用性降低时，风险管理部应及时对所使用的风险控制模型进行重新检验和修正，包括但不限于压力测试、敏感性分析等。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了全面风险管理体系。公司业务的风险管理体系共分四个层次：第一层次为董事会，董事会是公司风险管理的最高决策机构，风险控制委员会为董事会风险管理的专门工作机构，负责制订公司风险管理总体目标和政策，审批公司风险管理的制度、流程与指标，并对公司重大经营及决策进行风险评估并提出意见；第二层次为行政办公会，行政办公会是公司风险管理的决策监督机构，风险控制执行委员会为行政办公会风险管理的常设机构，承担日常风险管理决策职责，负责提出公司业务经营管理过程中风险防范的指导意见、制定风险管理策略、对公司风险状况和风险管理能力进行评估、监督风控措施执行情况；第三层次为风险管理部及相关职能部门。风险管理部是公司风险管理的专职日常工作机构，在首席风险官领导下监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门的风险管理工作；第四层次为各业务部门的一线风险管理。各业务部门承担一线的风控职能，执行具体的风险管理制度，并承担风险管理有效性的直接责任。公司建立了完善的内部控制制度，交易部门、投资管理部门以及风险管理部门互相独立、互相制约。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务的行为。无论是整体市场投资者的信用偏好变化，还是基金具体投资债券和上市公司的信用恶化，都会对本基金的回报带来负面影响。另外，信用评级调整也会带来相应风险。当

信用评级机构调低本基金所持有的债券的信用级别时，债券的价格会下跌，从而导致本基金的收益下降。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人处，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证券及交易对手库管理办法，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，且通过分散化组合投资以分散信用风险；管理人实行交易对手白名单制度，并根据交易对手的资信状况分别限定交易额度。

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06月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	5,004,812.60	18,104,200.00
A-1以下	-	-
未评级	48,386,832.89	25,062,700.00
合计	53,391,645.49	43,166,900.00

注：本基金持有的短期未评级债券为短期融资券及超短期融资券。

#### 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06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	26,902,139.22	31,304,000.00
AAA以下	5,242,509.59	14,180,900.00
未评级	-	-
合计	32,144,648.81	45,484,900.00

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险包括两类。一是指在市场中的投资操作由于市场的深度限制或由于市场剧烈波动而导致投资交易无法实现或不能以当前合理的价格实现，从而可能为基金带来投资损失的风险。二是指开放式基金由于申购赎回要求可能导致流动资金不足的风险。

基金管理人将密切关注各类资产及投资标的的交易活跃程度与价格的连续性情况，评估各类资产及投资标的占基金资产的比例并进行动态调整，以满足基金运作过程中的流动性要求，应对流动性风险。

本报告期末，除卖出回购金融资产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（所有者权益）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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

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上市公司发行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开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。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

15%。于本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

#### 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。

本基金的基金管理人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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年 06月30 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	5,024,434.18	-	-	-	-	-	5,024,434.18
交易性金融资产	14,356,877.81	13,984,985.76	62,828,024.98	-	-	-	91,169,888.55
买入返售金融资产	1,000,002.50	-	-	-	-	-	1,000,002.50
应收申购款	-	-	-	-	-	1,992,448.94	1,992,448.94
资产总计	20,381,314.49	13,984,985.76	62,828,024.98	-	-	1,992,448.94	99,186,774.17

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,889,985.73	4,889,985.73
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,098.16	28,098.16
应付托管费	-	-	-	-	-	9,366.05	9,366.05
应付销售服务费	-	-	-	-	-	20,691.85	20,691.85
应交税费	-	-	-	-	-	7,489.13	7,489.13
其他负债	-	-	-	-	-	79,247.50	79,247.50
负债总计	-	-	-	-	-	5,034,878.42	5,034,878.42
利率敏感度缺口	20,381,314.49	13,984,985.76	62,828,024.98	-	-	-3,042,429.48	94,151,895.75
上年度末 2021年 12月31 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	1,315,902.24	-	-	-	-	-	1,315,902.24
交易性金融资产	12,581,000.00	3,019,500.00	78,520,384.00	-	-	-	94,120,884.00
买入返售金融资产	7,000,025.00	-	-	-	-	-	7,000,025.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,416,658.09	1,416,658.09
应收申购款	-	-	-	-	-	458,696.70	458,696.70
资产总计	20,896,927.24	3,019,500.00	78,520,384.00	-	-	1,875,354.79	104,312,166.03
负债							
卖出回购金融资产款	5,519,797.24	-	-	-	-	-	5,519,797.24
应付赎回款	-	-	-	-	-	889,224.13	889,224.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	26,162.25	26,162.25
应付托管费	-	-	-	-	-	8,720.75	8,720.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-	18,474.06	18,474.06

费							
应付交易费用	-	-	-	-	-	7,463.04	7,463.04
应交税费	-	-	-	-	-	11,189.89	11,189.89
应付利息	-	-	-	-	-	398.53	398.53
其他负债	-	-	-	-	-	49,000.00	49,000.00
负债总计	5,519,797.24	-	-	-	-	1,010,632.65	6,530,429.89
利率敏感度缺口	15,377,130.00	3,019,500.00	78,520,384.00	-	-	864,722.14	97,781,736.14

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	假设 1、该利率敏感性分析基于本基金资产负债表日的风险状况； 2、该利率敏感性分析假定市场利率变化只对基金组合中的债券类资产估值产生影响，对其他会计科目的影响忽略不计； 3、该利率敏感性分析假定所有期限市场即期利率曲线平行移动25BP，且除利率之外的其他市场变量保持不变。 4、该利率敏感性分析不考虑交易所可转换公司债券及可交换公司债券。		
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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率上升25BP	-108,965.18	-109,611.99
市场利率下降25BP	109,326.19	109,951.49	

#### 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

其他价格风险主要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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

## 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 2022年06月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
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	91,169,888.55	96.83	94,120,884.00	96.26
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	91,169,888.55	96.83	94,120,884.00	96.26

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有交易性权益投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

## 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	91,169,888.55	94,120,884.00
第三层次	-	-
合计	91,169,888.55	94,120,884.00

## 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

无。

## § 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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	91,169,888.55	91.92
	其中：债券	91,169,888.55	91.92
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	1,000,002.50	1.01
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,024,434.18	5.07
8	其他各项资产	1,992,448.94	2.01
9	合计	99,186,774.17	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未买入股票。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未卖出股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票交易。

## 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	5,633,594.25	5.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	9,439,011.45	10.03
5	企业短期融资券	53,391,645.49	56.71
6	中期票据	22,705,637.36	24.12
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	91,169,888.55	96.83

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	101800499	18华能集MTN001	70,000	7,192,719.01	7.64
2	136051	15五矿03	61,440	6,330,129.53	6.72
3	019641	20国债11	55,000	5,633,594.25	5.98
4	101759061	17泰州城投MTN002	50,000	5,242,509.59	5.57
5	101900960	19首旅MTN002A	50,000	5,179,238.90	5.50

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

7.12.1 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。

7.12.2 本基金本报告期末投资股票。

**7.12.3 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	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,992,448.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,992,448.94

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.12.6 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。

## § 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

份额级别	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
中泰蓝月短债A	437	63,027.73	24,234,979.25	87.99%	3,308,137.60	12.01%
中泰蓝月短债C	12,442	4,716.26	10,582,248.41	18.03%	48,097,465.81	81.97%
合计	12,879	6,694.84	34,817,227.66	40.38%	51,405,603.41	59.62%

注：本表列示“占总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中泰蓝月短债A	187,124.31	0.679%
	中泰蓝月短债C	257,438.75	0.439%
	合计	444,563.06	0.516%

本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

**8.3 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	份额级别	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	中泰蓝月短债A	0
	中泰蓝月短债C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	中泰蓝月短债A	10~50
	中泰蓝月短债C	0
	合计	10~50

注： 期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

	中泰蓝月短债A	中泰蓝月短债C
基金合同生效日(2019年04月26日)基金份额总额	2,812,097,391.73	1,198,569,571.65
本报告期期初基金份额总额	27,142,317.58	63,417,848.91
本报告期基金总申购份额	2,960,676.01	166,984,152.91
减：本报告期基金总赎回份额	2,559,876.74	171,722,287.60
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	27,543,116.85	58,679,714.22

**§ 10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

**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**

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘为基金审计的会计师事务所。

#### 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

本报告期，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 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	
中泰证券	2	-	-	1,202.04	100.00%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

##### 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
中泰证券	20,816,989.19	100.00%	238,950,000.00	100.00%	-	-	-	-

#### 10.8 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	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于调整旗下部分	证券时报、中国证监会规定网站	2022-01-10

	基金网上直销最低认/申购金额的公告		
2	关于中泰证券（上海）资产管理有限公司旗下部分证券投资基金开展直销渠道申购费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-01-14
3	中泰蓝月短债债券型证券投资基金2021年第4季度报告	中国证监会规定网站	2022-01-20
4	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增交通银行股份有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-02-08
5	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增华夏财富投资管理有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-02-24
6	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增国金证券股份有限公司为销售机构公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-03-11
7	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增上海利得基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-03-17
8	中泰蓝月短债债券型证券投资基金2021年年度报告	中国证监会规定网站	2022-03-30
9	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-04-19



10	中泰蓝月短债债券型证券投资基金2022年第1季度报告	中国证监会规定网站	2022-04-21
11	中泰蓝月短债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2022-05-18
12	中泰蓝月短债债券型证券投资基金招募说明书(更新)2022年第1号	中国证监会规定网站	2022-05-18
13	中泰证券(上海)资产管理有限公司关于旗下部分基金新增国联证券股份有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-05-20
14	中泰证券(上海)资产管理有限公司关于旗下部分基金新增泰信财富基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-05-20
15	中泰证券(上海)资产管理有限公司关于旗下部分基金新增泛华普益基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-05-23
16	中泰证券(上海)资产管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启富基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-06-17
17	中泰证券(上海)资产管理有限公司关于旗下部分基金新增青岛银行股份有限公司为销售机构公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-06-17
18	中泰证券(上海)资产管理有限公司关于旗下部分基金	证券时报、中国证监会规定网站	2022-06-20

	新增华宝证券股份有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告		
19	中泰证券（上海）资产管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔最低认/申购金额、单笔最低赎回份额和最低持有份额数额限制的公告	证券时报、中国证监会规定网站	2022-06-29

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022年1月1日至2022年6月1日、2022年6月22日至2022年6月30日	19,330,175.91	0.00	0.00	19,330,175.91	22.42%
	2	2022年6月8日至2022年6月19日	0.00	22,982,178.28	22,982,178.28	0.00	0.00%

#### 产品特有风险

当本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况时，可能会引发以下风险：

- （1）流动性风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致本基金的流动性风险。
- （2）基金规模过小导致的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。
- （3）基金净值大幅波动的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因，可能会导致基金份额净值出现大幅波动。
- （4）基金合同提前终止的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产净值连续六十个工作日低于5000万元，本基金可能面临基金合同提前终止等情形。
- （5）巨额赎回的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能触发本基金巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。
- （6）份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险：当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

本基金管理人将通过完善的风险管理机制，有效管理上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中泰蓝月短债债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《中泰蓝月短债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中泰蓝月短债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中泰蓝月短债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 6、报告期内中泰蓝月短债债券型证券投资基金在规定报刊上各项公告的原稿；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人的办公场所，部分文件同时登载于基金管理人网站。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站查阅，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。

客户服务中心电话：400-821-0808

网站：<https://www.ztzqzg.com/>

中泰证券（上海）资产管理有限公司  
二〇二二年八月三十日