

# 天弘云商宝货币市场基金

## 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2023 年 03 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年03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。

本报告期自2022年01月01日起至2022年12月31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、基金净值表现及利润分配情况                  | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                          | 6  |
| 3.2 基金净值表现                               | 7  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                        | 9  |
| §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               | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                  | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明              | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望              | 13 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                  | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                 | 14 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                  | 15 |
| 4.9 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见        | 15 |
| §6 审计报告                                  | 16 |
| 6.1 审计报告基本信息                             | 16 |
| 6.2 审计报告的基本内容                            | 16 |
| §7 年度财务报表                                | 18 |
| 7.1 资产负债表                                | 18 |
| 7.2 利润表                                  | 20 |
| 7.3 净资产（基金净值）变动表                         | 22 |
| 7.4 报表附注                                 | 25 |
| §8 投资组合报告                                | 53 |
| 8.1 期末基金资产组合情况                           | 53 |
| 8.2 债券回购融资情况                             | 53 |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限                         | 54 |
| 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明          | 55 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                     | 55 |
| 8.6 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 | 55 |
| 8.7 “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       | 56 |
| 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细   | 56 |
| 8.9 投资组合报告附注                             | 57 |
| §9 基金份额持有人信息                             | 58 |

|   |    |
|---|----|
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....              | 58 |
| 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....             | 58 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....           | 58 |
| 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....   | 58 |
| §10 开放式基金份额变动.....                      | 59 |
| §11 重大事件揭示.....                         | 59 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                   | 59 |
| 11.2 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.....   | 59 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....        | 59 |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                     | 59 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 59 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....      | 59 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....             | 60 |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....              | 62 |
| 11.9 其他重大事件.....                        | 62 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 63 |
| 12.1 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..... | 63 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 63 |
| §13 备查文件目录.....                         | 63 |
| 13.1 备查文件目录.....                        | 63 |
| 13.2 存放地点.....                          | 64 |
| 13.3 查阅方式.....                          | 64 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 天弘云商宝货币市场基金        |
| 基金简称       | 天弘云商宝              |
| 基金主代码      | 001529             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2015年06月25日        |
| 基金管理人      | 天弘基金管理有限公司         |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 64,472,818,264.81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   | 本基金根据对短期利率变动的预测，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略，利用定性分析和定量分析方法，通过对短期金融工具的积极投资，在控制风险和保证流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。主要策略包括：资产配置策略、个券选择策略、久期策略、回购策略、套利策略、现金流管理策略。 |
| 业绩比较基准 | 同期七天通知存款利率（税后）  |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。  |

### 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     |      | 天弘基金管理有限公司   | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责 | 姓名   | 童建林          | 郭明           |
|        | 联系电话 | 022-83310208 | 010-66105799 |

|        |      |                               |                     |
|--------|------|-------------------------------|---------------------|
| 人      | 电子邮箱 | service@thfund.com.cn         | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 |      | 95046                         | 95588               |
| 传真     |      | 022-83865564                  | 010-66105798        |
| 注册地址   |      | 天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦23层 | 北京市西城区复兴门内大街55号     |
| 办公地址   |      | 天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层   | 北京市西城区复兴门内大街55号     |
| 邮政编码   |      | 300203                        | 100140              |
| 法定代表人  |      | 韩歆毅                           | 陈四清                 |

## 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              |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.thfund.com.cn |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人的办公地址  |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                   | 办公地址                        |
|--------|----------------------|-----------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | 中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼     |
| 注册登记机构 | 天弘基金管理有限公司           | 天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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 | 2022年 | 2021年 | 2020年 |
|--------------|-------|-------|-------|
|--------------|-------|-------|-------|

|                      |                   |                   |                   |
|----------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 标                    |                   |                   |                   |
| 本期已实现收益              | 1,241,971,179.94  | 1,584,943,664.94  | 1,481,183,475.88  |
| 本期利润                 | 1,241,971,179.94  | 1,584,943,664.94  | 1,481,183,475.88  |
| 本期净值收益率              | 1.9290%           | 2.3737%           | 1.9970%           |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 2022年末            | 2021年末            | 2020年末            |
| 期末基金资产净值             | 64,472,818,264.81 | 66,769,003,360.25 | 66,790,611,073.75 |
| 期末基金份额净值             | 1.0000            | 1.0000            | 1.0000            |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 2022年末            | 2021年末            | 2020年末            |
| 累计净值收益率              | 22.2430%          | 19.9295%          | 17.1487%          |

注：1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

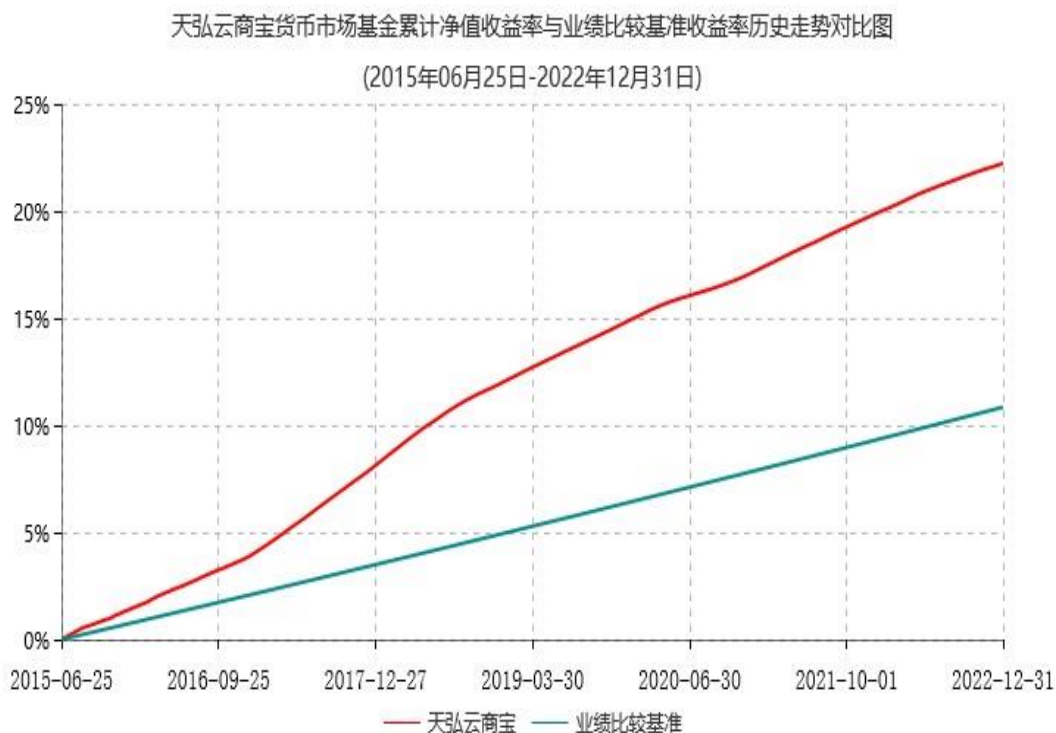
3、本基金的利润分配是按日结转份额。

## 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     |
|-----------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去三个月           | 0.4085%  | 0.0006%     | 0.3456%    | 0.0000%       | 0.0629%  | 0.0006% |
| 过去六个月           | 0.8593%  | 0.0008%     | 0.6924%    | 0.0000%       | 0.1669%  | 0.0008% |
| 过去一年            | 1.9290%  | 0.0011%     | 1.3781%    | 0.0000%       | 0.5509%  | 0.0011% |
| 过去三年            | 6.4323%  | 0.0011%     | 4.1955%    | 0.0000%       | 2.2368%  | 0.0011% |
| 过去五年            | 12.9904% | 0.0019%     | 7.0872%    | 0.0000%       | 5.9032%  | 0.0019% |
| 自基金合同生效日起至<br>今 | 22.2430% | 0.0026%     | 10.8503%   | 0.0000%       | 11.3927% | 0.0026% |

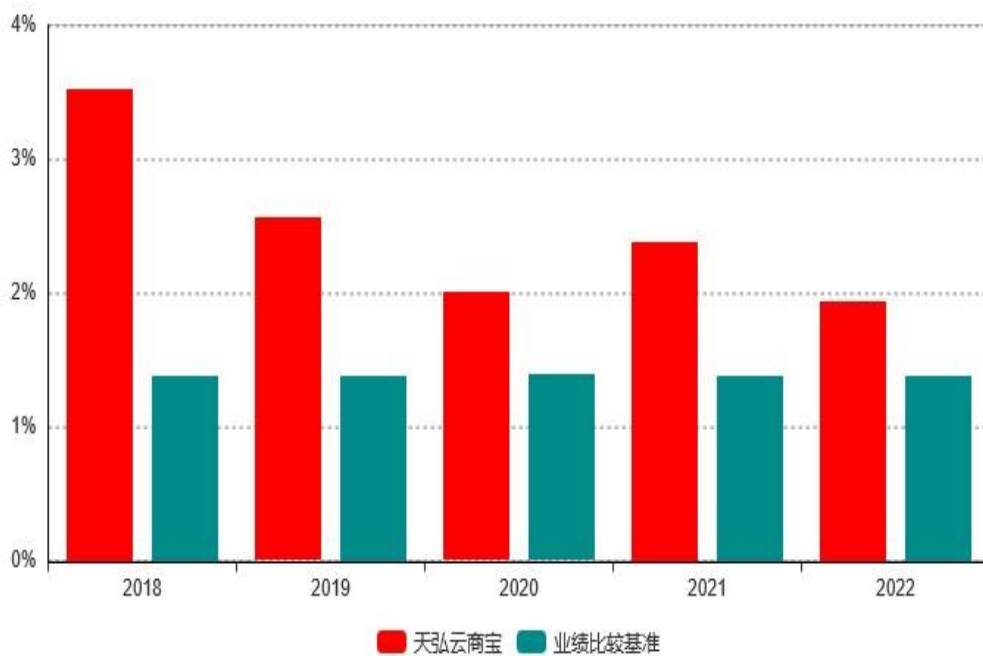
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



- 注：1、本基金合同于2015年06月25日生效。  
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度    | 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 | 年度利润分配合计         | 备注 |
|-------|------------------|---------------|----------|------------------|----|
| 2022年 | 1,241,971,179.94 | -             | -        | 1,241,971,179.94 | -  |
| 2021年 | 1,584,943,664.94 | -             | -        | 1,584,943,664.94 | -  |
| 2020年 | 1,481,183,475.88 | -             | -        | 1,481,183,475.88 | -  |
| 合计    | 4,308,098,320.76 | -             | -        | 4,308,098,320.76 | -  |

## §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

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立，注册资本为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、深圳、四川、浙江设有分公司。公司股权结构为：

| 股东名称                 | 股权比例  |
|----------------------|-------|
| 蚂蚁科技集团股份有限公司         | 51%   |
| 天津信托有限责任公司           | 16.8% |
| 内蒙古君正能源化工集团股份有限公司    | 15.6% |
| 芜湖高新投资有限公司           | 5.6%  |
| 新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙） | 3.5%  |
| 新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙） | 2%    |
| 新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙） | 2%    |
| 新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙） | 3.5%  |
| 合计                   | 100%  |

截至2022年12月31日，公司共管理运作170只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

#### 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 |        |   |
| 刘莹 | 本基金基金经理 | 2020年07月        | -    | 13年    | 女，管理科学与工程硕士。历任泰康资产管理有限公司交易员、信诚人寿保险有限公司研究员、南方基金管理有限公司基金经理、西南证券股份有限公司投资经理。2019年6月加盟本公司。 |
| 王登 | 本基金基金经理 | 2015            | -    | 13     | 男，经济学硕士。历任中   |

|         |           |                  |   |         |   |
|---------|-----------|------------------|---|---------|---|
| 峰       |           | 年06<br>月         |   | 年       | 信建投证券股份有限公司<br>固定收益部高级经理。201<br>2年5月加盟本公司，历任<br>本公司固定收益研究员<br>等。                      |
| 李一<br>纯 | 本基金基金经理助理 | 2022<br>年07<br>月 | - | 7<br>年  | 女，金融学硕士。历任泰<br>康资产管理有限责任公司<br>债券交易员；2017年6月加<br>盟本公司，历任债券交易<br>员、高级债券交易员、高<br>级宏观研究员。 |
| 田瑶      | 本基金基金经理助理 | 2018<br>年11<br>月 | - | 10<br>年 | 女，金融学硕士。2012年7<br>月加盟本公司，历任本公<br>司债券研究员、债券交易<br>员。                                    |

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、本基金基金经理助理协助基金经理进行投资、研究、头寸管理等日常工作。

3、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遵规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地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，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则，严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、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。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为4次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

### 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年宏观经济受疫情扰动较大，稳增长政策逐步出台。债券市场收益率3月到9月整体呈现持续下行态势，天弘云商宝采取了较为积极的久期策略。四季度，货币市场波动加大，经济筑底反弹的预期抬升，债券市场收益率出现较为明显的上行。天弘云商宝基金遵循资产配债相匹配的原则，稳步配置资产，并在适时增大配置力度。本基金在报告期内，为持有人创造了与风险相匹配的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2022年12月31日，本基金本报告期净值收益率为1.9290%，同期业绩比较基准收益率为1.3781%。

#### 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2023年，国内经济或呈恢复发展态势，疫情对经济的影响将大幅下降。政策方面，经济恢复的基础尚不牢固，预计货币政策将继续保持相对宽松，财政政策加力提效，起到提振内需的作用。我们认为，货币市场利率将围绕政策利率上下波动，较长的期限难以对组合形成有效的超额收益。2023年本基金仍将保持稳健的投资风格，以获取稳定的票息收益为主要目标。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，由独立的内控合规部门按照规定的权限和程序，认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行定期和不定期监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通，并定期制作监察稽核报告报公司董事会。公司经理层面成立了风险管理委员会，根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。

同时，本基金管理人根据全面性原则、独立性原则、相互制约原则、定性和定量相结合原则、重要性原则建立了一套比较完整的内部控制体系，该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息和沟通、监控等要素。本基金管理人已通过了ISAE3402（《国际鉴证业务准则第3402号》）认证，获得无保留意见的控制设计适当性报告。

本报告期，本基金管理人全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资、营销及后台运作等各环节的合法合规。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，完善内部控制，基金运作没有出现违规行为。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

- 1、在研究环节，加强研究业务独立性，注重程序合规和质量控制；在关注研究报告形式与内容的合法性基础上，跟踪检查投资备选库的入选、维护依据；进一步规范新股、新债询价、申购流程；定期检查关联方关系以及关联交易的日常维护；定期评估研究对投资的支持程度，对投资业绩的贡献度；

2、在投资交易环节，对投资运作过程中的风险点进行识别和监控，预防和控制由内部或外部流程、人员和系统失控而造成的损失；根据法律法规要求、基金合同约定、投资决策委员会的决定，适时提出增加或优化交易系统风控指标的建议，通过投资交易系统控制投资风险；跟踪每日的交易行为和交易结果，发现预警信息通过电话、邮件及合规提示及时提醒，保障投资环节的合规运作；监督检查各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的合规执行情况，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；

3、投资管理人员管理环节，加强对投资管理人员即时聊天工具、办公电话、移动电话、终端设备网上交易的合规监控，监督投资管理人员直系亲属账户及股票交易申报制度、交易时间移动电话集中保管制度的有效执行，采取各种有效方式杜绝老鼠仓、不公平交易及各种形式的利益输送行为；

4、基金募集与营销环节，对基金宣传推介材料及定投、费率优惠等基金销售业务活动进行事前合规检查，做到事前防范风险，保障基金营销合法合规。在基金利用互联网平台营销方面，对各类新兴业务的活动方案进行事前合规评估，保证业务开展的同时注重事前风险防范；

5、基金运营环节，加强对注册登记、会计核算、基金清算、估值业务的稽核力度，保证基金运营安全、准确；

6、信息披露环节，严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，保证信息披露的真实、准确、完整、及时。

报告期内，本基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施逐步完善，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续以合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，提高内部控制和风险管理的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会成员由公司分管投资的高级管理人员、督察长、首席风控官、分管估值业务高级管理人员以及研究管理人员组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜

任能力的基金经理（投资经理）、股票/债券研究员、基金运营部、风险管理部和内控合规部的相关人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据本基金合同及招募说明书（更新）等有关规定，本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人（该收益参与下一日的收益分配），并按自然日结转至基金份额持有人的基金账户。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

### **§5 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，本基金托管人在对天弘云商宝货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

本报告期内，天弘云商宝货币市场基金的管理人--天弘基金管理有限公司在天弘云商宝货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

#### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘云商宝货币市场基金 2022 年年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                       |
|------------|-----------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                     |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见               |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2023)第26324号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

|           |  |
|-----------|--|
| 审计报告标题    | 审计报告   |
| 审计报告收件人   | 天弘云商宝货币市场基金全体基金份额持有人   |
| 审计意见      | (一)我们审计的内容 我们审计了天弘云商宝货币市场基金(以下简称“天弘云商宝货币基金”)的财务报表,包括2022年12月31日的资产负债表,2022年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券基金业协会(以下简称“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,公允反映了天弘云商宝货币市场基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于天弘云商宝货币市场基金,并履行了职业道德方面的  |



|                 |  |
|-----------------|--|
|                 | 其他责任。  |
| 强调事项            | 无  |
| 其他事项            | 无  |
| 其他信息            | 无  |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>天弘云商宝货币基金的基金管理人天弘基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估天弘云商宝货币基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算天弘云商宝货币基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督天弘云商宝货币基金的财务报告过程。</p>   |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风</p> |

|           |  |
|-----------|--|
|           | <p>险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对天弘云商宝货币基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致天弘云商宝货币基金不能持续经营。(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)   |
| 注册会计师的姓名  | 张振波、林佳璐  |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼  |
| 审计报告日期    | 2023-03-28   |

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：天弘云商宝货币市场基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|----|-----|--------------------|---------------------|
|----|-----|--------------------|---------------------|

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                            |                             |
| 银行存款          | 7.4.7.1    | 28,941,529,676.29          | 22,858,567,272.58           |
| 结算备付金         |            | -                          | -                           |
| 存出保证金         |            | -                          | -                           |
| 交易性金融资产       | 7.4.7.2    | 24,056,813,334.65          | 36,075,832,781.18           |
| 其中：股票投资       |            | -                          | -                           |
| 基金投资          |            | -                          | -                           |
| 债券投资          |            | 24,056,813,334.65          | 36,075,832,781.18           |
| 资产支持证券投资      |            | -                          | -                           |
| 贵金属投资         |            | -                          | -                           |
| 其他投资          |            | -                          | -                           |
| 衍生金融资产        | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 买入返售金融资产      | 7.4.7.4    | 16,081,831,521.61          | 12,269,856,884.78           |
| 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         |            | -                          | -                           |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 7.4.7.5    | -                          | 260,401,486.03              |
| 资产总计          |            | 69,080,174,532.55          | 71,464,658,424.57           |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2021年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                            |                             |
| 短期借款          |            | -                          | -                           |

|             |         |                   |                   |
|-------------|---------|-------------------|-------------------|
| 交易性金融负债     |         | -                 | -                 |
| 衍生金融负债      | 7.4.7.3 | -                 | -                 |
| 卖出回购金融资产款   |         | 4,575,914,153.17  | 4,661,766,849.09  |
| 应付清算款       |         | -                 | -                 |
| 应付赎回款       |         | -                 | -                 |
| 应付管理人报酬     |         | 13,770,371.58     | 14,589,193.19     |
| 应付托管费       |         | 2,754,074.33      | 2,917,838.65      |
| 应付销售服务费     |         | 13,770,371.58     | 14,589,193.19     |
| 应付投资顾问费     |         | -                 | -                 |
| 应交税费        |         | 136,789.88        | 527,565.94        |
| 应付利润        |         | -                 | -                 |
| 递延所得税负债     |         | -                 | -                 |
| 其他负债        | 7.4.7.6 | 1,010,507.20      | 1,264,424.26      |
| 负债合计        |         | 4,607,356,267.74  | 4,695,655,064.32  |
| <b>净资产：</b> |         |                   |                   |
| 实收基金        | 7.4.7.7 | 64,472,818,264.81 | 66,769,003,360.25 |
| 其他综合收益      |         | -                 | -                 |
| 未分配利润       | 7.4.7.8 | -                 | -                 |
| 净资产合计       |         | 64,472,818,264.81 | 66,769,003,360.25 |
| 负债和净资产总计    |         | 69,080,174,532.55 | 71,464,658,424.57 |

注：报告截止日2022年12月31日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额64,472,818,264.81份。

## 7.2 利润表

会计主体：天弘云商宝货币市场基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

| 项目      | 附注号 | 本期<br>2022年01月01日至2<br>022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2<br>021年12月31日 |
|---------|-----|-----------------------------------|--|
| 一、营业总收入 |     | 1,665,471,228.27                  | 2,072,922,573.86                       |

|                       |          |                |                  |
|-----------------------|----------|----------------|------------------|
| 1.利息收入                |          | 922,888,586.47 | 2,071,762,711.55 |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.9  | 580,841,629.20 | 787,907,556.26   |
| 债券利息收入                |          | -              | 869,330,626.25   |
| 资产支持证券利息收入            |          | -              | -                |
| 买入返售金融资产收入            |          | 342,046,957.27 | 414,524,529.04   |
| 证券出借利息收入              |          | -              | -                |
| 其他利息收入                |          | -              | -                |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 742,582,641.80 | 1,159,862.31     |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.10 | -              | -                |
| 基金投资收益                |          | -              | -                |
| 债券投资收益                | 7.4.7.11 | 742,582,641.80 | 1,159,862.31     |
| 资产支持证券投资收益            | 7.4.7.12 | -              | -                |
| 贵金属投资收益               | 7.4.7.13 | -              | -                |
| 衍生工具收益                | 7.4.7.14 | -              | -                |
| 股利收益                  | 7.4.7.15 | -              | -                |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 |          | -              | -                |
| 其他投资收益                |          | -              | -                |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） |          | -              | -                |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -              | -                |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.16 | -              | -                |
| <b>减：二、营业总支出</b>      |          | 423,500,048.33 | 487,978,908.92   |
| 1. 管理人报酬              |          | 162,524,781.32 | 168,925,031.86   |
| 2. 托管费                |          | 32,504,956.27  | 33,785,006.27    |
| 3. 销售服务费              |          | 162,524,781.32 | 168,925,031.86   |

|                     |          |                  |                  |
|---------------------|----------|------------------|------------------|
| 4. 投资顾问费            |          | -                | -                |
| 5. 利息支出             |          | 64,978,683.08    | 115,139,087.96   |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | 64,978,683.08    | 115,139,087.96   |
| 6. 信用减值损失           | 7.4.7.17 | -                | -                |
| 7. 税金及附加            |          | 484,988.87       | 720,226.64       |
| 8. 其他费用             | 7.4.7.18 | 481,857.47       | 484,524.33       |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 1,241,971,179.94 | 1,584,943,664.94 |
| 减：所得税费用             |          | -                | -                |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 1,241,971,179.94 | 1,584,943,664.94 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |          | -                | -                |
| 六、综合收益总额            |          | 1,241,971,179.94 | 1,584,943,664.94 |

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：天弘云商宝货币市场基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31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） | 66,769,003,360.25             | -      | -     | 66,769,003,360.25 |
| 加：会计政策变更        | -                             | -      | -     | -                 |
| 前期差错更正          | -                             | -      | -     | -                 |
| 其他              | -                             | -      | -     | -                 |
| 二、本期期初净         | 66,769,003,360.               | -      | -     | 66,769,003,360.   |

|  |                                    |        |                   |                     |
|--|------------------------------------|--------|-------------------|---------------------|
| 资产（基金净值）                                 | 25                                 |        |                   | 25                  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -2,296,185,095.44                  | -      | -                 | -2,296,185,095.44   |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | -      | 1,241,971,179.94  | 1,241,971,179.94    |
| （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）      | -2,296,185,095.44                  | -      | -                 | -2,296,185,095.44   |
| 其中：1.基金申购款                               | 605,208,995,725.73                 | -      | -                 | 605,208,995,725.73  |
| 2.基金赎回款                                  | -607,505,180,821.17                | -      | -                 | -607,505,180,821.17 |
| （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） | -                                  | -      | -1,241,971,179.94 | -1,241,971,179.94   |
| （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）                          | 64,472,818,264.81                  | -      | -                 | 64,472,818,264.81   |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31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）                          | 66,790,611,073.75                  | -      | -                 | 66,790,611,073.75   |

|  |                     |   |                   |                     |
|--|---------------------|---|-------------------|---------------------|
| 值)                                       |                     |   |                   |                     |
| 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）                          | 66,790,611,073.75   | - | -                 | 66,790,611,073.75   |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -21,607,713.50      | - | -                 | -21,607,713.50      |
| （一）、综合收益总额                               | -                   | - | 1,584,943,664.94  | 1,584,943,664.94    |
| （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）      | -21,607,713.50      | - | -                 | -21,607,713.50      |
| 其中：1.基金申购款                               | 714,516,945,530.90  | - | -                 | 714,516,945,530.90  |
| 2.基金赎回款                                  | -714,538,553,244.40 | - | -                 | -714,538,553,244.40 |
| （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） | -                   | - | -1,584,943,664.94 | -1,584,943,664.94   |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -                   | - | -                 | -                   |
| 四、本期期末净                                  | 66,769,003,360.     | - | -                 | 66,769,003,360.     |



|          |    |  |  |    |
|----------|----|--|--|----|
| 资产（基金净值） | 25 |  |  | 25 |
|----------|----|--|--|----|

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

郭树强

薄贺龙

薄贺龙

-----

-----

-----

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

天弘云商宝货币市场基金(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[2015]1254号《关于准予天弘云商宝货币市场基金注册的批复》注册，由天弘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《天弘云商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，首次募集期间为2015年6月24日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,000,060,182.00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(2015)第830号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘云商宝货币市场基金基金合同》于2015年6月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,000,060,182.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘云商宝货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于以下金融工具：1、现金；2、期限在1年以内（含1年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；3、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；4、中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。法律法规或监管机构允许货币市场基金投资其他货币市场工具的，在不改变基金投资目标、投资策略，不改变基金风险收益特征的前提下，本基金可参与其他货币市场工具的投资，不需召开持有人大会。具体投资比例限制按照相关法律法规和监管规定执行。对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2023年3月28日批准报出。

### 7.4.2 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、《天弘云商宝货币市场基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 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12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 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。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 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。

### 7.4.4.4 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。

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。

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不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，同时以红利再投资方式集中支付累计收益。

#### 7.4.4.11 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。

#### 7.4.4.12 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(可转换债券和可交换债券除外)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(可转换债券和可交换债券除外)，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。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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号一套期会计》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,财政部于2022年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14号),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。

(i)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、买入返售金融资产和应收利息,金额分别为22,858,567,272.58元、12,269,856,884.78元和260,401,486.03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、买入返售金融资产和其他资产-应收利息,金额分别为22,873,840,480.43元、12,281,638,775.76元和0.00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36,075,832,781.18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36,309,179,168.38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、应付交易费用和应付利息,金额分别为4,661,766,849.09元、14,589,193.19元、2,917,838.65元、14,589,193.19元、641,397.52元和323,726.74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、其他负债-应付交易费用和其他负债-应付利息,金额分别为4,662,090,575.83元、14,589,193.19元、2,917,838.65元、14,589,193.19元、641,397.52元和0.00元。

i)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) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款         | 8,995,221.61       | 18,567,272.58       |
| 等于：本金        | 8,972,537.53       | 18,567,272.58       |
| 加：应计利息       | 22,684.08          | -                   |
| 减：坏账准备       | -                  | -                   |
| 定期存款         | 28,932,534,454.68  | 22,840,000,000.00   |
| 等于：本金        | 28,900,000,000.00  | 22,840,000,000.00   |
| 加：应计利息       | 32,534,454.68      | -                   |
| 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    | 28,932,534,454.68  | 22,840,000,000.00   |
| 其他存款         | -                  | -                   |
| 等于：本金        | -                  | -                   |
| 加：应计利息       | -                  | -                   |
| 减：坏账准备       | -                  | -                   |
| 合计           | 28,941,529,676.29  | 22,858,567,272.58   |

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2022年12月31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 | -                   | -                 | -             | -      |
|        | 银行间市场 | 24,056,813,334.65   | 24,076,388,094.01 | 19,574,759.36 | 0.0304 |
|        | 合计    | 24,056,813,334.65   | 24,076,388,094.01 | 19,574,759.36 | 0.0304 |
| 资产支持证券 |       | -                   | -                 | -             | -      |
| 合计     |       | 24,056,813,334.65   | 24,076,388,094.01 | 19,574,759.36 | 0.0304 |
| 项目     |       | 上年度末<br>2021年12月31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 | -                   | -                 | -             | -      |
|        | 银行间市场 | 36,075,832,781.18   | 36,123,998,000.00 | 48,165,218.82 | 0.0721 |
|        | 合计    | 36,075,832,781.18   | 36,123,998,000.00 | 48,165,218.82 | 0.0721 |
| 资产支持证券 |       | -                   | -                 | -             | -      |
| 合计     |       | 36,075,832,781.18   | 36,123,998,000.00 | 48,165,218.82 | 0.0721 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022年12月31日 |           |
|-------|--------------------|-----------|
|       | 账面余额               | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                  | -         |
| 银行间市场 | 16,081,831,521.61  | -         |
| 合计    | 16,081,831,521.61  | -         |
| 项目    | 上年度末               |           |

|       | 2021年12月31日       |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                 | -         |
| 银行间市场 | 12,269,856,884.78 | -         |
| 合计    | 12,269,856,884.78 | -         |

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|-------|--------------------|---------------------|
| 应收利息  | -                  | 260,401,486.03      |
| 其他应收款 | -                  | -                   |
| 待摊费用  | -                  | -                   |
| 合计    | -                  | 260,401,486.03      |

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | -                  | -                   |
| 应付证券出借违约金   | -                  | -                   |
| 应付交易费用      | 711,207.20         | 641,397.52          |
| 其中：交易所市场    | -                  | -                   |
| 银行间市场       | 711,207.20         | 641,397.52          |
| 应付利息        | -                  | 323,726.74          |
| 预提费用        | 299,300.00         | 299,300.00          |
| 合计          | 1,010,507.20       | 1,264,424.26        |

**7.4.7.7 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |                     |
|---------------|-------------------------------|---------------------|
|               | 基金份额（份）                       | 账面金额                |
| 上年度末          | 66,769,003,360.25             | 66,769,003,360.25   |
| 本期申购          | 605,208,995,725.73            | 605,208,995,725.73  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -607,505,180,821.17           | -607,505,180,821.17 |
| 本期末           | 64,472,818,264.81             | 64,472,818,264.81   |

注：申购含红利再投份额。

**7.4.7.8 未分配利润**

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分             | 未实现部分 | 未分配利润合计           |
|----------------|-------------------|-------|-------------------|
| 本期期初           | -                 | -     | -                 |
| 本期利润           | 1,241,971,179.94  | -     | 1,241,971,179.94  |
| 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        | -1,241,971,179.94 | -     | -1,241,971,179.94 |
| 本期末            | -                 | -     | -                 |

**7.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 |
|-----------|-----------------------------------|--|
| 活期存款利息收入  | 413,475.00                        | 530,171.03                             |
| 定期存款利息收入  | 580,428,154.20                    | 787,312,632.19                         |
| 其他存款利息收入  | -                                 | -                                      |
| 结算备付金利息收入 | -                                 | 64,753.04                              |

|    |                |                |
|----|----------------|----------------|
| 其他 | -              | -              |
| 合计 | 580,841,629.20 | 787,907,556.26 |

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未取得股票投资收益。

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                                   | 本期<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 |
|--------------------------------------|-----------------------------------|--|
| 债券投资收益——利息收入                         | 749,385,926.87                    | -                                      |
| 债券投资收益——买卖债券<br>(债转股及债券到期兑付)<br>差价收入 | -6,803,285.07                     | 1,159,862.31                           |
| 债券投资收益——赎回差价<br>收入                   | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益——申购差价<br>收入                   | -                                 | -                                      |
| 合计                                   | 742,582,641.80                    | 1,159,862.31                           |

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                              | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月<br>31日 |
|---------------------------------|-----------------------------------|--|
| 卖出债券(债转股<br>及债券到期兑付)<br>成交总额    | 77,204,391,832.25                 | 67,085,081,783.12                      |
| 减: 卖出债券(债<br>转股及债券到期兑<br>付)成本总额 | 76,582,411,030.55                 | 66,331,814,427.35                      |

|          |                |                |
|----------|----------------|----------------|
| 减：应计利息总额 | 628,784,086.77 | 752,107,493.46 |
| 减：交易费用   | -              | -              |
| 买卖债券差价收入 | -6,803,285.07  | 1,159,862.31   |

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未取得买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得其他衍生工具投资收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得股利收益。

#### 7.4.7.16 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间未取得其他收入。

#### 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生信用减值损失。

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022年01月01日至2022年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年<br>12月31日 |
|---------|-----------------------------------|--|
| 审计费用    | 170,000.00                        | 170,000.00                             |
| 信息披露费   | 120,000.00                        | 120,000.00                             |
| 证券出借违约金 | -                                 | -                                      |

|          |            |            |
|----------|------------|------------|
| 汇划手续费    | 156,383.66 | 156,555.00 |
| 银行间账户维护费 | 35,440.00  | 35,590.00  |
| 其他费用     | 33.81      | 2,379.33   |
| 合计       | 481,857.47 | 484,524.33 |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称                | 与本基金的关系               |
|----------------------|-----------------------|
| 天弘基金管理有限公司           | 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构 |
| 中国工商银行股份有限公司         | 基金托管人                 |
| 蚂蚁科技集团股份有限公司         | 基金管理人的股东              |
| 天津信托有限责任公司           | 基金管理人的股东              |
| 内蒙古君正能源化工集团股份有限公司    | 基金管理人的股东              |
| 芜湖高新投资有限公司           | 基金管理人的股东              |
| 新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东              |
| 新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东              |
| 新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东              |
| 新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东              |
| 天弘创新资产管理有限公司         | 基金管理人的全资子公司           |

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易



### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 162,524,781.32                | 168,925,031.86                     |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 62,018,071.34                 | 67,993,556.84                      |

注:1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.25%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×该日适用费率/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |
|----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 32,504,956.27                 | 33,785,006.27                      |

注:支付基金托管人中国工商银行股份有限公司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×该日适用费率/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 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<br>2022年01月01日至2022年12月31日      |  |
|----------------|------------------------------------|--|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |  |
| 天弘基金管理有限公司     | 1,740.50                           |  |
| 合计             | 1,740.50                           |  |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |  |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |  |
| 天弘基金管理有限公司     | 2,240.94                           |  |
| 合计             | 2,240.94                           |  |

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0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给天弘基金管理有限公司,再由天弘基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。销售服务费的计算公式为:

日销售服务费=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

| 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日      |        |      |       |      |                   |              |
|------------------------------------|--------|------|-------|------|-------------------|--------------|
| 银行间市场交易的各关联方名称                     | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购             |              |
|                                    | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额              | 利息支出         |
| 中国工商银行股份有限公司                       | -      | -    | -     | -    | 25,210,174,000.00 | 3,861,135.26 |
| 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |        |      |       |      |                   |              |
| 银行间市场交                             | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购             |              |

| 易的各关联方名称     | 基金买入           | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额              | 利息支出         |
|--------------|----------------|------|------|------|-------------------|--------------|
| 中国工商银行股份有限公司 | 653,934,563.69 | -    | -    | -    | 67,814,170,000.00 | 7,387,902.54 |

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期<br>2022年01月01日至2022年12月31日 |            | 上年度可比期间<br>2021年01月01日至2021年12月31日 |            |
|--------------|-------------------------------|------------|------------------------------------|------------|
|              | 期末余额                          | 当期利息收入     | 期末余额                               | 当期利息收入     |
| 中国工商银行股份有限公司 | 8,995,221.61                  | 413,475.00 | 18,567,272.58                      | 530,171.03 |

注：本基金由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管的银行存款，按银行同业利率或约定利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金**

单位：人民币元

| 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润<br>分配合计     | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|------------------|----|
| 1,241,971,179.94 | -                 | -            | 1,241,971,179.94 | -  |

注：本基金在本年度累计分配收益1,241,971,179.94元，其中以红利再投资方式结转入实收基金1,241,971,179.94元，计入应付收益科目0.00元。

**7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**7.4.12.2 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的股票。

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2022年12月31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4,575,914,153.17元，是以如下债券作为抵押：

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<br>单价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|-----------|-------------|------------|------------|---------|---------------|
| 102000989 | 20通用MTN001A | 2023-01-03 | 101.75     | 600,000 | 61,047,320.55 |
| 102001128 | 20中铁股MTN004 | 2023-01-03 | 101.41     | 348,000 | 35,290,918.36 |

|           |                 |            |        |            |                  |
|-----------|-----------------|------------|--------|------------|------------------|
| 112203030 | 22农业银行CD<br>030 | 2023-01-03 | 99.38  | 4,339,000  | 431,209,820.00   |
| 112203071 | 22农业银行CD<br>071 | 2023-01-03 | 99.15  | 8,000,000  | 793,200,000.00   |
| 112203109 | 22农业银行CD<br>109 | 2023-01-03 | 99.01  | 1,000,000  | 99,010,000.00    |
| 112206253 | 22交通银行CD<br>253 | 2023-01-03 | 99.01  | 6,999,000  | 692,970,990.00   |
| 112271277 | 22重庆银行CD<br>142 | 2023-01-03 | 99.07  | 2,259,000  | 223,799,130.00   |
| 112296176 | 22重庆银行CD<br>047 | 2023-01-03 | 99.46  | 2,011,000  | 200,014,060.00   |
| 180204    | 18国开04          | 2023-01-03 | 104.23 | 3,500,000  | 364,802,219.18   |
| 180211    | 18国开11          | 2023-01-03 | 102.43 | 6,000,000  | 614,593,150.68   |
| 220211    | 22国开11          | 2023-01-03 | 100.54 | 6,000,000  | 603,230,630.14   |
| 220304    | 22进出04          | 2023-01-03 | 101.29 | 6,000,000  | 607,731,780.82   |
| 220404    | 22农发04          | 2023-01-03 | 100.91 | 2,676,000  | 270,036,992.88   |
| 合计        |                 |            |        | 49,732,000 | 4,996,937,012.61 |

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年12月31日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，本基金投资于各类固定收益类金融工具，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责拟定公司风险管理战略，经董事会批准后组织实施；组织实施经董事会批准的年度风险预算、风险可容忍度限额及其他量化风险管理工具；根据公司总体风险控制目标，制定各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司就重大风险管理作出的决定或决议；听取并讨论会议议题，就重大风险管理事项形成决议；拟定或批准公司风险管理制度、流程。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，内控合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、大类风险的识别、计量和控制。风险管理部向公司首席风控官进行汇报。内审部对公司内部控制和风险管理的有效性，经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇报。

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。

#### **7.4.13.2 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和定期存款存放在本基金的托管人中国工商银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，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，不投资于短期信用评级在A-1级以下或长期信用评级在AAA级以下的债券，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。本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%。且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的净资产的10%。

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。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | 90,132,305.22       |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 2,463,827,452.88   | 6,988,342,375.88    |
| 合计     | 2,463,827,452.88   | 7,078,474,681.10    |

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 16,019,593,825.00  | 22,122,912,096.70   |
| 合计     | 16,019,593,825.00  | 22,122,912,096.70   |

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 4,410,413,553.90   | 5,173,008,012.81    |
| AAA以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 1,162,978,502.87   | 1,701,437,990.57    |
| 合计     | 5,573,392,056.77   | 6,874,446,003.38    |

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

#### 7.4.13.3 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12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有4,575,189,602.19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。

#### 7.4.13.3.1 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%。本期末，本基金前10名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为1.37%，本基金投资组合的平均剩余期限为108天，平均剩余存续期为108天。本基金持有的现金、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符合法律法规的相关要求。

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%。本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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交易对手管理制度：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。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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存款和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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2022 年 12 月 31 日  | 6 个月以内            | 6 个月-1 年         | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计                |
|--------------------------|-------------------|------------------|-------|-------|----------------|-------------------|
| <b>资产</b>                |                   |                  |       |       |                |                   |
| 银行存款                     | 22,939,652,454.07 | 6,001,877,222.22 | -     | -     | -              | 28,941,529,676.29 |
| 交易性金融资产                  | 22,840,508,999.55 | 1,216,304,335.10 | -     | -     | -              | 24,056,813,334.65 |
| 买入返售金融资产                 | 16,081,831,521.61 | -                | -     | -     | -              | 16,081,831,521.61 |
| 资产总计                     | 61,861,992,975.23 | 7,218,181,557.32 | -     | -     | -              | 69,080,174,532.55 |
| <b>负债</b>                |                   |                  |       |       |                |                   |
| 卖出回购金融资产款                | 4,575,914,153.17  | -                | -     | -     | -              | 4,575,914,153.17  |
| 应付管理人报酬                  | -                 | -                | -     | -     | 13,770,371.58  | 13,770,371.58     |
| 应付托管费                    | -                 | -                | -     | -     | 2,754,074.33   | 2,754,074.33      |
| 应付销售服务费                  | -                 | -                | -     | -     | 13,770,371.58  | 13,770,371.58     |
| 应交税费                     | -                 | -                | -     | -     | 136,789.88     | 136,789.88        |
| 其他负债                     | -                 | -                | -     | -     | 1,010,507.20   | 1,010,507.20      |
| 负债总计                     | 4,575,914,153.17  | -                | -     | -     | 31,442,114.57  | 4,607,356,267.74  |
| 利率敏感度缺口                  | 57,286,078,822.06 | 7,218,181,557.32 | -     | -     | -31,442,114.57 | 64,472,818,264.81 |
| 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日 | 6 个月以内            | 6 个月-1 年         | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计                |

|           |                   |                   |   |   |                |                   |
|-----------|-------------------|-------------------|---|---|----------------|-------------------|
| 资产        |                   |                   |   |   |                |                   |
| 银行存款      | 11,618,567,272.58 | 11,240,000,000.00 | - | - | -              | 22,858,567,272.58 |
| 交易性金融资产   | 27,975,649,573.46 | 8,100,183,207.72  | - | - | -              | 36,075,832,781.18 |
| 买入返售金融资产  | 12,269,856,884.78 | -                 | - | - | -              | 12,269,856,884.78 |
| 应收利息      | -                 | -                 | - | - | 260,401,486.03 | 260,401,486.03    |
| 资产总计      | 51,864,073,730.82 | 19,340,183,207.72 | - | - | 260,401,486.03 | 71,464,658,424.57 |
| 负债        |                   |                   |   |   |                |                   |
| 卖出回购金融资产款 | 4,661,766,849.09  | -                 | - | - | -              | 4,661,766,849.09  |
| 应付管理人报酬   | -                 | -                 | - | - | 14,589,193.19  | 14,589,193.19     |
| 应付托管费     | -                 | -                 | - | - | 2,917,838.65   | 2,917,838.65      |
| 应付销售服务费   | -                 | -                 | - | - | 14,589,193.19  | 14,589,193.19     |
| 应付交易费用    | -                 | -                 | - | - | 641,397.52     | 641,397.52        |
| 应交税费      | -                 | -                 | - | - | 527,565.94     | 527,565.94        |
| 应付利息      | -                 | -                 | - | - | 323,726.74     | 323,726.74        |
| 其他负债      | -                 | -                 | - | - | 299,300.00     | 299,300.00        |
| 负债总计      | 4,661,766,849.09  | -                 | - | - | 33,888,215.23  | 4,695,655,064.32  |
| 利率敏感度缺口   | 47,202,306,881.73 | 19,340,183,207.72 | - | - | 226,513,270.80 | 66,769,003,360.25 |

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                     |
|----|--------------------|---------------------------------|---------------------|
| 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<br>(单位：人民币元) |                     |
|    |                    | 本期末<br>2022年12月31日              | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|    | 市场利率下降25个基点        | 20,247,446.80                   | 29,994,091.86       |
|    | 市场利率上升25个基点        | -20,209,246.66                  | -29,930,657.24      |

#### 7.4.13.4.2 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。

### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于2022年12月31日，本基金未持有交易性权益类投资(2021年12月31日：同)。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2022年12月31日，本基金未持有交易性权益类投资(2021年12月31日：同)，因此其他价格风险对于本基金净资产无重大影响(2021年12月31日：同)。

## 7.4.14 公允价值

### 7.4.14.1 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。

### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2022年12月31日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | -                  | -                   |
| 第二层次          | 24,056,813,334.65  | 36,075,832,781.18   |
| 第三层次          | -                  | -                   |
| 合计            | 24,056,813,334.65  | 36,075,832,781.18   |

#### 7.4.14.2.2 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。

**7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

于2022年12月31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)。

**7.4.14.4 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。

**7.4.15 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。

**§8 投资组合报告****8.1 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            | 24,056,813,334.65 | 34.82        |
|    | 其中：债券             | 24,056,813,334.65 | 34.82        |
|    | 资产支持证券            | -                 | -            |
| 2  | 买入返售金融资产          | 16,081,831,521.61 | 23.28        |
|    | 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      | 28,941,529,676.29 | 41.90        |
| 4  | 其他各项资产            | -                 | -            |
| 5  | 合计                | 69,080,174,532.55 | 100.00       |

**8.2 债券回购融资情况**

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值比例(%) |           |
|----|--------------|--------------|-----------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 5.45         |           |
|    | 其中：买断式回购融资   | -            |           |
| 序号 | 项目           | 金额           | 占基金资产净值比例 |

|   |              |                  | (%)  |
|---|--------------|------------------|------|
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 4,575,914,153.17 | 7.10 |
|   | 其中：买断式回购融资   | -                | -    |

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值；对于货币市场基金，只要其投资的市场（如银行间市场）可交易，即可视为交易日，下同。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未有超过资产净值20%的情况。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 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    | 108 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 118 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 67  |

注：投资组合平均剩余期限指交易日的组合平均剩余期限，若报告期末为非交易日，“报告期末投资组合平均剩余期限”项目则列示非交易日的数据。

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

根据本货币市场基金基金合同的约定，其投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过120天。本报告期内，本货币市场基金投资组合平均剩余期限未发生超过120天的情况。

### 8.3.2 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                | 20.89              | 7.10               |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 2  | 30天(含)—60天           | 9.08               | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -                  | -                  |

|    |                      |        |      |
|----|----------------------|--------|------|
| 3  | 60天(含)—90天           | 17.49  | -    |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -      | -    |
| 4  | 90天(含)—120天          | 15.67  | -    |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -      | -    |
| 5  | 120天(含)—397天(含)      | 43.71  | -    |
|    | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -      | -    |
| 合计 |                      | 106.85 | 7.10 |

#### 8.4 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发生超过240天的情况。

#### 8.5 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<br>(%) |
|----|--------------------|-------------------|------------------|
| 1  | 国家债券               | -                 | -                |
| 2  | 央行票据               | -                 | -                |
| 3  | 金融债券               | 3,402,116,264.39  | 5.28             |
|    | 其中：政策性金融债          | 3,402,116,264.39  | 5.28             |
| 4  | 企业债券               | 145,226,796.99    | 0.23             |
| 5  | 企业短期融资券            | 40,554,472.04     | 0.06             |
| 6  | 中期票据               | 4,449,321,976.23  | 6.90             |
| 7  | 同业存单               | 16,019,593,825.00 | 24.85            |
| 8  | 其他                 | -                 | -                |
| 9  | 合计                 | 24,056,813,334.65 | 37.31            |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | -                 | -                |

#### 8.6 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  | 112203030 | 22农业银行C<br>D030   | 10,000,000 | 993,001,942.92 | 1.54         |
| 2  | 112203071 | 22农业银行C<br>D071   | 8,000,000  | 792,825,150.68 | 1.23         |
| 3  | 112206253 | 22交通银行C<br>D253   | 7,000,000  | 692,899,462.40 | 1.07         |
| 4  | 180211    | 18国开11            | 6,000,000  | 614,164,001.69 | 0.95         |
| 5  | 220401    | 22农发01            | 6,000,000  | 608,824,784.27 | 0.94         |
| 6  | 220304    | 22进出04            | 6,000,000  | 607,381,237.26 | 0.94         |
| 7  | 220404    | 22农发04            | 6,000,000  | 604,926,625.90 | 0.94         |
| 8  | 220211    | 22国开11            | 6,000,000  | 602,140,333.41 | 0.93         |
| 9  | 112271387 | 22重庆农村商<br>行CD230 | 6,000,000  | 594,273,722.00 | 0.92         |
| 10 | 112272104 | 22重庆农村商<br>行CD235 | 6,000,000  | 593,778,866.83 | 0.92         |

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

| 项目                           | 偏离情况     |
|------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | 0        |
| 报告期内偏离度的最高值                  | 0.1262%  |
| 报告期内偏离度的最低值                  | -0.0326% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值       | 0.0674%  |

注：表内各项数据均按报告期内的交易日统计。

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内，本货币市场基金投资组合未发生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

本报告期内，本货币市场基金投资组合未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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



本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额净值保持在人民币1.00元。

为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，应按其他公允指标对组合的账面价值进行调整，调整差额确认为“公允价值变动损益”，并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1.00元，可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

**8.9.2 本基金投资的前十名证券发行主体中，【国家开发银行】于2022年03月21日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报；【交通银行股份有限公司】分别于2022年03月21日、2022年09月09日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报；【中国进出口银行】于2022年03月21日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报；【中国农业发展银行】于2022年03月21日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报；【中国农业银行股份有限公司】分别于2022年03月21日、2022年09月30日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报；【重庆农村商业银行股份有限公司】分别于2022年01月25日、2022年11月11日收到中国银行保险监督管理委员会重庆监管局出具公开处罚的通报，于2022年06月08日收到中国人民银行重庆营业管理部出具公开处罚的通报。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。**

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 |
| 10,311,791 | 6,252.34  | 40,833,931,075.90 | 63.34% | 23,638,887,188.91 | 36.66% |

### 9.2 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  | 其他机构  | 162,282,796.97 | 0.25%  |
| 2  | 其他机构  | 92,367,675.46  | 0.14%  |
| 3  | 其他机构  | 90,102,042.36  | 0.14%  |
| 4  | 其他机构  | 86,682,154.83  | 0.13%  |
| 5  | 其他机构  | 86,161,658.23  | 0.13%  |
| 6  | 其他机构  | 83,230,267.86  | 0.13%  |
| 7  | 其他机构  | 79,927,798.78  | 0.12%  |
| 8  | 其他机构  | 69,076,861.99  | 0.11%  |
| 9  | 其他机构  | 68,939,343.93  | 0.11%  |
| 10 | 其他机构  | 66,213,409.05  | 0.10%  |

注：上述持有人类别严格按照XBRL模板中“银行类机构、保险类机构、券商类机构、信托类机构、基金类机构、其他机构、个人”进行分类。

### 9.3 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 | 119,265.09 | 0.00%    |

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|-------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研部 | 0~10              |

|                 |      |
|-----------------|------|
| 门负责人持有本开放式基金    |      |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                    |
|----------------------------|--------------------|
| 基金合同生效日(2015年06月25日)基金份额总额 | 2,000,060,182.00   |
| 本报告期期初基金份额总额               | 66,769,003,360.25  |
| 本报告期基金总申购份额                | 605,208,995,725.73 |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 607,505,180,821.17 |
| 本报告期期末基金份额总额               | 64,472,818,264.81  |

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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，常勇先生任职公司副总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金应向普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费170,000.00元。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务7年7个月。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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 |    |
| 安信证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 渤海证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 长城证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 长江证券 | 3      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东北证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东方证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东兴证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 方正证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 高华证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 光大证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国金证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国联证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国泰君安 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

|                |   |   |   |   |   |   |
|----------------|---|---|---|---|---|---|
| 证券             |   |   |   |   |   |   |
| 国信<br>证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通<br>证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安<br>证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万<br>宏源<br>证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西南<br>证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达<br>证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业<br>证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河<br>证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商<br>证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金<br>公司       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰<br>证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信<br>建投<br>证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信<br>证券       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信<br>证券<br>华南 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：中金公司北交所交易单元。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：东方证券上海交易单元、光大证券深圳交易单元。

### 11.8 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。

### 11.9 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  | 天弘基金管理有限公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告         | 中国证监会规定媒介 | 2022-01-04 |
| 2  | 天弘云商宝货币市场基金2021年第四季度报告                       | 中国证监会规定媒介 | 2022-01-24 |
| 3  | 天弘基金管理有限公司运用固有资金投资旗下公募基金的公告                  | 中国证监会规定媒介 | 2022-03-17 |
| 4  | 天弘云商宝货币市场基金2021年年度报告                         | 中国证监会规定媒介 | 2022-03-31 |
| 5  | 天弘云商宝货币市场基金2022年第一季度报告                       | 中国证监会规定媒介 | 2022-04-22 |
| 6  | 天弘基金管理有限公司关于终止深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2022-04-22 |
| 7  | 天弘基金管理有限公司关于设立浙江分公司公告                        | 中国证监会规定媒介 | 2022-04-26 |
| 8  | 天弘基金管理有限公司关于注销天津理财中心的公告                      | 中国证监会规定媒介 | 2022-05-06 |
| 9  | 天弘基金管理有限公司关于在网上直销交易系统开通中                     | 中国证监会规定媒介 | 2022-07-04 |

|    |                         |           |            |
|----|-------------------------|-----------|------------|
|    | 信银行快捷支付业务并实施相关费率优惠的公告   |           |            |
| 10 | 天弘云商宝货币市场基金2022年第二季度报告  | 中国证监会规定媒介 | 2022-07-21 |
| 11 | 天弘云商宝货币市场基金产品资料概要（更新）   | 中国证监会规定媒介 | 2022-08-11 |
| 12 | 天弘云商宝货币市场基金2022年中期报告    | 中国证监会规定媒介 | 2022-08-31 |
| 13 | 天弘云商宝货币市场基金招募说明书（更新）    | 中国证监会规定媒介 | 2022-10-21 |
| 14 | 天弘云商宝货币市场基金2022年第三季度报告  | 中国证监会规定媒介 | 2022-10-26 |
| 15 | 天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2022-11-19 |

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过本基金总份额20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》（财会(2017)7号）、《企业会计准则第23号—金融资产转移》（财会(2017)8号）、《企业会计准则第24号—套期会计》（财会(2017)9号）、《企业会计准则第37号—金融工具列报》（财会(2017)14号）和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22号）等相关规定，自2022年1月1日起，天弘基金管理有限公司旗下资产管理产品开始执行新金融工具相关会计准则。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告》。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘云商宝货币市场基金募集的文件
- 2、天弘云商宝货币市场基金基金合同

- 3、天弘云商宝货币市场基金托管协议
- 4、天弘云商宝货币市场基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

### 13.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：[www.thfund.com.cn](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司  
二〇二三年三月三十一日