

国泰瞬利交易型货币市场基金

2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

§1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国泰瞬利货币		
基金主代码	511620		
基金运作方式	交易型开放式		
基金合同生效日	2017 年 8 月 4 日		
报告期末基金份额总额	38,461,760,000.65 份		
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	<p>本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。</p> <p>1、本基金具体投资策略：（1）滚动配置策略；（2）久期控制策略；（3）套利策略；（4）时机选择策略。</p> <p>2、参与证券质押业务。</p> <p>3、资产支持证券投资策略。</p>		
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金为货币市场证券投资基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。		
基金管理人	国泰基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
下属两级基金的基金简称	国泰瞬利货币 A	国泰瞬利货币 D	国泰瞬利货币 E
下属两级基金的交易代码	511620	015379	015380
报告期末下属两级基金的份额总额	9,887,937.91 份	38,451,664,787.15 份	207,275.59 份

注：国泰瞬利货币A级的份额面值为人民币100元，国泰瞬利货币D级、国泰瞬利货币E级的份额面值为人民币1元。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)		
	国泰瞬利货币 A	国泰瞬利货币 D	国泰瞬利货币 E
1.本期已实现收益	2,882,453.25	170,691,551.69	977.58
2.本期利润	2,882,453.25	170,691,551.69	977.58
3.期末基金资产净值	988,793,790.97	38,451,664,787.15	207,275.59

注：(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、国泰瞬利货币 A:

阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5415%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.2012%	0.0007%
过去六个月	1.1041%	0.0006%	0.6768%	0.0000%	0.4273%	0.0006%
过去一年	2.0561%	0.0009%	1.3500%	0.0000%	0.7061%	0.0009%
过去三年	5.3019%	0.0015%	4.0491%	0.0000%	1.2528%	0.0015%
过去五年	7.1044%	0.0019%	6.7500%	0.0000%	0.3544%	0.0019%
自基金合同 生效起至今	8.9410%	0.0022%	8.3145%	0.0000%	0.6265%	0.0022%

2、国泰瞬利货币 D:

阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5415%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.2012%	0.0007%
过去六个月	1.1220%	0.0006%	0.6768%	0.0000%	0.4452%	0.0006%
过去一年	2.1962%	0.0008%	1.3500%	0.0000%	0.8462%	0.0008%
自新增 D 类 份额起至今	2.8607%	0.0016%	1.7716%	0.0000%	1.0891%	0.0016%

3、国泰瞬利货币 E:

阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标	①-③	②-④

				准差④		
过去三个月	0.4806%	0.0007%	0.3403%	0.0000%	0.1403%	0.0007%
过去六个月	1.0003%	0.0006%	0.6768%	0.0000%	0.3235%	0.0006%
过去一年	1.9521%	0.0008%	1.3500%	0.0000%	0.6021%	0.0008%
自新增 E 类 份额起至今	2.8956%	0.0015%	2.1045%	0.0000%	0.7911%	0.0015%

注：本基金收益分配按日结转份额。

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

国泰瞬利交易型货币市场基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

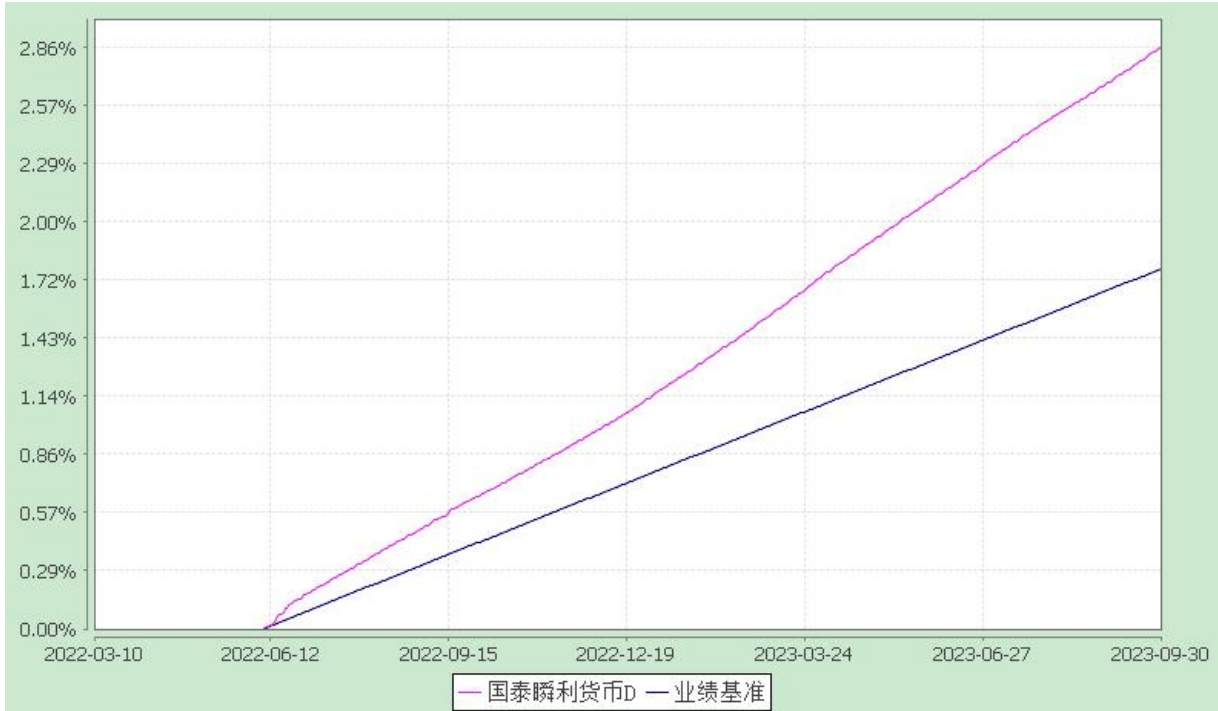
(2017 年 8 月 4 日至 2023 年 9 月 30 日)

1、国泰瞬利货币 A



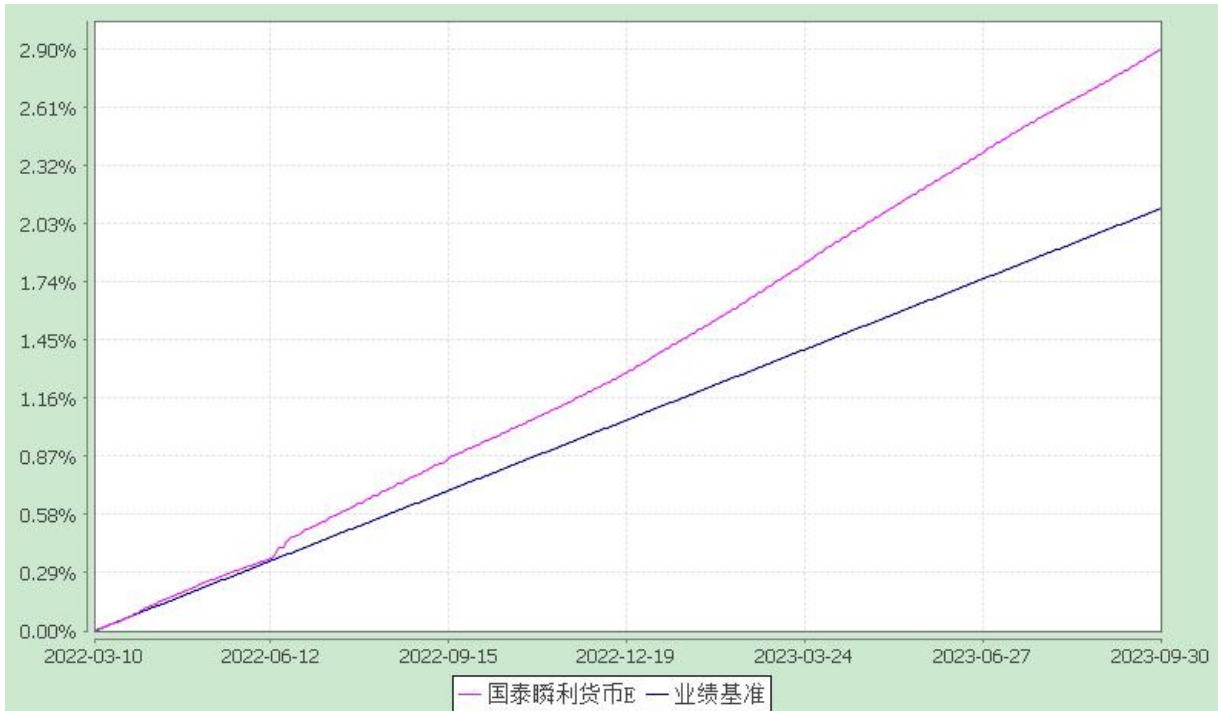
注：本基金的合同生效日为2017年8月4日。本基金在6个月建仓结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

2、国泰瞬利货币 D



注：本基金自2017年8月4日合同生效。本基金在6个月建仓结束时，各项资产配置比例符合合同约定。自2022年3月10日起，本基金增加D类份额并分别设置对应的基金代码。自2022年6月9日起，D类开始有份额并计算净值。

3、国泰瞬利货币 E



注：本基金的合同生效日为2017年8月4日。本基金在6个月建仓结束时，各项资产配置比例符合合同

约定。自2022年3月10日起，本基金增加E类份额并分别设置对应的基金代码。自2022年3月11日起，E类开始有份额并计算净值。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丁士恒	国泰利是宝货币、国泰惠鑫一年定期开放债券、国泰货币、国泰现金管理货币、国泰瞬利货币ETF、国泰利享中短债债券、国泰利享安益短债债券、国泰鑫鸿一年定期开放债券发起式的基金经理	2020-05-15	-	9年	硕士研究生。2014年1月加入国泰基金，任交易员。2020年5月起任国泰货币市场证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰利是宝货币市场基金、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金和国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2022年12月起兼任国泰利享安益短债债券型证券投资基金的基金经理，2023年8月起兼任国泰鑫鸿一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。
陶然	国泰利是宝货币、国泰货币、国泰瞬利货币ETF、国泰利享中短债债券、国泰利优30天滚动持有短债债券、国泰利泽90天滚动持有中短债债券、国泰中证同业存单AAA指数7天持有期、国泰利盈60天滚动持有中短债、国泰利安中短债债券的基金经理	2020-07-07	-	12年	硕士研究生，CFA。曾任职于海富通基金管理有限公司、华安基金管理有限公司、汇添富基金管理股份有限公司。2020年3月加入国泰基金，拟任基金经理。2020年7月至2022年8月任国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2020年7月至2022年11月任国泰现金管理货币市场基金的基金经理，2020年7月起任国泰货币市场证券投资基金、国泰利是宝货币市场基金、国泰瞬利交易型货

					<p>币市场基金和国泰利享中短债债券型证券投资基金的基金经理，2021年6月起兼任国泰利优30天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理，2021年8月起兼任国泰利泽90天滚动持有中短债债券型证券投资基金的基金经理，2022年5月起兼任国泰中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金的基金经理，2022年11月起兼任国泰利盈60天滚动持有中短债债券型证券投资基金的基金经理，2022年12月起兼任国泰利安中短债债券型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度债市多数期限收益率上行，短端上行幅度大于长端，曲线趋向于平坦化。7月公布的二季度经济数据大幅低于预期，显示内需仍然疲弱，债市做多基础仍在，流动性维持平稳宽松，但银行间杠杆水平较高，短端收益率窄幅波动。8月公布的7月社融数据大幅低于预期，央行超预期时点降息点燃债市做多情绪，但资金价格中枢略有上行，带动短端收益率下行后快速反弹。9月政府债供给增加，叠加季末因素资金面收紧，短端收益率大幅上行。三季度流动性略有收敛的趋势，DR007持续上行高于政策利率，3M Shibor 利率从 2.15%上行至 2.3%。

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

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类本报告期内的净值增长率为 0.5415%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

本基金 D 类本报告期内的净值增长率为 0.5415%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

本基金 E 类本报告期内的净值增长率为 0.4806%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	27,085,909,291.26	59.44
	其中：债券	26,995,560,191.43	59.24
	资产支持证券	90,349,099.83	0.20
2	买入返售金融资产	7,356,034,334.75	16.14
	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	11,126,862,553.26	24.42
4	其他资产	6,804.06	0.00
5	合计	45,568,812,983.33	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	9.15

	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	6,112,633,843.91	15.50
	其中：买断式回购融资	-	-

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	102
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	69

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合的平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	19.67	15.49
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	13.29	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	35.00	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	14.26	-
4	90天（含）—120天	5.34	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	41.82	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	115.11	15.49

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合的平均剩余存续期未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	228,019,135.53	0.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,975,168,115.94	20.22
	其中：政策性金融债	7,393,213,141.28	18.75
4	企业债券	144,023,422.91	0.37
5	企业短期融资券	5,354,115,722.82	13.58
6	中期票据	1,592,915,628.14	4.04
7	同业存单	11,701,318,166.09	29.67
8	其他	-	-
9	合计	26,995,560,191.43	68.45
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	5,630,023,286.77	14.27

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	220214	22 国开 14	36,900,000	3,687,369,631.15	9.35
2	230214	23 国开 14	15,400,000	1,542,953,596.95	3.91
3	230201	23 国开 01	14,800,000	1,501,987,909.11	3.81
4	112387343	23 湖南银行 CD143	10,000,000	988,532,761.22	2.51
5	112387008	23 江西银行 CD176	6,000,000	593,156,638.07	1.50
6	112387267	23 台州银行 CD057	5,000,000	497,393,146.89	1.26
7	112387411	23 四川银行 CD136	5,000,000	497,327,888.93	1.26
8	112387296	23 中原银行 CD333	5,000,000	494,197,159.54	1.25
9	092318004	23 农发清发 04	4,000,000	399,700,058.67	1.01
10	112387068	23 乌鲁木齐银行 CD127	4,000,000	395,348,617.75	1.00

5.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0 次
报告期内偏离度的最高值	0.1477%
报告期内偏离度的最低值	0.0167%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1126%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未出现负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	112706	恒信 03 优	900,000.00	90,349,099.83	0.23

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

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

本基金通过每日分红使基金 A 类份额资产净值维持在 100.00 元，D 类和 E 类份额资产净值维持在 1.00 元。

5.9.2 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“国开行、农发行、湖南银行、江西银行、四川银行、乌鲁木齐银行、中原银行”违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

国家开发银行下属分支机构因项目贷款“三查”不到位；内控制度执行不到位；未严格执行内控制度，瞒报案件风险信息；员工管理不到位；违规收取小微企业贷款承诺费；违规转嫁抵押登记费和押品评估费；向不合规的项目发放贷款；流动资金贷款受托支付审查不尽职，对同一贸易背景进行重复融资；固定资产贷款受托支付未收集用途资料，信贷资金挪用；信贷资金被挪用于归还借款人本行前期贷款本金；银团贷款贷后管理不尽职等原因，受到监管机构公开处罚。

农业发展银行下属分支机构因未按工程进度发放贷款；未落实内部授信审批条件发放贷款；未严格按照公布的收费价目名录收取融资顾问费；未按规定进行贷款资金支付管理与控制；贷款“三查”不到位；违规发放贷款增加地方政府隐性债务；项目贷款管理不审慎，资金未按约定用途使用等原因，受到监管机构公开处罚。

湖南银行及其下属分支机构因未按监管规定报送案件（风险）信息、贷款管理不到位；信用卡系统安全管理不到位，员工异常行为排查不到位等原因，受到监管机构公开处罚。

四川银行下属分支机构因内控管理不到位，违规发放借名贷款等原因，受到监管机构公开处罚。

江西银行及其下属分支机构因贷款管理不到位；作为银行间债券市场交易机构，为相关机构违规代他人持有债券提供了便利条件，内部未能有效识别交易风险或防范交易发生；未按规定核定董事、监事和高级管理人员年度薪酬方案；未按规定审批重大关联交易；内控管理不到位，以优惠利率发放关联自然人贷款；向关系人发放信用贷款；借新还旧、以贷还贷、以贷还息掩盖不良；违规处置不良，五级分类不准确；以本行出资、企业代持方式隐匿不良；投资收益违规处置不良；浮利分费；员工个人消费类贷款资金违规流入股市；个人综合消费类贷款约定用途为购房；银行资金违规用于

购地；银行资金违规投向股市；银行授信资金用于企业增资；向“四证”不全项目提供融资；资本计提不足；信贷资产虚假出表；入股资金来源于信贷资金；信贷资金违规用于购买本行股权等原因，受到监管机构公开处罚。

乌鲁木齐银行下属分支机构因贷款用途管控不到位，贷款资金回流借款人；未审慎开展个人住房贷款业务；以贷吸存、超过实际资金需求发放贷款，导致信贷资金空转；信贷资金被挪用；准贷记卡批量被他人使用等原因，受到监管机构公开处罚。

中原银行下属分支机构因违规发放借名贷款；存在贷前调查不尽职的违法违规行为；个人贷款贷后管理不审慎致使贷款资金被挪用；流动资金贷款贷后管理不审慎致使贷款资金回流；企业划型不准确导致数据错报等原因，受到监管机构公开处罚。

本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,804.06
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	6,804.06

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰瞬利货币A	国泰瞬利货币D	国泰瞬利货币E
本报告期期初基金份额总额	2,838,454.56	28,458,314,026.71	217,286.53
本报告期基金总申购份额	11,960,329.01	20,500,678,162.87	72,429.80
本报告期基金总赎回份额	4,910,845.66	10,507,327,402.43	82,440.74
报告期末基金份额总额	9,887,937.91	38,451,664,787.15	207,275.59

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	红利再投-E类	2023-07-03	17.53	0.00	-
2	红利再投-A类	2023-07-03	20.00	0.00	-
3	红利再投-A类	2023-07-04	7.00	0.00	-
4	红利再投-E类	2023-07-04	5.93	0.00	-
5	红利再投-E类	2023-07-05	5.52	0.00	-
6	红利再投-A类	2023-07-05	7.00	0.00	-

7	红利再投-E 类	2023-07-06	5.32	0.00	-
8	红利再投-A 类	2023-07-06	6.00	0.00	-
9	红利再投-A 类	2023-07-07	6.00	0.00	-
10	红利再投-E 类	2023-07-07	5.11	0.00	-
11	红利再投-A 类	2023-07-10	18.00	0.00	-
12	红利再投-E 类	2023-07-10	15.22	0.00	-
13	红利再投-A 类	2023-07-11	8.00	0.00	-
14	红利再投-E 类	2023-07-11	6.74	0.00	-
15	红利再投-E 类	2023-07-12	6.37	0.00	-
16	红利再投-A 类	2023-07-12	7.00	0.00	-
17	红利再投-A 类	2023-07-13	7.00	0.00	-
18	红利再投-E 类	2023-07-13	5.68	0.00	-
19	红利再投-A 类	2023-07-14	6.00	0.00	-
20	红利再投-E 类	2023-07-14	4.83	0.00	-
21	红利再投-E 类	2023-07-17	14.60	0.00	-
22	红利再投-A 类	2023-07-17	17.00	0.00	-
23	红利再投-A 类	2023-07-18	7.00	0.00	-
24	红利再投-E 类	2023-07-18	6.28	0.00	-
25	红利再投-A 类	2023-07-19	8.00	0.00	-
26	红利再投-E 类	2023-07-19	6.26	0.00	-
27	红利再投-E 类	2023-07-20	5.81	0.00	-
28	红利再投-A 类	2023-07-20	6.00	0.00	-
29	红利再投-A 类	2023-07-21	6.00	0.00	-
30	红利再投-E 类	2023-07-21	4.84	0.00	-
31	红利再投-E 类	2023-07-24	15.15	0.00	-
32	红利再投-A 类	2023-07-24	18.00	0.00	-
33	红利再投-E 类	2023-07-25	5.68	0.00	-
34	红利再投-A 类	2023-07-25	7.00	0.00	-
35	红利再投-E 类	2023-07-26	6.34	0.00	-
36	红利再投-A 类	2023-07-26	7.00	0.00	-
37	红利再投-E 类	2023-07-27	4.97	0.00	-
38	红利再投-A 类	2023-07-27	6.00	0.00	-
39	红利再投-E 类	2023-07-28	5.33	0.00	-
40	红利再投-A 类	2023-07-28	6.00	0.00	-
41	红利再投-A 类	2023-07-31	19.00	0.00	-
42	红利再投-E 类	2023-07-31	16.04	0.00	-
43	红利再投-E 类	2023-08-01	4.51	0.00	-
44	红利再投-A 类	2023-08-01	6.00	0.00	-
45	红利再投-E 类	2023-08-02	5.77	0.00	-
46	红利再投-A 类	2023-08-02	6.00	0.00	-
47	红利再投-A 类	2023-08-03	6.00	0.00	-
48	红利再投-E 类	2023-08-03	4.79	0.00	-
49	红利再投-A 类	2023-08-04	6.00	0.00	-
50	红利再投-E 类	2023-08-04	4.73	0.00	-
51	红利再投-A 类	2023-08-07	18.00	0.00	-
52	红利再投-E 类	2023-08-07	14.95	0.00	-

53	红利再投-E 类	2023-08-08	5.19	0.00	-
54	红利再投-A 类	2023-08-08	6.00	0.00	-
55	红利再投-E 类	2023-08-09	5.48	0.00	-
56	红利再投-A 类	2023-08-09	6.00	0.00	-
57	红利再投-E 类	2023-08-10	4.56	0.00	-
58	红利再投-A 类	2023-08-10	6.00	0.00	-
59	红利再投-E 类	2023-08-11	4.58	0.00	-
60	红利再投-A 类	2023-08-11	5.00	0.00	-
61	红利再投-E 类	2023-08-14	14.78	0.00	-
62	红利再投-A 类	2023-08-14	18.00	0.00	-
63	红利再投-A 类	2023-08-15	6.00	0.00	-
64	红利再投-E 类	2023-08-15	5.36	0.00	-
65	红利再投-A 类	2023-08-16	6.00	0.00	-
66	红利再投-E 类	2023-08-16	5.18	0.00	-
67	红利再投-E 类	2023-08-17	5.03	0.00	-
68	红利再投-A 类	2023-08-17	6.00	0.00	-
69	红利再投-A 类	2023-08-18	6.00	0.00	-
70	红利再投-E 类	2023-08-18	4.48	0.00	-
71	红利再投-A 类	2023-08-21	16.00	0.00	-
72	红利再投-E 类	2023-08-21	13.51	0.00	-
73	红利再投-A 类	2023-08-22	7.00	0.00	-
74	红利再投-E 类	2023-08-22	6.52	0.00	-
75	红利再投-E 类	2023-08-23	6.03	0.00	-
76	红利再投-A 类	2023-08-23	7.00	0.00	-
77	红利再投-E 类	2023-08-24	4.55	0.00	-
78	红利再投-A 类	2023-08-24	6.00	0.00	-
79	红利再投-E 类	2023-08-25	4.56	0.00	-
80	红利再投-A 类	2023-08-25	5.00	0.00	-
81	红利再投-E 类	2023-08-28	14.30	0.00	-
82	红利再投-A 类	2023-08-28	17.00	0.00	-
83	红利再投-E 类	2023-08-29	6.15	0.00	-
84	红利再投-A 类	2023-08-29	7.00	0.00	-
85	红利再投-E 类	2023-08-30	5.80	0.00	-
86	红利再投-A 类	2023-08-30	7.00	0.00	-
87	红利再投-A 类	2023-08-31	6.00	0.00	-
88	红利再投-E 类	2023-08-31	4.61	0.00	-
89	红利再投-A 类	2023-09-01	5.00	0.00	-
90	红利再投-E 类	2023-09-01	4.51	0.00	-
91	红利再投-E 类	2023-09-04	14.77	0.00	-
92	红利再投-A 类	2023-09-04	18.00	0.00	-
93	红利再投-E 类	2023-09-05	6.29	0.00	-
94	红利再投-A 类	2023-09-05	7.00	0.00	-
95	红利再投-A 类	2023-09-06	7.00	0.00	-
96	红利再投-E 类	2023-09-06	6.15	0.00	-
97	红利再投-A 类	2023-09-07	6.00	0.00	-
98	红利再投-E 类	2023-09-07	4.53	0.00	-

99	红利再投-A 类	2023-09-08	6.00	0.00	-
100	红利再投-E 类	2023-09-08	5.43	0.00	-
101	红利再投-E 类	2023-09-11	15.62	0.00	-
102	红利再投-A 类	2023-09-11	18.00	0.00	-
103	红利再投-A 类	2023-09-12	8.00	0.00	-
104	红利再投-E 类	2023-09-12	6.27	0.00	-
105	红利再投-A 类	2023-09-13	6.00	0.00	-
106	红利再投-E 类	2023-09-13	5.10	0.00	-
107	红利再投-E 类	2023-09-14	4.72	0.00	-
108	红利再投-A 类	2023-09-14	5.00	0.00	-
109	红利再投-A 类	2023-09-15	7.00	0.00	-
110	红利再投-E 类	2023-09-15	5.32	0.00	-
111	红利再投-A 类	2023-09-18	19.00	0.00	-
112	红利再投-E 类	2023-09-18	16.68	0.00	-
113	红利再投-E 类	2023-09-19	5.58	0.00	-
114	红利再投-A 类	2023-09-19	7.00	0.00	-
115	红利再投-A 类	2023-09-20	7.00	0.00	-
116	红利再投-E 类	2023-09-20	6.07	0.00	-
117	红利再投-E 类	2023-09-21	5.03	0.00	-
118	红利再投-A 类	2023-09-21	6.00	0.00	-
119	红利再投-E 类	2023-09-22	7.00	0.00	-
120	红利再投-A 类	2023-09-22	8.00	0.00	-
121	红利再投-E 类	2023-09-25	15.69	0.00	-
122	红利再投-A 类	2023-09-25	18.00	0.00	-
123	红利再投-E 类	2023-09-26	6.92	0.00	-
124	红利再投-A 类	2023-09-26	8.00	0.00	-
125	红利再投-E 类	2023-09-27	5.84	0.00	-
126	红利再投-A 类	2023-09-27	7.00	0.00	-
127	红利再投-A 类	2023-09-28	6.00	0.00	-
128	红利再投-E 类	2023-09-28	4.83	0.00	-
合计			1,040.32	0.00	

注：本基金管理人于本报告期内红利再投-A类本基金的适用费用为0.00元，份额面值为人民币100.00元。本基金管理人于本报告期内红利再投-E类本基金的适用费用为0.00元，份额面值为人民币1.00元。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、国泰瞬利交易型货币市场基金基金合同
- 2、国泰瞬利交易型货币市场基金托管协议
- 3、关于准予国泰瞬利交易型货币市场基金注册的批复
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

8.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

基金托管人住所。

8.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司
二〇二三年十月二十五日