

# 中泰锦泉汇金货币市场基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:中泰证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:中国证券登记结算有限责任公司

送出日期:2024 年 08 月 28 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本基金合同规定，于2024年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§ 2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
§ 4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作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	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§ 5	托管人报告.....	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1	资产负债表.....	14
6.2	利润表.....	16
6.3	净资产变动表.....	18
6.4	报表附注.....	20
§ 7	投资组合报告.....	39
7.1	期末基金资产组合情况.....	40
7.2	债券回购融资情况.....	40
7.3	基金投资组合平均剩余期限.....	40
7.4	报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	41
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6	期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	42
7.7	“影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离.....	43
7.8	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.....	43
7.9	投资组合报告附注.....	43
§ 8	基金份额持有人信息.....	44
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2	期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	44
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	45
§ 9	开放式基金份额变动.....	45

§ 10	重大事件揭示.....	45
10.1	基金份额持有人大会决议.....	45
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	45
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4	基金投资策略的改变.....	46
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	46
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	46
10.9	其他重大事件.....	47
§ 11	备查文件目录.....	47
11.1	备查文件目录.....	47
11.2	存放地点.....	48
11.3	查阅方式.....	48

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中泰锦泉汇金货币市场基金
基金简称	中泰锦泉汇金货币
基金主代码	014822
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年02月28日
基金管理人	中泰证券（上海）资产管理有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司
报告期末基金份额总额	3,983,786,890.25份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持相对流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将资产配置和精选个券相结合，在动态调整现金类资产与固定收益类资产的投资比例的基础上，精选优质个券构建投资组合，在严格控制风险的基础上，实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种，其预期风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中泰证券（上海）资产管理有限公司	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露负责人	姓名	王洪懿	陈晨
	联系电话	021-20521199	010-50938723
	电子邮箱	wanghy@ztzqzg.com	zctg@chinaclear.com.cn

客户服务电话	400-821-0808	4008-058-058
传真	021-50933716	-
注册地址	上海市黄浦区延安东路175号 24楼05室	北京市西城区太平桥大街17号
办公地址	上海市浦东新区银城中路488号 太平金融大厦1002-1003室	北京市西城区锦什坊街26号
邮政编码	200120	100033
法定代表人	黄文卿	于文强

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ztzqzg.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1002-1003室

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区锦什坊街26号

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期
	(2024年01月01日- 2024年06月30日)
本期已实现收益	24,417,773.21
本期利润	24,417,773.21
本期净值收益率	0.5991%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末

	(2024年06月30日)
期末基金资产净值	3,983,786,890.25
期末基金份额净值	1.0000
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2024年06月30日)
累计净值收益率	2.7217%

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，由于按摊余成本法核算的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。

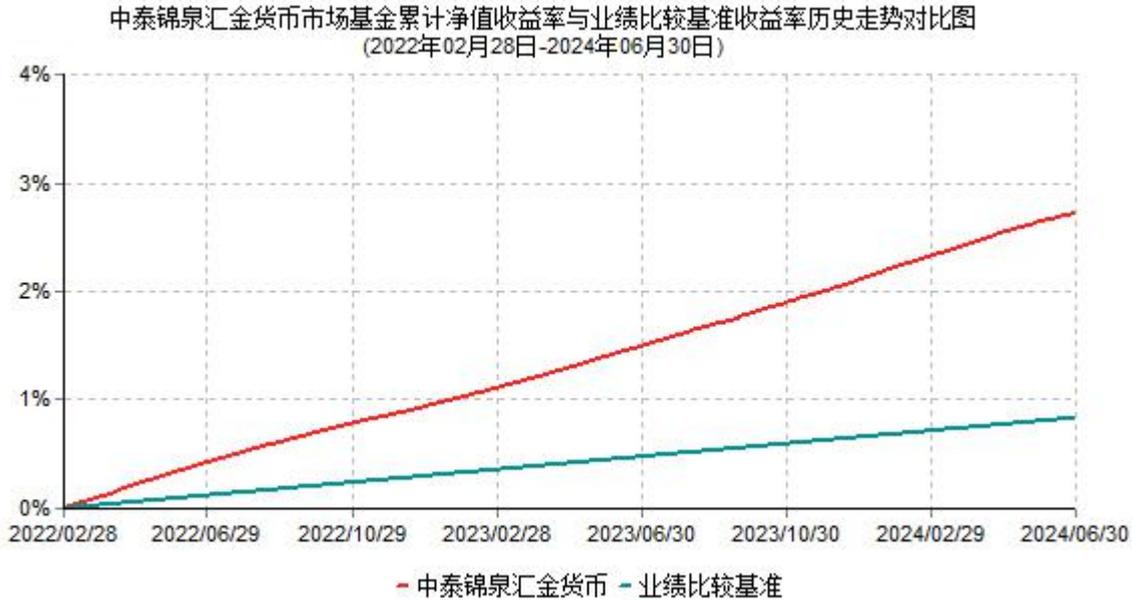
2、本基金利润分配是按月结转份额。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.0758%	0.0007%	0.0292%	0.0000%	0.0466%	0.0007%
过去三个月	0.2787%	0.0013%	0.0885%	0.0000%	0.1902%	0.0013%
过去六个月	0.5991%	0.0010%	0.1771%	0.0000%	0.4220%	0.0010%
过去一年	1.2057%	0.0011%	0.3565%	0.0000%	0.8492%	0.0011%
自基金合同生效起至今	2.7217%	0.0010%	0.8337%	0.0000%	1.8880%	0.0010%

#### 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: 本基金由齐鲁锦泉汇金集合资产管理计划变更而来。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中泰证券（上海）资产管理有限公司成立于2014年8月13日。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准齐鲁证券有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可[2014]355号）批准，是齐鲁证券有限公司（现已更名为“中泰证券股份有限公司”）出资设立的证券资产管理子公司。2017年12月，根据中国证券监督管理委员会《关于核准中泰证券（上海）资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可[2017]2342号）批准，公司获得开展公募基金业务资格。目前公司主要业务为证券资产管理业务和公开募集证券投资基金业务。截至2024年6月30日，公司作为基金管理人共管理中泰星元价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰玉衡价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰蓝月短债债券型证券投资基金、中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金、中泰青月中短债债券型证券投资基金、中泰中证500指数增强型证券投资基金、中泰沪深300指数增强型证券投资基金、中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金、中泰兴诚价值一年持有期混合型证券投资基金、中泰星宇价值成长混合型证券投资基金、中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金、中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金、中泰安睿债券型证券投资基金、中泰安益利率债债券型证券投资基金、中泰锦泉汇金货币市场基金、中泰兴为价值精选混合型证券投

资基金、中泰红利价值一年持有期混合型发起式证券投资基金、中泰红利优选一年持有期混合型发起式证券投资基金、中泰星汇优选平衡三个月持有期混合型基金中基金

(FOF)、中泰双利债券型证券投资基金、中泰安悦6个月定期开放债券型证券投资基金、中泰稳固30天持有期中短债债券型证券投资基金、中泰研究精选6个月持有期股票型证券投资基金、中泰元和价值精选混合型证券投资基金、中泰天择稳健6个月持有期混合型基金中基金(FOF)、中泰星锐景气成长混合型证券投资基金、中泰中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、中泰福瑞稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、中泰ESG主题6个月持有期混合型发起式证券投资基金和中泰红利量化选股股票型发起式证券投资基金共三十只证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
商园波	本基金基金经理；中泰蓝月短债债券型证券投资基金基金经理；中泰青月中短债债券型证券投资基金基金经理；中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金基金经理；中泰双利债券型证券投资基金基金经理；中泰稳固30天持有期中短债债券型证券投资基金基金经理；固收公募投资部副总经理。	2022-02-28	-	12	国籍：中国。学历：上海财经大学硕士研究生。具备证券从业资格和基金从业资格。曾任上海银行理财产品交易员、投资经理，上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益部投资经理。2014年8月加入中泰证券（上海）资产管理有限公司，历任金融市场部副总经理、基金业务部副总经理，现任固收公募投资部副总经理。2019年4月26日至今担任中泰蓝月短债债券型证券投资基金基金经理。2019年8月9日至今担任中泰青月中短债债券型证券投资基金基金经理。2021年

					7月21日至今担任中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金基金经理。2022年2月28日至今担任中泰锦泉汇金货币市场基金基金经理。2022年9月27日至今担任中泰双利债券型证券投资基金基金经理。2022年10月18日至今担任中泰稳固30天持有期中短债债券型证券投资基金基金经理。
王瑞	本基金基金经理；中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；中泰中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理。	2022-02-28	-	9	国籍：中国。学历：同济大学硕士研究生。具备证券从业资格和基金从业资格。曾任齐鲁证券有限公司资产管理分公司项目经理。2014年8月加入中泰证券（上海）资产管理有限公司，历任金融市场部投资经理助理、固定收益部投资经理助理、投资经理、基金业务部基金经理，现任固收公募投资部基金经理。2020年11月23日至今担任中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。2022年2月28日至今担任中泰锦泉汇金货币市场基金基金经理。2023年8月22日至今担任中泰中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理。

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

的解聘日期；

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未出现违反制度的情况。

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

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

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

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

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

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

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

本报告期内，公平交易分析基本结论如下：

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

本报告期内，未发生异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024年上半年，中国经济呈现波浪式复苏、新旧动能持续切换的特点。实际GDP同比增速一、二季度，分别为5.3%和4.7%。中国人民银行及时加大了逆周期调节力度，支持实体经济增长，具体措施包括在1月24日降准、2月20日大幅下调5年期LPR利率25bp、4月8日市场利率定价自律机制发布《关于禁止通过手工补息高息揽储维护存款市场竞争

秩序的倡议》，该政策推动存款利率市场化调整机制作用有效发挥，在改革中推动社会融资成本继续下降。

上半年债市收益率整体持续下行，仅4月末出现显著但短暂的回调。其中，1年期国债、10年期国债、10年期国开债、3年期AAA信用债、3年期AA+信用债、3年期AA信用债和3年期AA-信用债分别下行54BP、35BP、39BP、58BP、62BP、81BP和209BP。信用利差方面，3年AAA、3年AA+、3年AA和3年AA-分别变动-8BP、-12BP、-31BP和-159BP。

报告期内，市场资金整体宽松稳定，同业存单收益率和短期限高等级信用品种收益率整体呈现显著下行趋势。其中，1年期AAA信用债和1年期同业存单到期收益率下行幅度分别达到51BP和45BP。规模方面，春节前和一季度末本基金都出现一定的季节性赎回，但波动幅度整体可控；二季度规模相对稳定。操作方面，在保证充分流动性的前提下，本基金适当提高资产配置久期，并保持灵活的交易仓位，配置仍以大行、国股同业存单以及年内到期的同业存款为主。在确保产品的高安全性以及合理综合久期的前提下，为持有人提供较为稳定的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中泰锦泉汇金货币基金份额净值为1.0000元，本报告期内，基金份额净值收益率为0.5991%，同期业绩比较基准收益率为0.1771%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度经济数据显示，目前经济复苏呈现供给好于需求，外需好于内需的特征，经济复苏的基础还需巩固。地产部门的周期性调整，限制了信贷派生的动力和持续性，市场风险偏好偏低。5月以来，政策面密集推出一系列重磅措施以促进房地产市场健康发展，但新房和土地市场表现偏弱，房地产投资和销售仍在探底过程中。展望下半年，在市场内生动能企稳以及一系列稳增长政策发力的情况下，经济总体将处于向潜在增长中枢回归的过程，但恢复进程或将缓慢曲折，居民消费能力和消费信心提升是关键。通胀数据有望保持低位，暂时未构成对货币政策的紧缩压力。货币与财政政策加大协调配合力度，债市继续处于宽松的友好环境。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金利润分配按日分配，按月结转份额。本基金本报告期内已根据基金合同和相关法律法规的规定进行了利润分配。详见6.4.11利润分配情况。

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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了监督和复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其内容真实、准确和完整。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：中泰锦泉汇金货币市场基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,863,848,445.73	1,907,558,908.91
结算备付金		3,558,027.60	12,139,352.52
存出保证金		27,706.96	123,631.63
交易性金融资产	6.4.7.2	2,049,523,164.45	2,201,311,455.58
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,049,523,164.45	2,201,311,455.58
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	200,053,235.61	62,089,313.65
应收清算款		-	19,995,342.40
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		4,117,010,580.35	4,203,218,004.69
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		126,173,880.90	483,482,942.93

应付清算款		2,008,178.10	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,151,717.98	3,066,484.29
应付托管费		175,095.44	170,360.23
应付销售服务费		875,477.26	851,801.17
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,063.74	13,249.00
应付利润		676,344.52	1,015,761.11
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	158,932.16	268,368.43
负债合计		133,223,690.10	488,868,967.16
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	3,983,786,890.25	3,714,349,037.53
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		3,983,786,890.25	3,714,349,037.53
负债和净资产总计		4,117,010,580.35	4,203,218,004.69

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额3,983,786,890.25份。

## 6.2 利润表

会计主体：中泰锦泉汇金货币市场基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		52,001,186.12	63,731,588.16
1.利息收入		23,460,633.52	27,937,657.40
其中：存款利息收入	6.4.7.9	23,210,761.98	26,811,356.84
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息		-	-

收入			
买入返售金融资产收入		249,871.54	1,126,300.56
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		28,540,552.60	35,793,930.75
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	28,540,552.60	35,793,930.75
资产支持证券投资		-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-	0.01
<b>减：二、营业总支出</b>		27,583,412.91	35,984,045.52
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	18,341,098.54	22,585,228.42
2.托管费	6.4.10.2.2	1,018,949.85	1,254,734.81
3.销售服务费	6.4.10.2.3	5,094,749.72	6,273,674.70
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		2,955,845.85	5,664,302.87
其中：卖出回购金融资产支出		2,955,845.85	5,664,302.87
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		4,144.57	7,998.71

8.其他费用	6.4.7.16	168,624.38	198,106.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		24,417,773.21	27,747,542.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		24,417,773.21	27,747,542.64
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		24,417,773.21	27,747,542.64

### 6.3 净资产变动表

会计主体：中泰锦泉汇金货币市场基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,714,349,037.53	-	3,714,349,037.53
二、本期期初净资产	3,714,349,037.53	-	3,714,349,037.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	269,437,852.72	-	269,437,852.72
（一）、综合收益总额	-	24,417,773.21	24,417,773.21
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	269,437,852.72	-	269,437,852.72
其中：1.基金申购款	42,414,224,807.51	-	42,414,224,807.51

2.基金赎回款	-42,144,786,954.79	-	-42,144,786,954.79
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-24,417,773.21	-24,417,773.21
四、本期期末净资产	3,983,786,890.25	-	3,983,786,890.25
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,372,110,116.76	-	4,372,110,116.76
二、本期期初净资产	4,372,110,116.76	-	4,372,110,116.76
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-78,656,102.02	-	-78,656,102.02
(一)、综合收益总额	-	27,747,542.64	27,747,542.64
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-78,656,102.02	-	-78,656,102.02
其中：1.基金申购款	51,341,158,410.89	-	51,341,158,410.89
2.基金赎回款	-51,419,814,512.91	-	-51,419,814,512.91
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少)	-	-27,747,542.64	-27,747,542.64

以“-”号填列)			
四、本期期末净资产	4,293,454,014.74	-	4,293,454,014.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

黄文卿

应晨奇

陈勇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中泰锦泉汇金货币市场基金(以下简称“本基金”)由齐鲁锦泉汇金集合资产管理计划变更而来。根据中国证监会《关于准予齐鲁锦泉汇金集合资产管理计划变更注册的批复》(证监许可[2021]4160号)及本基金的基金管理人中泰证券(上海)资产管理有限公司于2022年2月28日发布的《齐鲁锦泉汇金集合资产管理计划正式变更为中泰锦泉汇金货币市场基金及基金合同生效公告》，自2022年2月28日起，齐鲁锦泉汇金集合资产管理计划正式变更为中泰锦泉汇金货币市场基金，《中泰锦泉汇金货币市场基金基金合同》自该日起生效，原齐鲁锦泉汇金集合资产管理计划份额变更为中泰锦泉汇金货币市场基金基金份额。本基金为契约型开放式基金，基金存续期限不定。本基金的基金管理人为中泰证券(上海)资产管理有限公司，基金托管人为中国证券登记结算有限责任公司。本基金自2022年2月28日起开放日常申购业务和赎回业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中泰锦泉汇金货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括：现金；期限在1年以内(含1年)的银行存款、中央银行票据、同业存单；期限在1个月以内的债券回购；剩余期限在397天以内(含397天)的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人中泰证券(上海)资产管理有限公司于2024年8月27日批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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》、《中泰锦泉汇金货币市场基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金2024年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2024年6月30日的财务状况以及2024年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于

租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	1,059,534,071.75
等于：本金	1,058,870,254.78
加：应计利息	663,816.97
减：坏账准备	-
定期存款	804,314,373.98
等于：本金	800,000,000.00
加：应计利息	4,314,373.98
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	50,406,708.62
存款期限1-3个月	453,502,832.11
存款期限3个月以上	300,404,833.25
其他存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,863,848,445.73

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年06月30日			
		按实际利率计算的 账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	132,916,016.65	132,790,312.88	-125,703.77	-0.0032
	银行间市场	1,916,607,147.80	1,918,402,726.93	1,795,579.13	0.0451
	合计	2,049,523,164.45	2,051,193,039.81	1,669,875.36	0.0419
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	2,049,523,164.45	2,051,193,039.81	1,669,875.36	0.0419

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	200,053,235.61	-
合计	200,053,235.61	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	
	2024年06月30日	
应付券商交易单元保证金		-
应付赎回费		-
应付交易费用		50,178.26
其中：交易所市场		5,727.33
银行间市场		44,450.93
应付利息		-
预提费用-审计费		39,781.56
预提费用-信息披露费		59,672.34
预提费用-账户维护费		9,300.00
合计		158,932.16

## 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,714,349,037.53	3,714,349,037.53
本期申购	42,414,224,807.51	42,414,224,807.51
本期赎回（以“-”号填列）	-42,144,786,954.79	-42,144,786,954.79
本期末	3,983,786,890.25	3,983,786,890.25

## 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	24,417,773.21	-	24,417,773.21

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	-24,417,773.21	-	-24,417,773.21
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
活期存款利息收入	14,077,697.78	
定期存款利息收入	9,084,521.37	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	48,273.09	
其他	269.74	
合计	23,210,761.98	

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
债券投资收益——利息收入	27,857,734.47	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	682,818.13	
债券投资收益——赎回差价收入	-	
债券投资收益——申购差价收入	-	
合计	28,540,552.60	

**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,846,561,346.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,836,935,768.49
减：应计利息总额	8,942,759.49
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	682,818.13

**6.4.7.12 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.13 股利收益**

本基金本报告期无股利收益。

**6.4.7.14 公允价值变动收益**

本基金本报告期无公允价值变动收益。

**6.4.7.15 其他收入**

本基金本报告期无其他收入。

**6.4.7.16 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	59,672.34

汇划手续费	49,990.48
账户维护费	18,600.00
其他费用	580.00
合计	168,624.38

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“中泰资管”）	基金管理人
中泰证券股份有限公司（以下简称“中泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国证券登记结算有限责任公司	基金托管人、注册登记机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
中泰证券	120,366,900.00	100.00%	663,025,560.00	100.00%

## 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
中泰证券	4,697,090,000.00	100.00%	10,017,546,000.00	100.00%

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
中泰证券	12,952.51	100.00%	5,727.33	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期	期末应付佣金余额	占期末应

		佣金总量的比例		付佣金总额的比例
中泰证券	32,783.15	100.00%	20,968.66	100.00%

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

2.管理人从关联方获得的服务包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,341,098.54	22,585,228.42
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,039,745.78	10,986,591.99
应支付基金管理人的净管理费	9,301,352.76	11,598,636.43

注：支付基金管理人中泰资管的管理人报酬按前一日基金资产净值0.90%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值X0.90%/当年天数。如果以0.90%的管理费计算的基金七日年化暂估收益率小于或等于两倍的活期银行存款利率，基金管理人将调整管理费率为0.25%，本报告期未发生此种情形。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,018,949.85	1,254,734.81

注：支付基金托管人中国证券登记结算有限责任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X0.05%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中泰证券	5,094,749.72
合计	5,094,749.72
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中泰证券	6,273,674.70
合计	6,273,674.70

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，按月支付给中泰资管，再由中泰资管计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% ÷ 当年天数

2022年2月28日（含）至2022年8月31日（含）优惠期的销售服务费率0.225%，到期恢复至正常费率0.25%。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中泰证券	14,268,000.00	0.3600%	22,180,000.00	0.6000%

注：“中泰证券股份有限公司（锦泉汇金快速取现专户）”的账户余额为基金管理人为客户提供“T+0快速取现”业务，非交易过户后产生的份额。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国证券登记结算有限责任公司	2,195,572.96	81,647.02	629,627.69	323,319.64

注：本基金的银行存款由基金托管人中国证券登记结算有限责任公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 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 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润 分配合计	备注
24,632,117.63	125,072.17	-339,416.59	24,417,773.21	-

**6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金未因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2024年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额50,010,273.97元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
112406183	24交通银行CD183	2024-07-01	98.12	500,000	49,059,268.76
112405054	24建设银行CD054	2024-07-01	98.53	100,000	9,853,389.16
合计				600,000	58,912,657.92

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末2024年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额76,163,606.93元，于2024年7月1日、2024年7月2日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

**6.4.13 金融工具风险及管理**

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理包括事前控制、事中控制和事后控制。

事前控制流程包括：投资与研究部门根据宏观经济形势、财政与货币政策趋势、行业景气度、证券市场走势，提出资产配置策略建议，构建备选库。专业投资委员会根据投资与研究部门的研究成果，确立股票池、债券库和策略库的建立和调整方案，决定本委员会下属的各项资产管理产品的资产配置策略或者交易策略；评估本委员会下属的各

项资产管理产品的风险。风险控制委员会负责建立公司全面风险管理体系，对公司重大业务和管理工作的风险进行评估并对重大风险的处理方案进行审核。风险管理部根据专业投资委员会制定的投资策略和资产配置方案，协助专业投资委员会进行投资策略的风险检验，以及制定相应的投资风险控制标准。

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

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

#### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务的行

为。无论是整体市场投资者的信用偏好变化，还是基金具体投资债券和上市公司的信用恶化，都会对本基金的回报带来负面影响。另外，信用评级调整也会带来相应风险。当信用评级机构调低本基金所持有的债券的信用级别时，债券的价格会下跌，从而导致本基金的收益下降。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了证券及交易对手库管理办法，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化组合投资以分散信用风险；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%。管理人实行交易对手白名单制度，并根据交易对手的资信状况分别限定交易额度。

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	20,314,673.97	40,426,827.40
A-1以下	-	-
未评级	60,542,727.72	151,292,480.82
合计	80,857,401.69	191,719,308.22

注：本基金持有的短期未评级债券为短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-

A-1以下	-	-
未评级	1,825,092,368.69	1,754,379,987.61
合计	1,825,092,368.69	1,754,379,987.61

#### 6.4.13.2.3 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	133,318,896.75	234,830,132.52
AAA以下	-	-
未评级	10,254,497.32	20,382,027.23
合计	143,573,394.07	255,212,159.75

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

本报告期末，除卖出回购金融资产将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过240天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；当本基金前10名份额持有人

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的10%。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

2024年06月30日							
资产							
货币资金	1,109,940,780.37	453,502,832.11	300,404,833.25	-	-	-	1,863,848,445.73
结算备付金	3,558,027.60	-	-	-	-	-	3,558,027.60
存出保证金	27,706.96	-	-	-	-	-	27,706.96
交易性金融资产	331,707,621.19	420,327,320.31	1,297,488,222.95	-	-	-	2,049,523,164.45
买入返售金融资产	200,053,235.61	-	-	-	-	-	200,053,235.61
资产总计	1,645,287,371.73	873,830,152.42	1,597,893,056.20	-	-	-	4,117,010,580.35
负债							
卖出回购金融资产款	126,173,880.90	-	-	-	-	-	126,173,880.90
应付清算款	-	-	-	-	-	2,008,178.10	2,008,178.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,151,717.98	3,151,717.98
应付托管费	-	-	-	-	-	175,095.44	175,095.44
应付销售服务费	-	-	-	-	-	875,477.26	875,477.26
应交税费	-	-	-	-	-	4,063.74	4,063.74
应付利润	-	-	-	-	-	676,344.52	676,344.52
其他负债	-	-	-	-	-	158,932.16	158,932.16
负债总计	126,173,880.90	-	-	-	-	7,049,809.20	133,223,690.10
利率敏感度缺口	1,519,113,490.83	873,830,152.42	1,597,893,056.20	-	-	-7,049,809.20	3,983,786,890.25
上年度末 2023年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,305,007,756.39	482,202,818.72	120,348,333.80	-	-	-	1,907,558,908.91
结算备付金	12,139,352.52	-	-	-	-	-	12,139,352.52
存出保证金	123,631.63	-	-	-	-	-	123,631.63
交易性金融资产	101,272,743.61	279,856,781.54	1,820,181,930.43	-	-	-	2,201,311,455.58
买入返售金融资产	62,089,313.65	-	-	-	-	-	62,089,313.65
应收清算款	-	-	-	-	-	19,995,342.40	19,995,342.40
资产总计	1,480,632,797.80	762,059,600.26	1,940,530,264.23	-	-	19,995,342.40	4,203,218,004.69
负债							
卖出回购金融资产款	483,482,942.93	-	-	-	-	-	483,482,942.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,066,484.29	3,066,484.29
应付托管费	-	-	-	-	-	170,360.23	170,360.23
应付销售服务费	-	-	-	-	-	851,801.17	851,801.17
应交税费	-	-	-	-	-	13,249.00	13,249.00

应付利润	-	-	-	-	-	1,015,761.11	1,015,761.11
其他负债	-	-	-	-	-	268,368.43	268,368.43
负债总计	483,482,942.93	-	-	-	-	5,386,024.23	488,868,967.16
利率敏感度缺口	997,149,854.87	762,059,600.26	1,940,530,264.23	-	-	14,609,318.17	3,714,349,037.53

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假设 1、该利率敏感性分析基于本基金资产负债表日的风险状况；2、该利率敏感性分析假定市场利率变化只对基金组合中的债券类资产估值产生影响，对其他会计科目的影响忽略不计；3、该利率敏感性分析假定所有期限市场即期利率曲线平行移动25BP，且除利率之外的其他市场变量保持不变。4、该利率敏感性分析不考虑交易所可转换公司债券及可交换公司债券。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率上升25BP	-2,082,182.09	-1,859,051.60
	市场利率下降25BP	2,088,379.81	1,862,787.06

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

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

#### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	2,049,523,164.45	2,201,311,455.58
第三层次	-	-
合计	2,049,523,164.45	2,201,311,455.58

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具（2023年12月31日：同）。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	2,049,523,164.45	49.78
	其中：债券	2,049,523,164.45	49.78
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	200,053,235.61	4.86
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,867,406,473.33	45.36
4	其他各项资产	27,706.96	0.00
5	合计	4,117,010,580.35	100.00

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	6.68	
	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	126,173,880.90	3.17
	其中：买断式回购融资	-	-

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

## 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

## 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	92
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	64

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过120天。

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	38.79	3.22
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	18.11	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	6.33	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	5.38	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	34.73	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	103.34	3.22

### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过240天。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	132,916,016.65	3.34
5	企业短期融资券	60,542,727.72	1.52
6	中期票据	30,972,051.39	0.78
7	同业存单	1,825,092,368.69	45.81
8	其他	-	-
9	合计	2,049,523,164.45	51.45
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

## 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	112491706	24南京银行CD012	1,000,000	99,807,240.18	2.51
2	112493168	24广州农村商业银行CD020	1,000,000	99,655,218.43	2.50
3	112419156	24恒丰银行CD156	1,000,000	99,379,715.53	2.49
4	112419176	24恒丰银行CD176	600,000	59,870,958.85	1.50
5	112409072	24浦发银行CD072	600,000	59,131,456.22	1.48
6	112382215	23广州银行CD050	500,000	49,985,388.84	1.25
7	112406015	24交通银行CD015	500,000	49,967,283.60	1.25
8	112491452	24苏州银行CD013	500,000	49,916,562.68	1.25
9	112493013	24北京农商银行CD041	500,000	49,837,548.52	1.25
10	112317192	23光大银行CD192	500,000	49,822,721.64	1.25

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

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0670%
报告期内偏离度的最低值	0.0118%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0332%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到0.25%。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到0.5%。

### 7.8 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。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 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，按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

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

#### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	27,706.96
2	应收清算款	-
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	27,706.96

#### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
67,782	58,773.52	130,055,225.47	3.26%	3,853,731,664.78	96.74%

#### 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	个人	81,405,235.82	2.04%
2	基金类机构	62,749,758.78	1.58%
3	个人	39,748,612.09	1.00%
4	个人	32,755,606.88	0.82%
5	个人	16,268,541.30	0.41%
6	个人	15,475,777.83	0.39%
7	个人	14,837,564.58	0.37%
8	券商类机构	14,268,000.00	0.36%
9	个人	12,216,300.24	0.31%
10	个人	12,212,174.74	0.31%

#### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
----	-----------	----------

基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00%
------------------	------	-------

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：1、期末本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。  
2、期末本基金的基金经理未持有本基金。

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022年02月28日)基金份额总额	5,657,490,000.00
本报告期期初基金份额总额	3,714,349,037.53
本报告期基金总申购份额	42,414,224,807.51
减：本报告期基金总赎回份额	42,144,786,954.79
本报告期期末基金份额总额	3,983,786,890.25

### §10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

#### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人中泰证券（上海）资产管理有限公司于2024年4月8日聘任史少杰先生担任公司副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

#### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘为基金审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 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，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.6.2 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，托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	2	-	-	12,952.51	100.00%	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中泰证券	120,366,900.00	100.00%	4,697,090,000.00	100.00%	-	-	-	-

## 10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内偏离度的绝对值未达到0.5%。

**10.9 其他重大事件**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中泰锦泉汇金货币市场基金 2023年第4季度报告	中国证监会规定网站	2024-01-19
2	中泰锦泉汇金货币市场基金 收益支付公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2024-01-23
3	中泰锦泉汇金货币市场基金 收益支付公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2024-02-23
4	中泰锦泉汇金货币市场基金 收益支付公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2024-03-25
5	中泰锦泉汇金货币市场基金 2023年年度报告	中国证监会规定网站	2024-03-26
6	中泰锦泉汇金货币市场基金 2024年第1季度报告	中国证监会规定网站	2024-04-22
7	中泰锦泉汇金货币市场基金 收益支付公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2024-04-23
8	中泰锦泉汇金货币市场基金 收益支付公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2024-05-23
9	中泰锦泉汇金货币市场基金 基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2024-06-07
10	中泰锦泉汇金货币市场基金 收益支付公告	上海证券报、中国证监会规定网站	2024-06-25

**§11 备查文件目录****11.1 备查文件目录**

- 1、中国证监会准予齐鲁锦泉汇金集合资产管理计划变更注册的文件；
- 2、《中泰锦泉汇金货币市场基金基金合同》；
- 3、《中泰锦泉汇金货币市场基金托管协议》；
- 4、《中泰锦泉汇金货币市场基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

7、关于齐鲁锦泉汇金集合资产管理计划改造并申请注册中泰锦泉汇金货币市场基金的法律意见；

8、中国证监会要求的其他文件。

### 11.2 存放地点

基金管理人处、基金托管人的办公场所，部分文件同时登载于基金管理人网站。

### 11.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

客户服务中心电话：400-821-0808

网站：<https://www.ztzqzg.com/>

中泰证券（上海）资产管理有限公司

二〇二四年八月二十八日