

中泰蓝月短债债券型证券投资基金

2024年第4季度报告

2024年12月31日

基金管理人:中泰证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2025年01月21日

目录

§1 重要提示 3

§2 基金产品概况3

§3 主要财务指标和基金净值表现4

 3.1 主要财务指标4

 3.2 基金净值表现4

§4 管理人报告 6

 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 6

 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 9

 4.3 公平交易专项说明 9

 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析10

 4.5 报告期内基金的业绩表现11

 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明 11

§5 投资组合报告11

 5.1 报告期末基金资产组合情况11

 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合12

 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 12

 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合12

 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 12

 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细13

 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 13

 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 13

 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 13

 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 13

 5.11 投资组合报告附注 13

§6 开放式基金份额变动 14

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况14

 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况14

 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 15

§8 影响投资者决策的其他重要信息 15

 8.1 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 15

§9 备查文件目录15

 9.1 备查文件目录15

 9.2 存放地点16

 9.3 查阅方式16

§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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年1月20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2024年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中泰蓝月短债
基金主代码	007057
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年04月26日
报告期末基金份额总额	46,734,850.53份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，重点投资短期债券主题证券，力争使基金份额持有人获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在充分考虑基金资产的安全性、收益性、流动性及严格控制风险的前提下，通过分析经济周期变化、货币政策、债券供求等因素，持续研究债券市场运行状况、研判市场风险，制定债券投资策略，挖掘价值被低估的标的券种，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
业绩比较基准	中债综合财富（1年以下）指数收益率×80%+一年期定期存款利率(税后)×20%
风险收益特征	本基金是债券型基金，属于较低预期风险、较低预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

基金管理人	中泰证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	中泰蓝月短债A	中泰蓝月短债C
下属分级基金的交易代码	007057	007058
报告期末下属分级基金的份额总额	35,829,506.44份	10,905,344.09份

§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(2024年10月01日 - 2024年12月31日)	
	中泰蓝月短债A	中泰蓝月短债C
1.本期已实现收益	143,041.11	42,006.08
2.本期利润	255,352.04	81,784.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.0085	0.0076
4.期末基金资产净值	41,354,910.66	12,450,973.44
5.期末基金份额净值	1.1542	1.1417

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中泰蓝月短债A净值表现

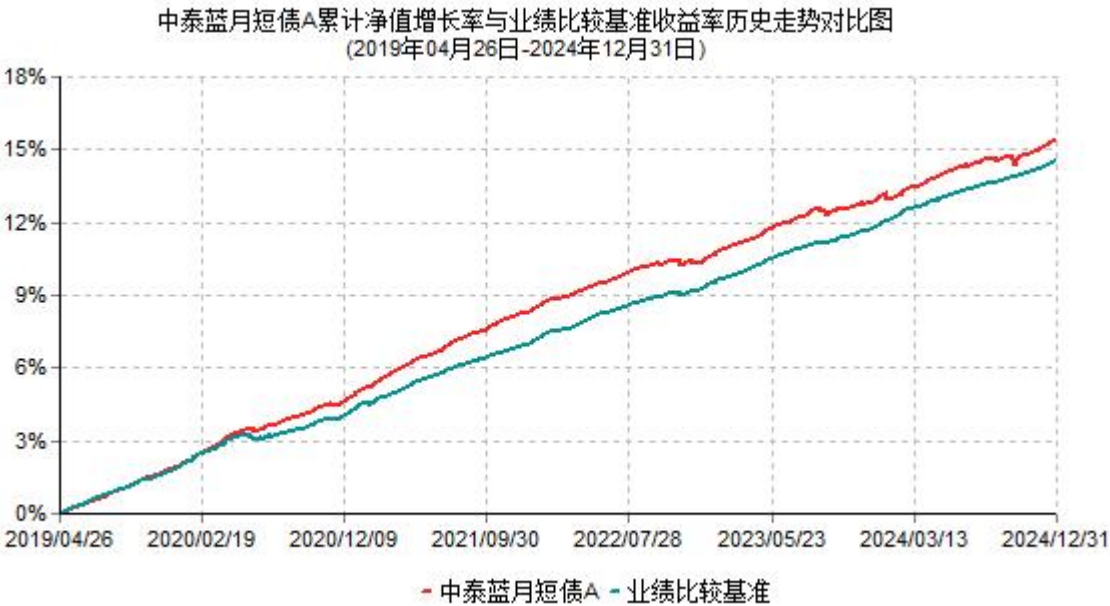
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.73%	0.03%	0.61%	0.01%	0.12%	0.02%
过去六个月	0.92%	0.03%	1.03%	0.01%	-0.11%	0.02%
过去一年	2.02%	0.02%	2.26%	0.01%	-0.24%	0.01%
过去三年	6.51%	0.02%	7.01%	0.01%	-0.50%	0.01%

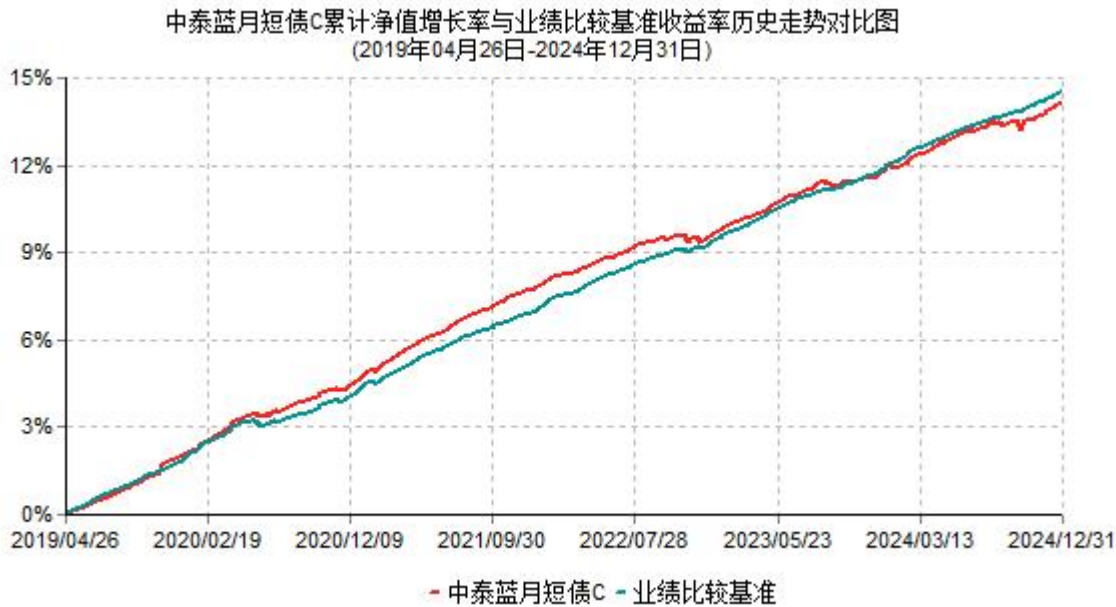
过去五年	13.13%	0.02%	12.28%	0.01%	0.85%	0.01%
自基金合同生效起至今	15.42%	0.02%	14.53%	0.01%	0.89%	0.01%

中泰蓝月短债C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.69%	0.03%	0.61%	0.01%	0.08%	0.02%
过去六个月	0.84%	0.03%	1.03%	0.01%	-0.19%	0.02%
过去一年	1.98%	0.02%	2.26%	0.01%	-0.28%	0.01%
过去三年	5.90%	0.02%	7.01%	0.01%	-1.11%	0.01%
过去五年	11.82%	0.02%	12.28%	0.01%	-0.46%	0.01%
自基金合同生效起至今	14.17%	0.02%	14.53%	0.01%	-0.36%	0.01%

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





§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		
商园波	本基金基金经理；中泰青月中短债债券型证券投资基金基金经理；中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金基金经理；中泰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。	2019-04-26	-	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2024年8月27日期间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。
程冰	本基金基金经理；中泰双利债券型证券投资基金基金经理；中泰安益利率债券型证券投资基金基金经理；中泰安悦6个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；中泰安弘债券型证券投资基金基金经理；固收公募投资部首席基金经理。	2023-08-28	-	20	国籍：中国。学历：江西财经学院大学本科。具备证券从业资格和基金从业资格。曾任东吴证券股份有限公司投资经理，上海银行股份有限公司金融市场部、资产管理部投资经理、总经理助理，兴业证券股份有限公司资金运营部副总经理，睿远基金管理有限公司专户固定收益投资部执行董事，中泰证券（上海）资产管理有限公司权益投资部首席投资经理，苏州银行投资交易部副总经理。2023年6月加入中泰证券（上海）资产管理有限公司任基金业务部首席基金经理，现任固收公募投资部首席基金经理。2023年8月28日至今担任中泰蓝月短债债券型证券投资基金、中泰安益利率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和中泰双利债券型证券投资基金的基金经理。2024年7月23日至今担任中泰安弘债券型证券投资基金的基金经理。
臧洁	本基金基金经理；中泰青月中短债债券型证券投资基金基金经理；中泰安睿债券型证券投资基金基金经理；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。	2021-06-22	-	10	国籍：中国。学历：南京大学硕士研究生。具备证券从业资格和基金从业资格。曾任德邦证券股份有限公司债券投资与交易部交易员。2015年3月加入中泰证券（上海）资产管理有限公司，历任交易部交易员、固定收益部投资经理、基金业务部基金经理，现任固收公募投资部基金经理。2021年6月22日至今担任中泰蓝月短债债券型证券投资基金和中泰青月中短债债券型证券投资基金基金经理。2022年1月19日至今担任中泰安睿债券型证券投资基金基金经理。2022年9月19日至2024年8月27日期间担任中泰安悦6个月定期开放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。

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 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，公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。

本报告期内，各项公平交易及异常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。

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，要求基金经理进行合理解释，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024年四季度经济运行呈现有所改善、但恢复基础尚不牢固的特点。从领先指标来看，中国制造业PMI指数回升至荣枯线上方，12月读数为50.1%，较9月回升0.3个百分点，与工业增加值走势互相印证。11月出口、投资、社零增速不同程度放缓，通胀因素仍然偏弱，CPI同比回落至0.2%，PPI同比下降2.5%，仍处于低位区间。11月8日全国人大常委会审议通过了《国务院关于提请审议增加地方政府债务限额置换存量隐性债务的议案》，明确增加6万亿元地方政府债务限额置换存量隐性债务，同日财政部对外披露一揽子化债组合拳的具体安排，并启动2万亿地方专项债发行，用于存量隐性债务置换。12月9日，政治局会议指出，明年要实施适度宽松的货币政策，为十四年来首次。12月12日，中央经济工作会议延续相关表述，新增“适时降准降息，保持流动性充裕”措辞组合，提振债市信心。四季度MLF到期36890亿元，央行运用多种工具投放中长期流动性，其中实施买断式逆回购操作2.7万亿元，净买入国债7000亿元，续作MLF19000亿元，期间累计净投放资金16110亿元。在央行积极呵护下，资金面整体宽松，银行间质押式回购隔夜与7天的加权平均利率月度均值在12月读数分别为1.43%和1.71%，较9月分别下行25BP和9BP。债市收益率整体呈现先上后下的变化态势，1年国债收益率月度均值由1.40%降至1.16%，10年国债收益率月度均值由2.10%降至1.80%，收益率曲线10-1年利差均值由71BP收窄至64BP。

回顾四季度，随着10月上旬债市开始止跌回稳，收益率重回下行区间，信用利差也开始逐步修复。本基金持有的短久期信用债估值也快速修复，净值在10月中旬回到了前高。11月8日，全国人大常委会审议通过了近年来力度最大的化债方案，本基金也积极增加了高静态、短久期城投债的仓位。12月的政治局会议将货币政策定调为“适度宽松”，并强调“加强超常规逆周期调节”，债市收益率快速下行，本基金积极参与商金和利率债的波段交易，也为账户增厚一定的收益。

展望2025年一季度，债市仍处在收益率下行通道中，但随着目前的点位已隐含较高的降息预期，利率波动逐渐加大，收益与风险并存，本基金在策略上会继续挖掘城投等高静态短久期的信用债作为底仓配置，并辅之以利率债或金融债的交易波段操作来增厚收益，在397天的投资范围内适当增加久期，规避信用下沉，努力实现净值的稳步上涨。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中泰蓝月短债A基金份额净值为1.1542元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.73%，同期业绩比较基准收益率为0.61%；截至报告期末中泰蓝月短债C基金份额净值为1.1417元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.69%，同期业绩比较基准收益率为0.61%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	49,621,222.88	92.03
	其中：债券	49,621,222.88	92.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	3,300,008.25	6.12
	其中：买断式回购的买入	-	-

	返售金融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	975,515.38	1.81
8	其他资产	20,451.69	0.04
9	合计	53,917,198.20	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,126,531.34	3.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,576,391.21	12.22
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	13,964,637.85	25.95
5	企业短期融资券	3,008,299.73	5.59
6	中期票据	23,945,362.75	44.50
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	49,621,222.88	92.22

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	2228057	22浦发银行04	35,000	3,539,335.21	6.58
2	102380563	23巴中国资MT	30,000	3,204,406.85	5.96

		N001			
3	1880144	18上饶县城投债	150,000	3,193,661.10	5.94
4	102281955	22大足工业MT N001	30,000	3,178,643.84	5.91
5	102280935	22怀化城投MT N001	30,000	3,159,294.58	5.87

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

5.11.2 本基金本报告期末投资股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,451.69
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	20,451.69

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	中泰蓝月短债A	中泰蓝月短债C
报告期期初基金份额总额	28,920,793.77	15,761,009.85
报告期期间基金总申购份额	13,397,655.13	994,583.37
减：报告期期间基金总赎回份额	6,488,942.46	5,850,249.13
报告期期间基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	35,829,506.44	10,905,344.09

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回或买卖本基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024年10月1日至2024年12月31日	17,512,259.19	0.00	0.00	17,512,259.19	37.47%
	2	2024年11月15日至2024年12月31日	0.00	13,053,607.17	0.00	13,053,607.17	27.93%
产品特有风险							
当本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况时，可能会引发以下风险： （1）流动性风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致本基金的流动性风险。 （2）基金规模过小导致的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。 （3）基金净值大幅波动的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因，可能会导致基金份额净值出现大幅波动。 （4）基金合同提前终止的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产净值连续六十个工作日低于5000万元，本基金可能面临基金合同提前终止等情形。 （5）巨额赎回的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能触发本基金巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。 （6）份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险：当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。 本基金管理人将通过完善的风险管理机制，有效管理上述风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中泰蓝月短债债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中泰蓝月短债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中泰蓝月短债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中泰蓝月短债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

9.2 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。

9.3 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
2025年01月21日