

---

# 中泰青月安盈 66 个月定期开放债券型证券投资基金

## 2024 年年度报告

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

送出日期:2025 年 03 月 26 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年3月24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2024年1月1日起至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.....                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7  |
| §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....                 | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 9  |
| §4 管理人报告.....                                | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 14 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 15 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 16 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 17 |
| 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.....       | 17 |
| §5 托管人报告.....                                | 17 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 17 |
| 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..... | 17 |
| 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.....       | 17 |
| §6 审计报告.....                                 | 17 |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 17 |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 18 |
| §7 年度财务报表.....                               | 21 |
| 7.1 资产负债表.....                               | 21 |
| 7.2 利润表.....                                 | 23 |
| 7.3 净资产变动表.....                              | 24 |
| 7.4 报表附注.....                                | 26 |
| §8 投资组合报告.....                               | 48 |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 48 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 49 |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....       | 49 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 49 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 49 |
| 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....      | 50 |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....   | 50 |
| 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....   | 50 |
| 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....      | 51 |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                     | 51 |

|                                           |    |
|-------------------------------------------|----|
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....           | 51 |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                       | 51 |
| §9 基金份额持有人信息 .....                        | 51 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....               | 51 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....            | 52 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....    | 52 |
| §10 开放式基金份额变动 .....                       | 52 |
| §11 重大事件揭示 .....                          | 52 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                    | 52 |
| 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 .....    | 52 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....         | 53 |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                      | 53 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....               | 53 |
| 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 .....       | 53 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....              | 53 |
| 11.8 其他重大事件 .....                         | 54 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息 .....                  | 54 |
| 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 ..... | 54 |
| §13 备查文件目录 .....                          | 55 |
| 13.1 备查文件目录 .....                         | 55 |
| 13.2 存放地点 .....                           | 55 |
| 13.3 查阅方式 .....                           | 56 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

|            |                                                      |
|------------|------------------------------------------------------|
| 基金名称       | 中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金                              |
| 基金简称       | 中泰青月安盈66个月定开债                                        |
| 基金主代码      | 010501                                               |
| 基金运作方式     | 契约型开放式。本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。 |
| 基金合同生效日    | 2020年11月23日                                          |
| 基金管理人      | 中泰证券（上海）资产管理有限公司                                     |
| 基金托管人      | 兴业银行股份有限公司                                           |
| 报告期末基金份额总额 | 8,040,179,708.19份                                    |
| 基金合同存续期    | 不定期                                                  |

2.2 基金产品说明

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标 | 本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产的稳健增值。                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 投资策略 | <p>本基金以封闭期为周期进行投资运作，主要采用买入并持有策略构建投资组合，力求基金资产的稳健增值。</p> <p>在封闭期内，本基金严格采用买入并持有策略，对所投资固定收益品种的剩余期限与基金的剩余封闭期进行期限匹配，投资于剩余期限（权利在投资者一方的含权债按照行权剩余期限计算）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产在封闭期结束前可完全变现。</p> <p>本基金投资含回售权的债券时，应该在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭运作期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。</p> <p>基金管理人可以基于持有人利益优先原则，在不违反《企业会计准则》的前提下，对尚未到期的固定</p> |

|        |                                                                    |
|--------|--------------------------------------------------------------------|
|        | 收益类品种进行处置。                                                         |
| 业绩比较基准 | 在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日的中国人民银行公布并执行的金融机构三年期定期存款利率（税后）+0.5%       |
| 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，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。 |

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                | 兴业银行股份有限公司               |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 王洪懿                             | 冯萌                       |
|         | 联系电话 | 021-20521199                    | 021-52629999-213310      |
|         | 电子邮箱 | wanghy@ztzqzg.com               | fengmeng@cib.com.cn      |
| 客户服务电话  |      | 400-821-0808                    | 95561                    |
| 传真      |      | 021-50933716                    | 021-62159217             |
| 注册地址    |      | 上海市黄浦区延安东路175号24楼05室            | 福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦 |
| 办公地址    |      | 上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1002-1003室 | 上海市浦东新区银城路167号4楼         |
| 邮政编码    |      | 200120                          | 200120                   |
| 法定代表人   |      | 黄文卿                             | 吕家进                      |

2.4 信息披露方式

|                     |                                 |
|---------------------|---------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 上海证券报                           |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.ztzqzg.com                  |
| 基金年度报告备置地点          | 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                            |
|--------|---------------------|---------------------------------|
| 会计师事务所 | 毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙) | 中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层           |
| 注册登记机构 | 中泰证券（上海）资产管理有限公司    | 上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1002-1003室 |

§3 主要财务指标、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 期间数据和指标 | 2024年            | 2023年            | 2022年            |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 本期已实现收益       | 355,177,369.84   | 342,078,062.32   | 364,278,564.85   |
| 本期利润          | 355,177,369.84   | 342,078,062.32   | 364,278,564.85   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0442           | 0.0425           | 0.0454           |
| 本期加权平均净值利润率   | 4.27%            | 4.17%            | 4.43%            |
| 本期基金份额净值增长率   | 4.37%            | 4.27%            | 4.52%            |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2024年末           | 2023年末           | 2022年末           |
| 期末可供分配利润      | 451,614,443.06   | 96,437,073.22    | 67,926,019.62    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0562           | 0.0120           | 0.0084           |
| 期末基金资产净值      | 8,491,794,151.25 | 8,136,616,781.41 | 8,108,105,722.48 |
| 期末基金份额净值      | 1.0562           | 1.0120           | 1.0084           |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2024年末           | 2023年末           | 2022年末           |
| 基金份额累计净值增长率   | 18.76%           | 13.79%           | 9.14%            |

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

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

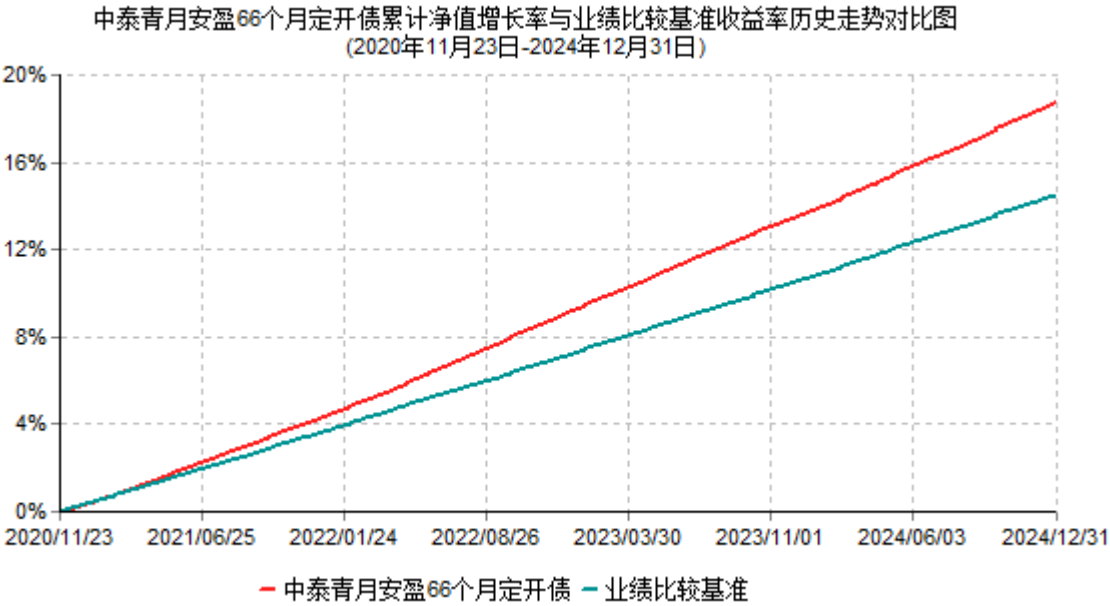
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

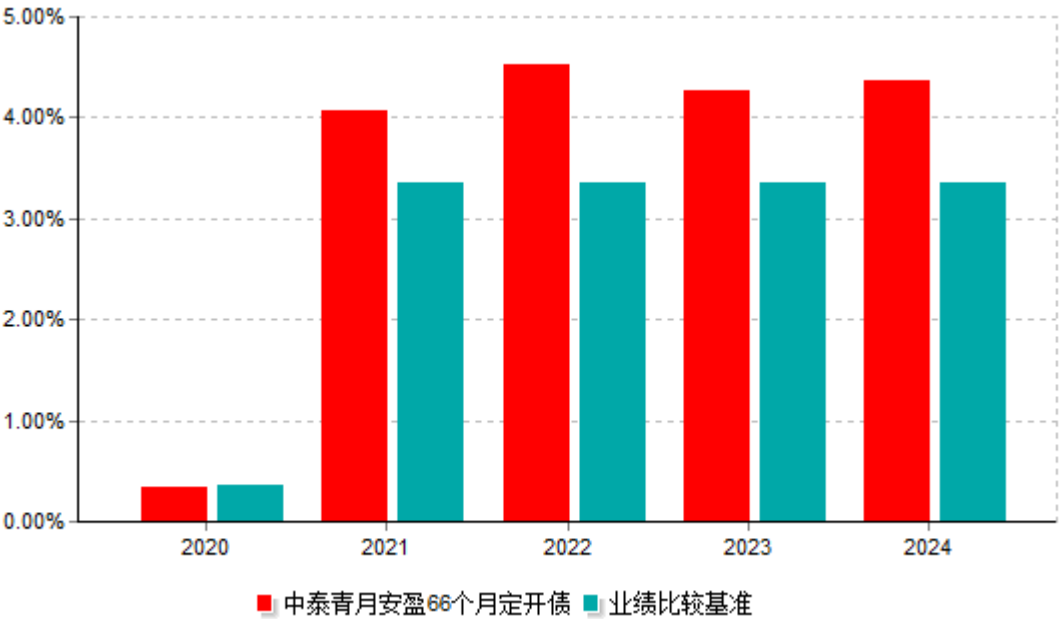
| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③   | ②-④   |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|-------|-------|
| 过去三个月          | 1.11%        | 0.01%               | 0.83%              | 0.01%                     | 0.28% | 0.00% |
| 过去六个月          | 2.21%        | 0.01%               | 1.67%              | 0.01%                     | 0.54% | 0.00% |
| 过去一年           | 4.37%        | 0.01%               | 3.36%              | 0.01%                     | 1.01% | 0.00% |
| 过去三年           | 13.74%       | 0.01%               | 10.40%             | 0.01%                     | 3.34% | 0.00% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 18.76%       | 0.01%               | 14.50%             | 0.01%                     | 4.26% | 0.00% |

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





3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金的基金合同于2020年11月23日生效。基金合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金 | 现金形式发 | 再投资形式 | 年度利润分 | 备注 |
|----|--------|-------|-------|-------|----|
|----|--------|-------|-------|-------|----|

|       | 份额分红数 | 放总额            | 发放总额          | 配合计            |   |
|-------|-------|----------------|---------------|----------------|---|
| 2023年 | 0.390 | 313,567,003.39 | 5.33          | 313,567,008.72 | - |
| 2022年 | 0.450 | 337,456,579.50 | 23,307,374.21 | 360,763,953.71 | - |
| 合计    | 0.840 | 651,023,582.89 | 23,307,379.54 | 674,330,962.43 | - |

§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12月31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、中泰开阳价值优选灵活配置混合型证券投资基金、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、中泰双利债券型证券投资基金、中泰蓝月短债债券型证券投资基金、中泰青月中短债债券型证券投资基金、中泰稳固周周购12周滚动持有债券型证券投资基金、中泰锦泉汇金货币市场基金、中泰稳固30天持有期中短债债券型证券投资基金、中泰星宇价值成长混合型证券投资基金、中泰沪深300指数增强型证券投资基金、中泰中证500指数增强型证券投资基金、中泰沪深300指数量化优选增强型证券投资基金、中泰青月安盈66个月定期开放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、中泰安睿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、中泰研究精选6个月持有期股票型证券投资基金、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ESG主题6个月持有期混合型发起式证券投资基金、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）、中泰红利量化选股股票型发起式证券投资基金和中泰安弘债券型证券投资基金共31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<br>经理（助理）<br>期限 |          | 证券<br>从业<br>年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-----|--------------------------------------------------------|-------------------------|----------|----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                                        | 任职<br>日期                | 离任<br>日期 |                |                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 王瑞  | 本基金基金经理；中泰锦泉汇金货币市场基金基金经理，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。 | 2020-11-23              | -        | 10             | 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。 |
| 蔡凤仪 | 本基金基金经理；中泰安睿债券型证券投资基金基金经理；中泰安益利率债债                     | 2021-06-16              | -        | 8              | 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。曾任鑫沅资产管理有限                                                                                                                                                                                                                 |

|  |                                                                                  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|--|----------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 券型证券投资基金<br>基金经理；中泰安悦<br>6个月定期开放债券<br>型证券投资基金基<br>金经理；中泰安弘债<br>券型证券投资基金<br>基金经理。 |  |  |  | 公司债券交易员、投资经理<br>助理、投资经理。2020年11<br>月加入中泰证券（上海）资<br>产管理有限公司，历任基金<br>业务部基金经理助理、基金<br>经理，现任固收公募投资部<br>基金经理。2021年6月16日<br>至今担任中泰青月安盈66<br>个月定期开放债券型证券<br>投资基金基金经理。2022年<br>1月19日至今担任中泰安睿<br>债券型证券投资基金基金<br>经理。2022年4月26日至今<br>担任中泰安益利率债债券<br>型证券投资基金基金经理。<br>2022年9月19日至今担任中<br>泰安悦6个月定期开放债券<br>型证券投资基金基金经理。<br>2024年7月23日至今担任中<br>泰安弘债券型证券投资基金<br>的基金经理。 |
|--|----------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

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 公平交易制度的执行情况

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。

#### 4.3.3 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，面对外部压力加大、内部困难增多的复杂严峻形势，国民经济运行总体平稳。全年国内生产总值按不变价格计算，比上年增长5.0%。全年居民消费价格（CPI）同比上年上涨0.2%，工业生产者出厂价格（PPI）同比上年均下降2.2%。

央行坚持支持性货币政策立场，先后四次实施了重大货币政策调整，其中，两次降低法定存款准备金率共1个百分点，两次下调央行政策利率共0.3个百分点，力度为近年来最大。同时，央行还通过创设临时隔夜正逆回购、国债借入、OMO改为数量招标、淡化中期借贷便利（MLF）作用等方式完善货币政策利率传导框架。在监管政策上，强化利率政策执行，治理资金空转，大力整改手工补息，优化对公存款、同业活期存款利率自律管理。

积极的财政政策为宏观经济平稳运行提供了重要保障，三、四季度及时出台增量政策，更大力度支持地方政府缓释偿债压力，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，并于当月启动2万亿地方专项置换债发行，用于存量隐性债务置换。

在央行积极呵护下，资金面整体宽松，2024年债券市场走出了一波较大的牛市行情。2024年12月银行间质押式回购隔夜与7天的加权平均利率月度均值分别为1.43%和

1.71%，较2023年12月均值分别下行17BP和13BP。债市全年收益率震荡下行态势，1年国债收益率月度均值由2023年12月的2.29%降至2024年12月的1.16%，10年国债收益率月度均值由2.62%降至1.80%；收益率曲线走陡，10-1年利差月度均值由33BP扩大至64BP。

本基金已完成建仓操作，随着资金面的波动，择机搭配不同期限的融资回购品种，确保本基金杠杆策略的平稳、安全实施，并有效控制融资成本，实现份额净值稳步增长。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中泰青月安盈66个月定开债基金份额净值为1.0562元，本报告期内，基金份额净值增长率为4.37%，同期业绩比较基准收益率为3.36%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年经济复苏的斜率可能出现前低后高的局面，其中上半年面临高基数因素、关税风险升温的影响。考虑到通胀压力温和，2025年名义GDP有望低位运行，这带来利率低位运行的总体格局。在此背景下，上半年财政货币双宽概率较高，“超常规逆周期调节”的特征更为显著。下半年随着政策对经济企稳的效果显现，或年中继续加码刺激力度，债市波动的风险或有所提高。

在实施更加积极的财政政策方面，市场普遍预期2025年的财政赤字率将提升至3.8%-4%左右，专项债规模可能达到4.5万亿元，特别国债预计1.5-2万亿元。这些财政政策的加码将为经济增长提供更多的资金支持。

在适度宽松的货币政策方面，2025年的货币政策将进一步通过降准降息、加大净买入国债力度和买断式逆回购规模，向市场提供低成本资金，有利于压低实际利率和股权风险溢价。

市场对货币政策力度和节奏、经济复苏斜率仍然存在分歧点，债市低利率、高波动可能常态化。部分机构认为，降准降息的空间较大，且可能前置，预计全年逆回购利率降幅为40-50BP，准备金率下调100-150BP，LPR和贷款利率降幅可能更大。但也有观点认为，货币政策的进一步宽松程度有待观察，时点可能后置，需要兼顾内外平衡。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人以维护基金份额持有人利益为宗旨，坚持合规运作，不断完善内部控制制度和流程，加强日常监察稽核力度，推动各项内部控制制度、措施得到全面、有效落实。督察长和合规管理部门根据独立、客观、公正的原则，审慎履行职责，通过合规审查、投资风控、内部稽核等工作，推进内部控制和风险管理的不断完善，为各项经营活动和基金投资运作的合规开展提供有力保障。

本报告期内重点开展的监察稽核工作包括：

1、不断完善制度流程。报告期内，公司继续加强制度建设，密切关注监管动态，依照最新法律法规和自律规则要求，结合公司各项业务实际开展情况，组织相关部门及时对公司的各类制度、流程开展梳理、修订与完善。

2、积极配合外部审计、检查。报告期内，公司积极协调内部各个部门，全力配合监管机构、母公司及外部审计机构对公司开展的业务检查、经营审计、内部控制评价、合规有效性评估，针对上述检查、审计项目开展过程中发现的问题以及提出的改进建议，公司高度重视，严格督促相关部门完善制度、改进流程，以有效控制相关风险，不断提升内控管理水平。

3、加强内部监察稽核力度。公司每季度针对投资、研究、交易、风控、基金运营等内部控制各方面开展定期核查，并针对发现的问题采取有效措施完善制度、改进流程；在此基础上，报告期内公司针对投资者适当性管理、新股网下申购、员工行为管理、关联交易、债券交易等业务开展了专项稽核，对专项稽核中发现的问题明确要求相关部门整改到位，不断提升内部控制和风险管理水平。

4、有效发挥合规审查作用。报告期内，督察长和合规管理部门认真履行合规审查职责，对新制定或修订的各项制度、新产品方案、基金销售文件、重要投资决策、基金关联交易、基金信息披露文件等开展合规审查，有效发挥合规审查在防范、控制风险方面的积极作用。

5、积极开展合规培训。报告期内，公司合规管理部门及时向公司管理层和员工传达最新的监管要求和违规案例通报，积极保持与各个业务部门的沟通与联络，根据各板块业务的开展情况适时开展合规督导，及时提示合规风险，妥善解答业务人员在展业过程中遇到的法律、合规问题；并根据法律法规变化和最新监管动态，统筹协调外部律师事务所和内部合规力量，有针对性地开展合规培训项目，不断提升员工的风险、合规意识，营造合规经营氛围。

通过以上工作的开展，在本报告期内，本基金运作整体合法合规。基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性，确保基金资产的规范运作，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### §6 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     | 毕马威华振审字第2501741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   | 中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金全体基金份额持有人                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 审计意见      | <p>我们审计了后附的中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表，包括2024年12月31日的资产负债表、2024年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注7.4.2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”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金2024年12月31日的财务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础 | <p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。</p>                                                                                                                                         |
| 强调事项      | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 其他事项      | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 其他信息      | 该基金管理人中泰证券(上海)资产管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-----------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 | <p>（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金2024年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，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。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该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</p>                                                                                                                                               |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>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。</p> <p>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：</p> <p>(1) 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险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 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。</p> <p>(3) 评价该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。</p> <p>(4) 对该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，就可能导致对该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该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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。</p> <p>我们与该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 | 毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)   |     |
| 注册会计师的姓名  | 张楠                    | 谢晶菁 |
| 会计师事务所的地址 | 中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层 |     |
| 审计报告日期    | 2025-03-24            |     |

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2024年12月31日

单位：人民币元

| 资 产      | 附注号     | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|----------|---------|--------------------|---------------------|
| 资 产：     |         |                    |                     |
| 货币资金     | 7.4.7.1 | 2,302,219.57       | 1,797,887.43        |
| 结算备付金    |         | -                  | -                   |
| 存出保证金    |         | -                  | -                   |
| 交易性金融资产  | 7.4.7.2 | -                  | -                   |
| 其中：股票投资  |         | -                  | -                   |
| 基金投资     |         | -                  | -                   |
| 债券投资     |         | -                  | -                   |
| 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 | -                  | -                   |
| 债权投资     | 7.4.7.5 | 15,026,996,756.84  | 15,033,676,835.83   |
| 其中：债券投资  |         | 15,026,996,756.84  | 15,033,676,835.83   |
| 资产支持证券投资 |         | -                  | -                   |
| 其他投资     |         | -                  | -                   |

|           |         |                    |                     |
|-----------|---------|--------------------|---------------------|
| 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      | 7.4.7.6 | -                  | -                   |
| 资产总计      |         | 15,029,298,976.41  | 15,035,474,723.26   |
| 负债和净资产    | 附注号     | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
| 负 债:      |         |                    |                     |
| 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 |         | 6,535,716,977.82   | 6,896,995,758.32    |
| 应付清算款     |         | -                  | -                   |
| 应付赎回款     |         | -                  | -                   |
| 应付管理人报酬   |         | 1,076,830.12       | 1,034,897.19        |
| 应付托管费     |         | 358,943.38         | 344,965.71          |
| 应付销售服务费   |         | -                  | -                   |
| 应付投资顾问费   |         | -                  | -                   |
| 应交税费      |         | -                  | -                   |
| 应付利润      |         | -                  | -                   |
| 递延所得税负债   |         | -                  | -                   |
| 其他负债      | 7.4.7.7 | 352,073.84         | 482,320.63          |
| 负债合计      |         | 6,537,504,825.16   | 6,898,857,941.85    |
| 净资产:      |         |                    |                     |
| 实收基金      | 7.4.7.8 | 8,040,179,708.19   | 8,040,179,708.19    |
| 未分配利润     | 7.4.7.9 | 451,614,443.06     | 96,437,073.22       |
| 净资产合计     |         | 8,491,794,151.25   | 8,136,616,781.41    |
| 负债和净资产总计  |         | 15,029,298,976.41  | 15,035,474,723.26   |

注：报告截止日2024年12月31日，基金份额净值1.0562元，基金份额总额8,040,179,708.19份。

7.2 利润表

会计主体：中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号      | 本期<br>2024年01月01日至2<br>024年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2<br>023年12月31日 |
|-----------------------|----------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 一、营业总收入               |          | 499,050,324.85                    | 497,610,090.85                         |
| 1.利息收入                |          | 499,050,324.85                    | 497,610,090.85                         |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.10 | 28,020.28                         | 20,313.94                              |
| 债券利息收入                |          | 499,001,921.01                    | 497,589,776.91                         |
| 资产支持证券利息收入            |          | -                                 | -                                      |
| 买入返售金融资产收入            |          | 20,383.56                         | -                                      |
| 其他利息收入                |          | -                                 | -                                      |
| 2.投资收益(损失以“-”填列)      |          | -                                 | -                                      |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.11 | -                                 | -                                      |
| 基金投资收益                |          | -                                 | -                                      |
| 债券投资收益                | 7.4.7.12 | -                                 | -                                      |
| 资产支持证券投资收益            |          | -                                 | -                                      |
| 贵金属投资收益               |          | -                                 | -                                      |
| 衍生工具收益                | 7.4.7.13 | -                                 | -                                      |
| 股利收益                  | 7.4.7.14 | -                                 | -                                      |
| 其他投资收益                |          | -                                 | -                                      |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.15 | -                                 | -                                      |
| 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 | -                                 | -                                      |

|                     |            |                |                |
|---------------------|------------|----------------|----------------|
| 列)                  |            |                |                |
| 减：二、营业总支出           |            | 143,872,955.01 | 155,532,028.53 |
| 1.管理人报酬             | 7.4.10.2.1 | 12,465,906.07  | 12,293,511.57  |
| 2.托管费               | 7.4.10.2.2 | 4,155,302.01   | 4,097,837.24   |
| 3.销售服务费             |            | -              | -              |
| 4.投资顾问费             |            | -              | -              |
| 5.利息支出              |            | 127,045,737.33 | 138,786,619.72 |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | 127,045,737.33 | 138,786,619.72 |
| 6.信用减值损失            |            | -              | -              |
| 7.税金及附加             |            | -              | -              |
| 8.其他费用              | 7.4.7.17   | 206,009.60     | 354,060.00     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 355,177,369.84 | 342,078,062.32 |
| 减：所得税费用             |            | -              | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 355,177,369.84 | 342,078,062.32 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |            | -              | -              |
| 六、综合收益总额            |            | 355,177,369.84 | 342,078,062.32 |

7.3 净资产变动表

会计主体：中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

| 项 目       | 本期                      |               |                  |
|-----------|-------------------------|---------------|------------------|
|           | 2024年01月01日至2024年12月31日 |               |                  |
|           | 实收基金                    | 未分配利润         | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产 | 8,040,179,708.19        | 96,437,073.22 | 8,136,616,781.41 |
| 二、本期期初净资产 | 8,040,179,708.19        | 96,437,073.22 | 8,136,616,781.41 |



|                                          |                                    |                |                  |
|------------------------------------------|------------------------------------|----------------|------------------|
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -                                  | 355,177,369.84 | 355,177,369.84   |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | 355,177,369.84 | 355,177,369.84   |
| （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）      | -                                  | -              | -                |
| 其中：1.基金申购款                               | -                                  | -              | -                |
| 2.基金赎回款                                  | -                                  | -              | -                |
| （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） | -                                  | -              | -                |
| 四、本期期末净资产                                | 8,040,179,708.19                   | 451,614,443.06 | 8,491,794,151.25 |
| 项 目                                      | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |                |                  |
|                                          | 实收基金                               | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产                                | 8,040,179,702.86                   | 67,926,019.62  | 8,108,105,722.48 |
| 二、本期期初净资产                                | 8,040,179,702.86                   | 67,926,019.62  | 8,108,105,722.48 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 5.33                               | 28,511,053.60  | 28,511,058.93    |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | 342,078,062.32 | 342,078,062.32   |
| （二）、本期基金                                 | 5.33                               | -              | 5.33             |

|                                          |                  |                 |                  |
|------------------------------------------|------------------|-----------------|------------------|
| 份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）              |                  |                 |                  |
| 其中：1.基金申购款                               | 5.33             | -               | 5.33             |
| 2.基金赎回款                                  | -                | -               | -                |
| （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） | -                | -313,567,008.72 | -313,567,008.72  |
| 四、本期期末净资产                                | 8,040,179,708.19 | 96,437,073.22   | 8,136,616,781.41 |

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：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]2603号《关于准予中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》注册，由中泰证券(上海)资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定期，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币7,998,986,191.92元。经向中国证监会备案，《中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2020年11月23日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为7,999,034,191.94份，其中认购资金利息折合48,000.02份基金份额。本基金的基金管理人为中泰证券(上海)资产管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融

工具，主要投资于债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、证券公司短期公司债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括活期存款、协议存款、定期存款等）、同业存单、货币市场工具等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%，但每个开放期开始前3个月、开放期期间以及开放期结束后3个月内不受前述投资组合比例的限制。开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；封闭期内，本基金不受上述5%的限制；其中，现金不包括结算备付金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为：该封闭期起始日的中国人民银行公布并执行的金融机构三年期定期存款利率（税后）+0.5%。

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2025年3月24日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2024年12月31日的财务状况、2024年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日至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，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括债券投资、资产支持证券投资等。

本基金通常根据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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：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当期损益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被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，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

- 该金融资产的合同条款规定，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。

本基金采用买入并持有至到期的投资策略，即管理本基金所持有的债券投资和资产支持证券投资的业务模式是以收取合同现金流量为目标，且上述金融资产的合同条款规定，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，因此将本基金所持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以摊余成本计量的金融资产。以摊余成本计量的金融资产在资产负债表中以债权投资列示。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当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

##### (b) 金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无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。

#### 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

##### (a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

##### (b) 后续计量

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

##### (c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

##### (d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。

信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来12个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后12个月内(若金融工具的预计存续期少于12个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

具有较低的信用风险

如果金融工具的违约风险较低，借款人在短期内履行其合同现金流量义务的能力很强，并且即便较长时期内经济形势和经营环境存在不利变化但未必一定降低借款人履行其合同现金流量义务的能力，该金融工具被视为具有较低的信用风险。

信用风险显著增加

本基金通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的相对变化，以评估金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

在确定信用风险自初始确认后是否显著增加时，本基金考虑无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的合理且有依据的信息，包括前瞻性信息。本基金考虑的信息包括：

- 债务人未能按合同到期日支付本金和利息的情况；
- 已发生的或预期的金融工具的外部或内部信用评级(如有)的严重恶化；
- 已发生的或预期的债务人经营成果的严重恶化；
- 现存的或预期的技术、市场、经济或法律环境变化，并将对债务人对本基金的还款能力产生重大不利影响。

根据金融工具的性质，本基金以单项金融工具或金融工具组合为基础评估信用风险是否显著增加。以金融工具组合为基础进行评估时，本基金可基于共同信用风险特征对金融工具进行分类，例如逾期信息和信用风险评级。

如果逾期超过30日，本基金确定金融工具的信用风险已经显著增加。

已发生信用减值的金融资产

本基金在资产负债表日评估以摊余成本计量的金融资产是否已发生信用减值。当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。金融资产已发生信用减值的证据包括下列可观察信息：

- 发行方或债务人发生重大财务困难；
- 债务人违反合同，如偿付利息或本金违约或逾期等；
- 本基金出于与债务人财务困难有关的经济或合同考虑，给予债务人在任何其他情况下都不会做出的让步；
- 债务人很可能破产或进行其他财务重组；
- 发行方或债务人财务困难导致该金融资产的活跃市场消失。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

不适用。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 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在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额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 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

利息收入按债权投资的账面价值与实际利率计算的金额确认，在债权实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按实际利率法逐日计算利息收入。

##### 投资收益

以摊余成本计量的债权投资，在处置日按成交金额与其账面价值的差额确认投资收益。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。



经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

不适用。

### 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财税[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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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号文《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号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

- (b) 对证券投资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。
- 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。
- (c) 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。
- (d) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款         | 2,302,219.54       | 1,797,887.40        |
| 等于：本金        | 2,301,853.89       | 1,796,273.41        |
| 加：应计利息       | 365.65             | 1,613.99            |
| 减：坏账准备       | -                  | -                   |
| 定期存款         | -                  | -                   |
| 等于：本金        | -                  | -                   |
| 加：应计利息       | -                  | -                   |
| 减：坏账准备       | -                  | -                   |
| 其中：存款期限1个月以内 | -                  | -                   |
| 存款期限1-3个月    | -                  | -                   |
| 存款期限3个月以上    | -                  | -                   |
| 其他存款         | 0.03               | 0.03                |
| 等于：本金        | 0.03               | 0.03                |
| 加：应计利息       | -                  | -                   |
| 减：坏账准备       | -                  | -                   |
| 合计           | 2,302,219.57       | 1,797,887.43        |

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

7.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末及上年度末未持有交易性金融资产。

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

本基金本报告期末及上年度末各项买入返售金融资产无余额。

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买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2024年12月31日  |               |                |        |                   |
|--------|-------|---------------------|---------------|----------------|--------|-------------------|
|        |       | 初始成本                | 利息调整          | 应计利息           | 减：减值准备 | 账面价值              |
| 债券     | 交易所市场 | -                   | -             | -              | -      | -                 |
|        | 银行间市场 | 14,660,000,000.00   | -2,474,417.71 | 369,471,174.55 | -      | 15,026,996,756.84 |
|        | 小计    | 14,660,000,000.00   | -2,474,417.71 | 369,471,174.55 | -      | 15,026,996,756.84 |
| 资产支持证券 |       | -                   | -             | -              | -      | -                 |
| 其他     |       | -                   | -             | -              | -      | -                 |
| 合计     |       | 14,660,000,000.00   | -2,474,417.71 | 369,471,174.55 | -      | 15,026,996,756.84 |
| 项目     |       | 上年度末<br>2023年12月31日 |               |                |        |                   |
|        |       | 初始成本                | 利息调整          | 应计利息           | 减：减值准  | 账面价值              |

|        |       |                   |               |                | 备 |                   |
|--------|-------|-------------------|---------------|----------------|---|-------------------|
| 债券     | 交易所市场 | -                 | -             | -              | - | -                 |
|        | 银行间市场 | 14,670,000,000.00 | -5,173,694.62 | 368,850,530.45 | - | 15,033,676,835.83 |
|        | 小计    | 14,670,000,000.00 | -5,173,694.62 | 368,850,530.45 | - | 15,033,676,835.83 |
| 资产支持证券 |       | -                 | -             | -              | - | -                 |
| 其他     |       | -                 | -             | -              | - | -                 |
| 合计     |       | 14,670,000,000.00 | -5,173,694.62 | 368,850,530.45 | - | 15,033,676,835.83 |

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | -                  | -                   |
| 应付交易费用      | 287,573.84         | 287,820.63          |
| 其中：交易所市场    | -                  | -                   |
| 银行间市场       | 287,573.84         | 287,820.63          |
| 应付利息        | -                  | -                   |
| 预提费用-审计费    | 60,000.00          | 70,000.00           |
| 预提费用-账户维护费  | 4,500.00           | 4,500.00            |
| 预提费用-信息披露费  | -                  | 120,000.00          |
| 合计          | 352,073.84         | 482,320.63          |

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024年01月01日至2024年12月31日 |
|----|-------------------------------|
|----|-------------------------------|

|               | 基金份额（份）          | 账面金额             |
|---------------|------------------|------------------|
| 上年度末          | 8,040,179,708.19 | 8,040,179,708.19 |
| 本期申购          | -                | -                |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                | -                |
| 本期末           | 8,040,179,708.19 | 8,040,179,708.19 |

注：根据《中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》及《中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金以66个月为一个封闭期。除基金合同另有约定外，本基金每个封闭期结束之后第一个工作日起进入开放期，开放期的期限为自封闭期结束之日后第一个工作日起(含该日)不少于5个工作日、不超过20个工作日的期间，具体期间由基金管理人在封闭期结束前公告说明。本基金开放期内，投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。封闭期内，本基金不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

7.4.7.9 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           | 96,437,073.22  | -     | 96,437,073.22  |
| 本期期初           | 96,437,073.22  | -     | 96,437,073.22  |
| 本期利润           | 355,177,369.84 | -     | 355,177,369.84 |
| 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        | -              | -     | -              |
| 本期末            | 451,614,443.06 | -     | 451,614,443.06 |

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024年01月01日至2024年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年<br>12月31日 |
|----|-----------------------------------|----------------------------------------|
|----|-----------------------------------|----------------------------------------|

|           |           |           |
|-----------|-----------|-----------|
| 活期存款利息收入  | 28,020.28 | 20,309.35 |
| 定期存款利息收入  | -         | -         |
| 其他存款利息收入  | -         | 4.59      |
| 结算备付金利息收入 | -         | -         |
| 其他        | -         | -         |
| 合计        | 28,020.28 | 20,313.94 |

7.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益。

7.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.14 股利收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无股利收益。

7.4.7.15 公允价值变动收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无公允价值变动收益。

7.4.7.16 其他收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2024年01月01日至2024年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年<br>12月31日 |
|-------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 审计费用  | 60,000.00                         | 70,000.00                              |
| 信息披露费 | 120,000.00                        | 120,000.00                             |
| 汇划手续费 | 7,278.16                          | 6,060.00                               |
| 账户维护费 | 18,000.00                         | 18,000.00                              |

|      |            |            |
|------|------------|------------|
| 其他费用 | 731.44     | 140,000.00 |
| 合计   | 206,009.60 | 354,060.00 |

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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             |
|------------------------------|---------------------|
| 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、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中泰证券股份有限公司（以下简称“中泰证券”）       | 基金管理人的股东、基金销售机构     |
| 深圳派特纳投资企业（有限合伙）              | 基金管理人的股东            |
| 深圳前海山小投资企业（有限合伙）             | 基金管理人的股东            |
| 兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）       | 基金托管人               |

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内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>2024年01月01日至20<br>24年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至20<br>23年12月31日 |
|------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 12,465,906.07                     | 12,293,511.57                          |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | -                                 | -                                      |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 12,465,906.07                     | 12,293,511.57                          |

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0.15%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X0.15%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024年01月01日至2024<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023<br>年12月31日 |
|----------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,155,302.01                      | 4,097,837.24                           |

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值0.05%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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|-------|--------------------|---------------------|
|-------|--------------------|---------------------|



|      | 持有的基金份额          | 持有的基金份额<br>额占基金总份<br>额的比例 | 持有的基金份额          | 持有的基金份额<br>额占基金总份<br>额的比例 |
|------|------------------|---------------------------|------------------|---------------------------|
| 兴业银行 | 2,999,999,000.00 | 37.31%                    | 2,999,999,000.00 | 37.31%                    |

注：关联方投资本基金适用的费率按照公告的费率条款执行，符合本基金法律文件约定。

7.4.10.5 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<br>2024年01月01日至2024年12月31日 |           | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023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    |
| 兴业银行  | 2,302,219.54                  | 28,020.28 | 1,797,887.40                       | 20,309.35 |
| 中泰证券  | 0.03                          | 0.00      | 0.03                               | 4.59      |

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

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2024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

本基金未因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券。

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2024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6,535,716,977.82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           |
|--------|--------|------------|--------|------------|------------------|
| 160418 | 16农发18 | 2025-01-02 | 102.80 | 28,461,000 | 2,925,693,705.78 |
| 160210 | 16国开10 | 2025-01-02 | 102.05 | 21,530,000 | 2,197,202,968.23 |
| 160303 | 16进出03 | 2025-01-02 | 102.73 | 5,264,000  | 540,764,851.59   |
| 160303 | 16进出03 | 2025-01-03 | 102.73 | 5,260,000  | 540,353,936.05   |
| 160210 | 16国开10 | 2025-01-06 | 102.05 | 5,264,000  | 537,207,451.22   |
| 160408 | 16农发08 | 2025-01-03 | 102.87 | 3,158,000  | 324,852,685.00   |
| 160418 | 16农发18 | 2025-01-03 | 102.80 | 20,000     | 2,055,931.77     |
| 合计     |        |            |        | 68,957,000 | 7,068,131,529.64 |

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.13 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。

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

#### 7.4.13.2 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，预期信用减值会增加，从而导致本基金的收益下降。

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

新金融工具准则将金融工具所处的信用风险状况划分为三个阶段。本基金在参考历史违约率、市场信息及行业实践的基础上，选取隐含评级AA级为低信用风险阈值，并将减值阶段划分如下：在资产负债表日，若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级不低于初始确认隐含评级，或不低于低信用风险阈值，则处于第一阶段；若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级低于初始确认隐含评级，且低于低信用风险阈值，则处于第二阶段；若相关债券/资产支持证券投资的发行主体中债市场隐含评级下调至C，或出现其他认定为违约的情形时，则处于第三阶段。

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

于本报告期末，本基金无信用债券投资。

#### 7.4.13.3 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。本基金的债券投资采用买入持有至到期策略，流动性风险主要来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额。

于开放期内每日，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约约定到期日均为一个月以内且不计息，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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

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

款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

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

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。

本基金对投资组合采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。本基金的基金管理人主要通过合理配置投资组合的到期期限，管理利率波动带来的再投资风险。本基金主要投资于固定利率类的固定收益品种，因此很大程度上独立于市场利率变化。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024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               | 2,302,219.57 | -     | -      | -    | -    | -   | 2,302,219.57 |

|                     |                   |               |        |                   |      |               |                   |
|---------------------|-------------------|---------------|--------|-------------------|------|---------------|-------------------|
| 债权投资                | -                 | -             | -      | 15,026,996,756.84 | -    | -             | 15,026,996,756.84 |
| 资产总计                | 2,302,219.57      | -             | -      | 15,026,996,756.84 | -    | -             | 15,029,298,976.41 |
| 负债                  |                   |               |        |                   |      |               |                   |
| 卖出回购金融资产款           | 6,535,716,977.82  | -             | -      | -                 | -    | -             | 6,535,716,977.82  |
| 应付管理人报酬             | -                 | -             | -      | -                 | -    | 1,076,830.12  | 1,076,830.12      |
| 应付托管费               | -                 | -             | -      | -                 | -    | 358,943.38    | 358,943.38        |
| 其他负债                | -                 | -             | -      | -                 | -    | 352,073.84    | 352,073.84        |
| 负债总计                | 6,535,716,977.82  | -             | -      | -                 | -    | 1,787,847.34  | 6,537,504,825.16  |
| 利率敏感度缺口             | -6,533,414,758.25 | -             | -      | 15,026,996,756.84 | -    | -1,787,847.34 | 8,491,794,151.25  |
| 上年度末<br>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                | 1,797,887.43      | -             | -      | -                 | -    | -             | 1,797,887.43      |
| 债权投资                | -                 | 10,213,081.51 | -      | 15,023,463,754.32 | -    | -             | 15,033,676,835.83 |
| 资产总计                | 1,797,887.43      | 10,213,081.51 | -      | 15,023,463,754.32 | -    | -             | 15,035,474,723.26 |
| 负债                  |                   |               |        |                   |      |               |                   |
| 卖出回购金融资产款           | 6,896,995,758.32  | -             | -      | -                 | -    | -             | 6,896,995,758.32  |
| 应付管理人报酬             | -                 | -             | -      | -                 | -    | 1,034,897.19  | 1,034,897.19      |
| 应付托管费               | -                 | -             | -      | -                 | -    | 344,965.71    | 344,965.71        |
| 其他负债                | -                 | -             | -      | -                 | -    | 482,320.63    | 482,320.63        |
| 负债总计                | 6,896,995,758.32  | -             | -      | -                 | -    | 1,862,183.53  | 6,898,857,941.85  |
| 利率敏感度缺口             | -6,895,197,870.89 | 10,213,081.51 | -      | 15,023,463,754.32 | -    | -1,862,183.53 | 8,136,616,781.41  |

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

于本报告期末，本基金的债权投资均为固定利率类的债券品种，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。

##### 7.4.13.4.3.1 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。

#### 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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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

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

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

##### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024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工具（2023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、债权投资、卖出回购金融资产款和其他金融负债等。

除债权投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

于2024年12月31日，本基金持有的债权投资的账面价值为15,026,996,756.84元，公允价值为15,406,486,174.55元（2023年12月31日，本基金持有的债权投资的账面价值为15,033,676,835.83元，公允价值为15,374,331,530.45元）。

债权投资按如下原则确定公允价值：(i) 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。(ii) 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。(iii) 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。

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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》的有关规定，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。于2024年12月31日，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次（2023年12月31日：同）。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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  | 权益投资  | -  | -            |
|    | 其中：股票 | -  | -            |



|   |                   |                   |        |
|---|-------------------|-------------------|--------|
| 2 | 基金投资              | -                 | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 15,026,996,756.84 | 99.98  |
|   | 其中：债券             | 15,026,996,756.84 | 99.98  |
|   | 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          | -                 | -      |
|   | 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      | 2,302,219.57      | 0.02   |
| 8 | 其他各项资产            | -                 | -      |
| 9 | 合计                | 15,029,298,976.41 | 100.00 |

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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。

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未买入股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未卖出股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票交易。

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(%) |
|----|-----------|-------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                 | -            |
| 2  | 央行票据      | -                 | -            |
| 3  | 金融债券      | 15,026,996,756.84 | 176.96       |
|    | 其中：政策性金融债 | 15,026,996,756.84 | 176.96       |
| 4  | 企业债券      | -                 | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -                 | -            |
| 6  | 中期票据      | -                 | -            |
| 7  | 可转债(可交换债) | -                 | -            |
| 8  | 同业存单      | -                 | -            |
| 9  | 其他        | -                 | -            |
| 10 | 合计        | 15,026,996,756.84 | 176.96       |

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量（张）      | 公允价值             | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|------------|------------------|--------------|
| 1  | 160210 | 16国开10 | 66,300,000 | 6,766,119,683.88 | 79.68        |
| 2  | 160418 | 16农发18 | 52,700,000 | 5,417,380,214.85 | 63.80        |
| 3  | 190204 | 19国开04 | 10,800,000 | 1,116,811,599.69 | 13.15        |
| 4  | 160303 | 16进出03 | 10,700,000 | 1,099,199,071.43 | 12.94        |
| 5  | 160408 | 16农发08 | 6,100,000  | 627,486,186.99   | 7.39         |

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 本基金本报告期末投资股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末无其他资产。

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§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<br>户数 | 户均持有的基金<br>份额 | 持有人结构 |       |
|-----------|---------------|-------|-------|
|           |               | 机构投资者 | 个人投资者 |

| 数(户) |               | 持有份额             | 占总份<br>额比例 | 持有份额     | 占总份<br>额比例 |
|------|---------------|------------------|------------|----------|------------|
| 218  | 36,881,558.29 | 8,040,177,504.20 | 100.00%    | 2,203.99 | 0.00%      |

9.2 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%    |

期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                                 | 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<br>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。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2020年11月23日)基金份额总额 | 7,999,034,191.94 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 8,040,179,708.19 |
| 本报告期基金总申购份额                | -                |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | -                |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -                |
| 本报告期期末基金份额总额               | 8,040,179,708.19 |

§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，基金管理人于2024年4月8日增聘史少杰先生担任公司副总经理职务。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 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。

11.5 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。

报告期内应支付给会计师事务所的审计费用为人民币60,000.00元。

目前毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)向本基金提供审计服务的连续年限：自2023年12月12日起至今。

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，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未因本基金受到监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未通过证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                     | 法定披露方式    | 法定披露日期     |
|----|------------------------------------------|-----------|------------|
| 1  | 中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金2023年第4季度报告       | 中国证监会规定网站 | 2024-01-19 |
| 2  | 中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金2023年年度报告         | 中国证监会规定网站 | 2024-03-26 |
| 3  | 中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金2024年第1季度报告       | 中国证监会规定网站 | 2024-04-22 |
| 4  | 中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）2024年第1号 | 中国证监会规定网站 | 2024-06-07 |
| 5  | 中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要更新        | 中国证监会规定网站 | 2024-06-07 |
| 6  | 中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金2024年第2季度报告       | 中国证监会规定网站 | 2024-07-18 |
| 7  | 中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金2024年中期报告         | 中国证监会规定网站 | 2024-08-28 |
| 8  | 中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金2024年第3季度报告       | 中国证监会规定网站 | 2024-10-25 |

§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

| 投资者 | 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              | 持有基金份额比 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额       | 持有份额<br>份额占比 |

| 类别                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 号 | 例达到或者超过20%的时间区间       |                  |      |      |                  |        |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|-----------------------|------------------|------|------|------------------|--------|
| 机构                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 1 | 2024年1月1日至2024年12月31日 | 2,999,999,000.00 | 0.00 | 0.00 | 2,999,999,000.00 | 37.31% |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | 2 | 2024年1月1日到2024年12月31日 | 1,999,999,000.00 | 0.00 | 0.00 | 1,999,999,000.00 | 24.88% |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |   |                       |                  |      |      |                  |        |
| <p>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：</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（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五十个工作日低于5000万元，本基金可能面临基金合同提前终止等情形。</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>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。</p> |   |                       |                  |      |      |                  |        |

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中泰青月安盈66个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《中泰青月安盈66个月定期开放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。

13.2 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。

### 13.3 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

二〇二五年三月二十六日