

# 国泰瞬利交易型货币市场基金

## 2023 年中期报告

### 2023 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 年 8 月 28 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。

为了更好地满足投资人的理财需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》和本基金基金合同的有关规定，本基金管理人经与本基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2023 年 4 月 28 日起调整本基金 A 类基金份额的销售服务费率，并相应修改基金合同等法律文件的相关条款。本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率由 0.25% 调整为 0.01%。具体可查阅本基金管理人于 2023 年 4 月 28 日发布的《国泰基金管理有限公司关于国泰瞬利交易型货币市场基金调整 A 类基金份额的销售服务费率并修改基金合同等法律文件的公告》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	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	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>5 托管人报告</b>	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
<b>7 投资组合报告</b>	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 债券回购融资情况	39
7.3 基金投资组合平均剩余期限	40
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	41
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	41
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	42
7.9 投资组合报告附注	42
<b>8 基金份额持有人信息</b>	44

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	44
8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	45
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
8.5 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的情况 .....	45
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>46</b>
<b>10 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	48
10.9 其他重大事件 .....	48
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>49</b>
<b>12 备查文件目录 .....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录 .....	49
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	49

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国泰瞬利交易型货币市场基金		
基金简称	国泰瞬利货币		
场内简称	货币基金 ETF		
基金主代码	511620		
交易代码	511620		
基金运作方式	交易型开放式		
基金合同生效日	2017 年 8 月 4 日		
基金管理人	国泰基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	28,461,369,767.80 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	国泰瞬利货币 A	国泰瞬利货币 D	国泰瞬利货币 E
下属分级基金的交易代码	511620	015379	015380
报告期末下属分级基金的份额总额	2,838,454.56 份	28,458,314,026.71 份	217,286.53 份

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

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。 1、本基金具体投资策略：（1）滚动配置策略；（2）久期控制策略；（3）套利策略；（4）时机选择策略。 2、参与证券质押业务。 3、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场证券投资基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

### 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	国泰基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	姓名
	刘国华	王小飞

负责人	联系电话	021-31081600转	021-60637103
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		(021)31089000, 400-888-8688	021-60637228
传真		021-31081800	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦16层-19层	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		200082	100033
法定代表人		邱军	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金中期报告备置地点	上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦 16层-19层和本基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023年1月1日至2023年6月30日）		
	国泰瞬利货币 A	国泰瞬利货币 D	国泰瞬利货币 E
本期已实现收益	720,046.88	214,710,581.94	2,210.71
本期利润	720,046.88	214,710,581.94	2,210.71
本期净值收益率	1.0800%	1.1576%	1.0372%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)		
	国泰瞬利货币 A	国泰瞬利货币 D	国泰瞬利货币 E
期末基金资产净值	283,845,455.62	28,458,314,026.71	217,286.53
期末基金份额净值	100.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)		
	国泰瞬利货币 A	国泰瞬利货币 D	国泰瞬利货币 E
累计净值收益率	8.3542%	2.3067%	2.4035%

注：(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

(4)本基金收益分配按日结转份额。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 1. 国泰瞬利货币 A:

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1902%	0.0007%	0.1110%	0.0000%	0.0792%	0.0007%
过去三个月	0.5596%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.2230%	0.0005%
过去六个月	1.0800%	0.0006%	0.6695%	0.0000%	0.4105%	0.0006%
过去一年	1.9351%	0.0012%	1.3500%	0.0000%	0.5851%	0.0012%
过去三年	5.1150%	0.0015%	4.0481%	0.0000%	1.0669%	0.0015%
自基金合同生效起至今	8.3542%	0.0022%	7.9742%	0.0000%	0.3800%	0.0022%

##### 2. 国泰瞬利货币 D:

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1902%	0.0007%	0.1110%	0.0000%	0.0792%	0.0007%
过去三个月	0.5774%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.2408%	0.0005%
过去六个月	1.1576%	0.0005%	0.6695%	0.0000%	0.4881%	0.0005%
过去一年	2.1369%	0.0011%	1.3500%	0.0000%	0.7869%	0.0011%
自新增 D 类份额起至今	2.3067%	0.0017%	1.4314%	0.0000%	0.8753%	0.0017%

##### 3. 国泰瞬利货币 E:

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1704%	0.0007%	0.1110%	0.0000%	0.0594%	0.0007%
过去三个月	0.5172%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.1806%	0.0005%
过去六个月	1.0372%	0.0005%	0.6695%	0.0000%	0.3677%	0.0005%

过去一年	1.8945%	0.0011%	1.3500%	0.0000%	0.5445%	0.0011%
自新增 E 类份额起至今	2.4035%	0.0016%	1.7642%	0.0000%	0.6393%	0.0016%

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

#### 国泰瞬利交易型货币市场基金

自基金合同生效以来份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

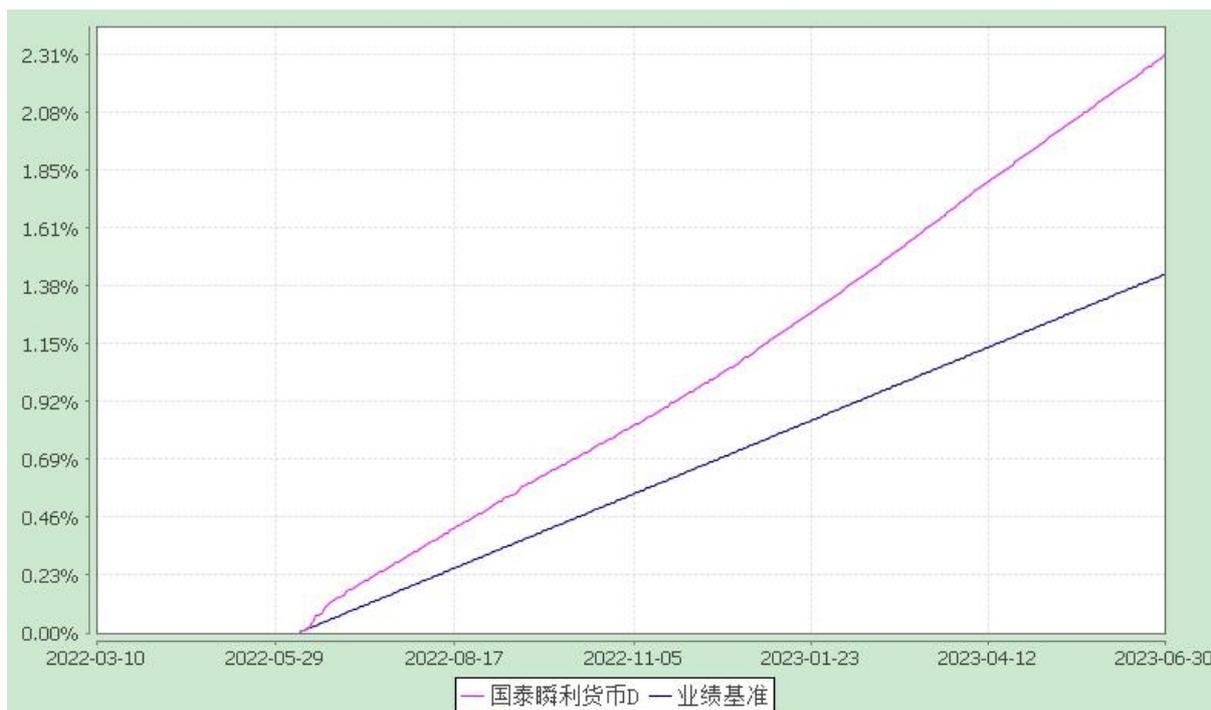
(2017 年 8 月 4 日至 2023 年 6 月 30 日)

#### 国泰瞬利货币 A



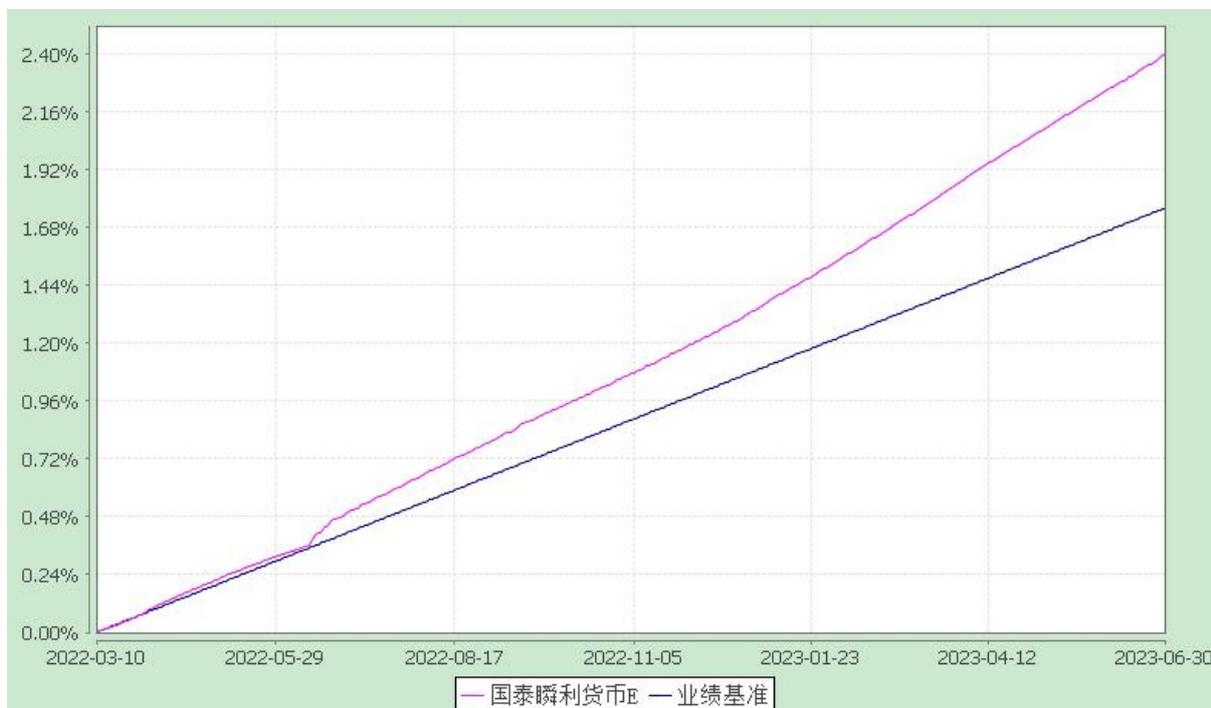
注：本基金的合同生效日为 2017 年 8 月 4 日。本基金在 6 个月建仓结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

#### 国泰瞬利货币 D



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

#### 国泰瞬利货币 E



注：本基金合同生效日为 2017 年 8 月 4 日。本基金在 6 个月建仓结束时，各项资产配置比例符合合同约定。自 2022 年 3 月 10 日起，本基金增加 E 类份额并分别设置对应的基金代码。自 2022 年 3 月 11 日起，E 类开始有份额并计算净值。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金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

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 244 只开放式证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
丁士恒	国泰利是宝货币、国泰惠鑫一年定期开放债券、国泰货币、国泰现金管理货币、国泰瞬利货币 ETF、国泰利享中短债债券、国泰利享安益短债债券的基金经	2020-05-15	-	9 年	硕士研究生。2014 年 1 月加入国泰基金，任交易员。2020 年 5 月起任国泰货币市场证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰利是宝货币市场基金、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金和国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2022 年 12 月起兼任国泰利享安益短债债券型证券投资基金的基金经理。

	理				
陶然	国泰利是宝货币、国泰货币、国泰瞬利货币ETF、国泰利享中短债债券、国泰利优30天滚动持有短债债券、国泰利泽90天滚动持有中短债债券、国泰中证同业存单AAA指数7天持有期、国泰利盈60天滚动持有中短债、国泰利安中短债债券的基金经理	2020-07-07	-	12年	硕士研究生，CFA。曾任职于海富通基金管理有限公司、华安基金管理有限公司、汇添富基金管理股份有限公司。2020年3月加入国泰基金，拟任基金经理。2020年7月至2022年8月任国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2020年7月至2022年11月任国泰现金管理货币市场基金的基金经理，2020年7月起任国泰货币市场证券投资基金、国泰利是宝货币市场基金、国泰瞬利交易型货币市场基金和国泰利享中短债债券型证券投资基金的基金经理，2021年6月起兼任国泰利优30天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理，2021年8月起兼任国泰利泽90天滚动持有中短债债券型证券投资基金的基金经理，2022年5月起兼任国泰中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金的基金经理，2022年11月起兼任国泰利盈60天滚动持有中短债债券型证券投资基金的基金经理，2022年12月起兼任国泰利安中短债债券型证券投资基金的基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与

本基金管理人所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

##### （一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合间同向交易记录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值都在 1%数量级及以下，且大多数溢价率均值都可以通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

##### （二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 $\geq 30$ ），溢价率均值普遍在 1%数量级及以下。为稳妥起见，对于溢价率均值过大的基金或组合配对，我们也进行了模拟溢价金额计算。

##### （三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，基金经理也对价差作出了解释，公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 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

年初疫情消退后，生产生活有序恢复，市场对 23 年经济复苏预期明显抬升，各期限收益率上行。2 月更多受到资金面的扰动，年初信贷投放节奏较快，银行体系流动性趋紧，2 月资金面波动加剧，

资金利率中枢上移，短端收益率继续攀升。3 月政府工作报告将今年经济增长目标定在 5%左右，大幅低于市场预期，叠加超预期降准及海外银行体系风险事件，共同推动债市下行。4 月初公布的经济数据大幅低于市场预期，月末的政治局会议强调高质量发展不搞强刺激，各期限收益率下行。5 月，银行陆续下调存款利率带动降息预期升温，信贷需求放缓银行间流动性宽松，资金利率走低，短端收益率下行幅度较长端更大。6 月中旬，OMO 利率超预期调降 10bp，带动各期限收益率快速下行。6 月下半月，利率创新低后获利了结需求增加，跨季因素对流动性扰动增加，流动性分层加剧，多重利空因素作用下利率反弹。上半年流动性呈现出总量充裕，结构性短缺的特点，3M Shibor 利率窄幅波动，DR007 均值围绕公开市场操作利率小幅波动。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类本报告期内的净值增长率为 1.0800%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

本基金 D 类本报告期内的净值增长率为 1.1576%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

本基金 E 类本报告期内的净值增长率为 1.0372%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，7 月政治局会议总体政策基调没有大的转变，依然强调注重高质量发展。经济复苏主线仍将是影响债市运行的主导逻辑，重点观察房地产销售、消费和出口代表的内生动能修复情况。目前的经济环境还需要宽松的货币政策保驾护航，预计流动性将继续维持在合理充裕水平。

我们将在密切跟踪基本面、政策面和资金面的前提下，做好各类别资产配置以及比例的动态调整。同时，严防信用风险，规避高风险主体。组合将延续积极的投资策略，力求为持有人在管理好流动性的前提下获取持续稳定的投资回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出

相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金利润分配按日结转份额。本基金管理人已根据本基金基金合同和相关法律法规的规定对相应分配利润进行了分配。

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

无。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：国泰瞬利交易型货币市场基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,273,190,458.12	3,667,933,205.10
结算备付金		48,698,030.26	454,777.62
存出保证金		8,054.52	908.07
交易性金融资产	6.4.7.2	16,634,906,333.02	6,163,154,312.04
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		16,544,565,434.54	6,153,317,493.39
资产支持证券投资		90,340,898.48	9,836,818.65
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	9,385,396,160.86	3,447,201,349.72
应收清算款		109,615,745.58	99,530,335.98
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		31,451,814,782.36	13,378,274,888.53
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,700,341,570.09	1,193,431,983.86
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,999,146.12	2,269,926.37
应付托管费		1,136,169.58	515,892.34
应付销售服务费		227,276.78	106,712.21
应付投资顾问费		-	-
应交税费		436,861.07	192,094.01
应付利润		1,834,459.04	1,618,785.16
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	462,530.82	241,299.34
负债合计		2,709,438,013.50	1,198,376,693.29
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	28,742,376,768.86	12,179,898,195.24
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		28,742,376,768.86	12,179,898,195.24
负债和净资产总计		31,451,814,782.36	13,378,274,888.53

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 28,742,376,768.86 份，其中 A 类基金份额净值 100.0000 元，份额总额 2,838,454.56 份；D 类基金份额净值 1.0000 元，份额总额 28,458,314,026.71 份；E 类基金份额净值 1.0000 元，份额总额 217,286.53 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国泰瞬利交易型货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		249,341,459.58	2,635,165.90
1.利息收入		115,055,277.85	561,927.07
其中：存款利息收入	6.4.7.9	54,151,693.38	14,556.72
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		60,903,584.47	547,370.35
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		134,284,781.73	2,073,238.83
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	132,589,732.57	2,073,238.83
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	1,695,049.16	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,400.00	-
<b>减：二、营业总支出</b>		33,908,620.05	436,925.90
1. 管理人报酬		20,323,979.35	202,060.32
2. 托管费		4,619,086.31	47,312.00
3. 销售服务费		942,838.63	52,271.39
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		7,596,150.65	93,629.83
其中：卖出回购金融资产支出		7,596,150.65	93,629.83

6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		236,686.63	976.08
8. 其他费用	6.4.7.17	189,878.48	40,676.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>215,432,839.53</b>	<b>2,198,240.00</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>215,432,839.53</b>	<b>2,198,240.00</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>215,432,839.53</b>	<b>2,198,240.00</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰瞬利交易型货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	12,179,898,195.24	-	12,179,898,195.24
二、本期期初净资产（基金净值）	12,179,898,195.24	-	12,179,898,195.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	16,562,478,573.62	-	16,562,478,573.62
（一）、综合收益总额	-	215,432,839.53	215,432,839.53
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	16,562,478,573.62	-	16,562,478,573.62
其中：1.基金申购款	22,837,054,666.55	-	22,837,054,666.55
2.基金赎回款	-6,274,576,092.93	-	-6,274,576,092.93
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-215,432,839.53	-215,432,839.53

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产（基金净值）	28,742,376,768.86	-	28,742,376,768.86
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	13,786,213.76	-	13,786,213.76
二、本期期初净资产（基金净值）	13,786,213.76	-	13,786,213.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,072,597,731.94	-	3,072,597,731.94
（一）、综合收益总额	-	2,198,240.00	2,198,240.00
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	3,072,597,731.94	-	3,072,597,731.94
其中：1.基金申购款	3,144,587,583.27	-	3,144,587,583.27
2.基金赎回款	-71,989,851.33	-	-71,989,851.33
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-2,198,240.00	-2,198,240.00
四、本期期末净资产（基金净值）	3,086,383,945.70	-	3,086,383,945.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周向勇，主管会计工作负责人：倪莹，会计机构负责人：吴洪涛

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国泰瞬利交易型货币市场基金(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[2013]1070 号文《关于核准国泰瞬利场内实时申赎货币市场基金募集的批复》及证监许可[2017]505 号文《关于准予国泰瞬利场内实时申赎货币市场基金变更注册的批复》核准,由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰瞬利交易型货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 392,072,000.00 元。业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 728 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰瞬利交易型货币市场基金基金合同》于 2017 年 8 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 392,074,400.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 2,400.00 份基金份额。国泰基金管理有限公司已于基金合同生效日 2017 年 8 月 4 日对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算。本基金折算前的基金份额总额为 392,074,400.00 份,折算前基金份额净值为 1.0000 元;根据本基金的基金份额折算方法,折算后基金份额总额为 3,920,744.00 份,折算后基金份额净值为 100.0000 元。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2017]259 号文审核同意,本基金 3,920,744.00 份基金份额于 2017 年 9 月 7 日在上交所挂牌交易。

根据基金管理人国泰基金管理有限公司于 2022 年 3 月 9 日发布的《国泰基金管理有限公司关于国泰瞬利交易型货币市场基金降低管理费率、托管费率及增设基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》的规定,经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,自 2022 年 3 月 10 日起对本基金增设场外基金份额并相应修改法律文件。本基金的基金份额分为 A 类基金份额、D 类基金份额和 E 类基金份额,A 类为场内基金份额,D 类和 E 类为场外基金份额。各类基金份额单独设置基金代码,并分别公布各类基金份额的每万份或每百份基金已实现收益和各类基金份额的七日年化收益率。D 类和 E 类基金份额通过基金管理人及其指定的场外销售机构办理申购和赎回等业务。A 类基金份额通过上海证券交易所场内交易系统办理认购、申购和赎回等业务,并在上海证券交易所上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰瞬利交易型货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单,剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券,以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准:同期七天通知存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2023 年 8 月 28 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰瞬利交易型货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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

税项列示如下：

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

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	3,977,582.86
等于：本金	3,975,274.54
加：应计利息	2,308.32
定期存款	5,269,212,875.26
等于：本金	5,250,000,000.00
加：应计利息	19,212,875.26
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	950,206,319.47
存款期限 3 个月以上	4,319,006,555.79
其他存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	5,273,190,458.12

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 月 30 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	164,089,870.63	163,755,381.92	-334,488.71	-0.0012
	银行间市场	16,380,475,563.91	16,417,614,106.51	37,138,542.60	0.1292
	合计	16,544,565,434.54	16,581,369,488.43	36,804,053.89	0.1280
资产支持证券		90,340,898.48	90,601,841.10	260,942.62	0.0009
合计		16,634,906,333.02	16,671,971,329.53	37,064,996.51	0.1290

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	800,088,840.39	-
银行间市场	8,585,307,320.47	-
合计	9,385,396,160.86	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	324,299.09
其中：交易所市场	-
银行间市场	324,299.09
应付利息	-
预提费用	138,231.73
合计	462,530.82

### 6.4.7.7 实收基金

国泰瞬利货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	174,587.10	17,458,709.85
本期申购	4,350,315.24	435,031,524.03
本期赎回（以“-”号填列）	-1,686,447.78	-168,644,778.26
本期末	2,838,454.56	283,845,455.62

注：申购含红利再投份额。

国泰瞬利货币 D

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,162,214,424.99	12,162,214,424.99
本期申购	22,402,010,916.39	22,402,010,916.39

本期赎回（以“-”号填列）	-6,105,911,314.67	-6,105,911,314.67
本期末	28,458,314,026.71	28,458,314,026.71

注：申购含红利再投份额。

国泰瞬利货币 E

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	225,060.40	225,060.40
本期申购	12,226.13	12,226.13
本期赎回（以“-”号填列）	-20,000.00	-20,000.00
本期末	217,286.53	217,286.53

注：申购含红利再投份额。

6.4.7.8 未分配利润

国泰瞬利货币 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	720,046.88	-	720,046.88
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	-720,046.88	-	-720,046.88
本期末	-	-	-

国泰瞬利货币 D

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	214,710,581.94	-	214,710,581.94
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-214,710,581.94	-	-214,710,581.94
本期末	-	-	-

国泰瞬利货币 E

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	2,210.71	-	2,210.71
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	-2,210.71	-	-2,210.71
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	43,280.91
定期存款利息收入	53,854,211.55
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	254,176.96
其他	23.96
合计	54,151,693.38

#### 6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	126,360,991.70
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,228,740.87
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	132,589,732.57

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期

	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	16,465,388,537.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	16,372,646,571.05
减：应计利息总额	86,513,225.36
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	6,228,740.87

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	1,695,371.04
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-321.88
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,695,049.16

##### 6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	9,905,854.16
减：卖出资产支持证券成本总额	9,813,921.88
减：应计利息总额	92,254.16
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-321.88

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	1,400.00
合计	1,400.00

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	69,424.36
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
查询服务费	600.00
银行汇划费用	43,846.75
银行间账户维护费	16,500.00
合计	189,878.48

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国建银投资有限责任公司(“中国建投”)	基金管理人的控股股东
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人

中国电力财务有限公司	基金管理人的股东
国泰基金管理有限公司	基金管理人

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	20,323,979.35	202,060.32
其中：支付销售机构的客户维护费	72,685.21	-

注：(1)自基金合同生效日起至 2022 年 3 月 9 日，支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.28% 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 X 0.28% / 当年天数；

(2)基金管理人国泰基金管理有限公司自 2022 年 3 月 10 日起调整本基金年管理费率为原 0.28% 降低至 0.22%，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 X 0.22% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,619,086.31	47,312.00

注：(1)自基金合同生效日起至 2022 年 3 月 9 日，支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.09% 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 X 0.09% / 当年天数；

(2)基金管理人国泰基金管理有限公司自 2022 年 3 月 10 日起调整本基金年托管费率为原 0.09%

降低至 0.05%，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	国泰瞬利货币 A	国泰瞬利货币 D	国泰瞬利货币 E	合计
国泰基金管理有限公司	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	国泰瞬利货币 A	国泰瞬利货币 D	国泰瞬利货币 E	合计
国泰基金管理有限公司	18.68	-	-	18.68
合计	18.68	-	-	18.68

注：(1)支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国泰基金管理有限公司，再由国泰基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。本基金约定的国泰瞬利货币 A 级销售服务费年费率自 2023 年 4 月 28 日起由原 0.25%降低至 0.01%。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.01\% / \text{当年天数}；$$

(2)基金管理人国泰基金管理有限公司自 2022 年 3 月 10 日起新增场外份额国泰瞬利货币 D 类基金份额，销售服务费年费率为 0.01%，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.01\% / \text{当年天数}；$$

(3)基金管理人国泰基金管理有限公司自 2022 年 3 月 10 日起新增场外份额国泰瞬利货币 E 类基金份额，销售服务费年费率为 0.25%，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年6月30日			2022年1月1日至2022年6月30日		
	国泰瞬利货币 A	国泰瞬利货币 D	国泰瞬利货币 E	国泰瞬利货币 A	国泰瞬利货币 D	国泰瞬利货币 E
期初持有的基金份额	104,742.00	-	100,073.84	103,082.00	-	-
期间申购/买入总份额	1,137.00	-	1,044.32	784.00	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-	-	-
期末持有的基金份额	105,879.00	-	101,118.16	103,866.00	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	-	0.00%	0.00%	-	-

注：1. 报告期间申购/买入总份额含红利再投份额；

2. 基金管理人国泰基金管理有限公司在本报告期申购本基金的交易均为红利再投，无手续费；

3. 本基金管理人运用固有资金投资国泰瞬利货币 A 类，份额面值为 100.00 元，投资国泰瞬利货币 E 类，份额面值为 1.00 元。

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

##### 国泰瞬利货币 A

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

##### 国泰瞬利货币 D

份额单位：份

关联方名称	国泰瞬利货币D本期末 2023年6月30日		国泰瞬利货币D上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
中国电力财务有限公司	102,197,641.71	0.36%	101,021,199.79	0.83%

##### 国泰瞬利货币 E

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	3,977,582.86	43,280.91	5,789,760.97	3,916.82

注：本基金的银行活期存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 1、国泰瞬利货币 A

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
704,024.03	-	16,022.85	720,046.88	-

注：本基金 A 类在本年度累计分配收益 720,046.88 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 704,024.03 元，计入应付收益科目 16,022.85 元。

##### 2、国泰瞬利货币 D

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
214,510,916.39	-	199,665.55	214,710,581.94	-

注：本基金 D 类在本年度累计分配收益 214,710,581.94 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 214,510,916.39 元，计入应付收益科目 199,665.55 元。

##### 3、国泰瞬利货币 E

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
2,225.23	-	-14.52	2,210.71	-

注：本基金 E 类在本年度累计分配收益 2,210.71 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金

2,225.23 元，计入应付收益科目-14.52 元。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限的股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,700,341,570.09 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
220214	22 国开 14	2023-07-03	99.78	28,422,000.00	2,835,893,883.74
合计				28,422,000.00	2,835,893,883.74

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场证券投资基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。本基金投资的金融工具主要为各类货币市场工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，以实现在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对

各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年末 2022年12月31日
A-1	-	30,387,529.21
A-1 以下	-	-
未评级	4,620,562,445.17	2,900,715,060.07
合计	4,620,562,445.17	2,931,102,589.28

注：本基金持有的未评级债券包括短期融资券、超短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	3,711,245,913.59	1,746,864,890.45
AAA 以下	888,244,203.00	258,650,592.45
未评级	-	-
合计	4,599,490,116.59	2,005,515,482.90

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2023 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 2,700,341,570.09 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20% 时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50% 时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的

基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月 30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款	4,572,062,013.85	701,128,444.27	-	-	5,273,190,458.12
结算备付金	48,698,030.26	-	-	-	48,698,030.26
存出保证金	8,054.52	-	-	-	8,054.52
交易性金融资产	14,477,153,924.81	2,157,752,408.21	-	-	16,634,906,333.02
买入返售金融资产	9,385,396,160.86	-	-	-	9,385,396,160.86
应收清算款	-	-	-	109,615,745.58	109,615,745.58
资产总计	28,483,318,184.30	2,858,880,852.48	-	109,615,745.58	31,451,814,782.36
负债					
卖出回购金融资产款	2,700,341,570.09	-	-	-	2,700,341,570.09
应付管理人报酬	-	-	-	4,999,146.12	4,999,146.12
应付托管费	-	-	-	1,136,169.58	1,136,169.58
应付销售服务费	-	-	-	227,276.78	227,276.78
应交税费	-	-	-	436,861.07	436,861.07
应付利润	-	-	-	1,834,459.04	1,834,459.04
其他负债	-	-	-	462,530.82	462,530.82
负债总计	2,700,341,570.09	-	-	9,096,443.41	2,709,438,013.50
利率敏感度缺口	25,782,976,614.21	2,858,880,852.48	-	100,519,302.17	28,742,376,768.86
上年度末 2022年12月 31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计

资产					
银行存款	3,667,933,205.10	-	-	-	3,667,933,205.10
结算备付金	454,777.62	-	-	-	454,777.62
存出保证金	908.07	-	-	-	908.07
交易性金融资产	5,239,725,535.70	923,428,776.34	-	-	6,163,154,312.04
买入返售金融资产	3,447,201,349.72	-	-	-	3,447,201,349.72
应收清算款	-	-	-	99,530,335.98	99,530,335.98
资产总计	12,355,315,776.21	923,428,776.34	-	99,530,335.98	13,378,274,888.53
负债					
卖出回购金融资产款	1,193,431,983.86	-	-	-	1,193,431,983.86
应付管理人报酬	-	-	-	2,269,926.37	2,269,926.37
应付托管费	-	-	-	515,892.34	515,892.34
应付销售服务费	-	-	-	106,712.21	106,712.21
应交税费	-	-	-	192,094.01	192,094.01
应付利润	-	-	-	1,618,785.16	1,618,785.16
其他负债	-	-	-	241,299.34	241,299.34
负债总计	1,193,431,983.86	-	-	4,944,709.43	1,198,376,693.29
利率敏感度缺口	11,161,883,792.35	923,428,776.34	-	94,585,626.55	12,179,898,195.24

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率外其他市场条件不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
分析		本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
市场利率上升 25 个基点		-13,155,258.01	-4,729,991.78
市场利率下降 25 个基点		13,184,069.64	4,739,593.37

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资（2022 年 12 月 31 日：无），因此无其他价格风险敞口（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	16,634,906,333.02	6,163,154,312.04
第三层次	-	-
合计	16,634,906,333.02	6,163,154,312.04

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：

同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	16,634,906,333.02	52.89
	其中：债券	16,544,565,434.54	52.60
	资产支持证券	90,340,898.48	0.29
2	买入返售金融资产	9,385,396,160.86	29.84
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	5,321,888,488.38	16.92
4	其他各项资产	109,623,800.10	0.35
5	合计	31,451,814,782.36	100.00

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	4.38	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	2,700,341,570.09	9.39
	其中：买断式回购融资	-	-

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

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内正回购的资金余额未超过基金资产净值的 20%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	63

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期无剩余期限超过 120 天的情况。

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	33.34	9.39
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	5.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	35.56	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	15.03	-
4	90 天（含）—120 天	3.51	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	31.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	109.08	9.39

### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期无剩余存续期超过 240 天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,065,075,494.12	21.10
	其中：政策性金融债	5,799,625,863.93	20.18
4	企业债券	164,089,870.63	0.57
5	企业短期融资券	4,620,562,445.17	16.08
6	中期票据	1,095,347,508.03	3.81
7	同业存单	4,599,490,116.59	16.00
8	其他	-	-
9	合计	16,544,565,434.54	57.56
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	4,325,142,466.09	15.05

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	220214	22 国开 14	29,900,000	2,983,365,953.27	10.38
2	230214	23 国开 14	12,900,000	1,291,797,409.96	4.49
3	230201	23 国开 01	10,100,000	1,019,433,406.77	3.55
4	220411	22 农发 11	3,200,000	323,551,794.81	1.13
5	112393231	23 广州农村商业银行 CD001	3,000,000	298,842,747.07	1.04
6	112321235	23 渤海银行 CD235	3,000,000	296,554,664.02	1.03
7	012283907	22 首钢 SCP006	2,500,000	252,350,048.74	0.88
8	112321115	23 渤海银行 CD115	2,500,000	246,775,355.13	0.86
9	112381422	23 台州银行 CD039	2,100,000	207,762,153.53	0.72
10	012380396	23 首钢 SCP001	2,000,000	201,394,014.73	0.70

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
----	------

报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0 次
报告期内偏离度的最高值	0.1508%
报告期内偏离度的最低值	0.0225%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0895%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未出现负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112706	恒信 03 优	900,000.00	90,340,898.48	0.31

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 基金计价方法说明

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

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

7.9.2 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“渤海银行、国开行、农发行、广州农商行”违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

渤海银行及下属分支机构因未执行统一授信；通过发放新授信业务掩盖资产质量，五级分类未准确反映信贷资产风险状况；贷后管理不到位；授信业务内部控制流程欠缺；接受未经董事会备案的财务公司股权质押；违规提供项目融资；基金销售业务部门负责人、部分分支行基金销售业务负责人未取得基金从业资格；合规风控人员未对基金新销售产品进行合规审查并出具合规审查意见；未将基金销售保有规模、投资人长期收益纳入分支机构和基金销售人员考核评价指标体系；违反存款准备金管理规定；违反账户管理规定；违反清算管理规定；违反人民币反假有关规定；占压财政存款或者资金；违反国库科目设置和使用规定；违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；违反征信安全管理规定；未按规定履行客户身份识别义务；未按规定保存客户身份资料和交易记录；未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、

假名账户；小微企业贷款风险分类不准确；小微企业贷款资金被挪用于购买理财产品；将银行员工、公务员等个人商用房贷款计入普惠型个体工商户或小微企业主贷款统计口径；将非小微企业划归统计口径；违规发放商用房贷款等原因，受到监管机构公开处罚。

国家开发银行下属分支机构因违规收取小微企业贷款承诺费；违规转嫁抵押登记费和押品评估费；向不合规的项目发放贷款；流动资金贷款受托支付审查不尽职，对同一贸易背景进行重复融资；固定资产贷款受托支付未收集用途资料，信贷资金挪用；信贷资金被挪用于归还借款人本行前期贷款本金；银团贷款贷后管理不尽职；未严格执行受托支付；发放固定资产贷款未落实实贷实付要求；自营贷款承接本行理财融资等原因，受到监管机构公开处罚。

农业发展银行下属分支机构因未严格按照公布的收费价目名录收取融资顾问费；固定资产贷款贷后管理不到位，信贷资金未按约定用途使用；流动资金贷款贷后管理不到位，信贷资金实际用途与合同约定不符；未按规定进行贷款资金支付管理与控制；存贷挂钩，违规收取贷款保证金；未严格执行受托支付相关规定；未经任职资格审查任命高级管理人员；未落实“实贷实付”，以资金滞留方式以贷转存；未按照合同约定条件，根据项目实际进度和资金需求发放贷款资金，贷款的管理严重违反审慎经营规则；项目资本金管理不到位、资本金被违规抽回；贷款管理不审慎、未严格对借款人还款来源和现金流进行监测分析；违规发放发放资本金比例不到位的项目贷款；贷款“三查”不到位；换领许可证未按规定进行公告；违规为不符合政府购买服务规定项目提供融资等原因，受到监管机构公开处罚。

广州农村商业银行股份有限公司因同业及理财业务严重违反审慎经营规则，配合现场检查不力等原因，受到监管机构公开处罚。

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

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,054.52
2	应收清算款	109,615,745.58

3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	109,623,800.10

### 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国泰瞬利货币 A	770	3,686.30	2,436,467.00	85.84%	399,302.00	14.07%
国泰瞬利货币 D	87	327,107,057.78	28,456,986,579.94	100.00%	1,327,446.77	0.00%
国泰瞬利货币 E	10	21,728.65	101,118.16	46.54%	116,168.37	53.46%
合计	867	32,827,416.11	28,459,524,165.10	99.99%	1,842,917.14	0.01%

#### 8.2 期末上市基金前十名持有人

国泰瞬利货币 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	上海磐晟私募基金管理有限公司—添福利私募证券投资基金磐晟二期	380,103.00	13.39%
2	上海磐晟私募基金管理有限公司—	309,269.00	10.90%

	磐晟泰盈十二号私募证券投资基金		
3	上海磐晟私募基金管理有限公司一添福利私募证券投资基金磐晟十八期	269,200.00	9.48%
4	上海磐晟私募基金管理有限公司一磐晟长盈 3 号私募证券投资基金	242,102.00	8.53%
5	上海磐晟私募基金管理有限公司一添福利私募证券投资基金磐晟二十期	230,702.00	8.13%
6	上海磐晟私募基金管理有限公司一添福利私募证券投资基金磐晟九期	198,415.00	6.99%
7	华创证券有限责任公司	150,195.00	5.29%
8	上海磐晟私募基金管理有限公司一添福利私募证券投资基金磐晟二十三期	126,593.00	4.46%
9	上海磐晟私募基金管理有限公司一添福利私募证券投资基金磐晟十六期	105,884.00	3.73%
10	国泰基金管理有限公司	105,879.00	3.73%

注：以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供的名册编制。

### 8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	1,212,674,161.51	4.26%
2	银行类机构	1,210,328,907.93	4.25%
3	银行类机构	1,209,974,275.30	4.25%
4	银行类机构	1,206,785,039.47	4.24%
5	其他机构	1,201,454,327.12	4.22%
6	银行类机构	1,109,096,347.68	3.90%
7	银行类机构	1,105,698,624.93	3.88%
8	券商类机构	1,103,973,388.62	3.88%
9	银行类机构	1,008,247,229.49	3.54%
10	银行类机构	1,007,384,407.62	3.54%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	国泰瞬利货币 A	0.00	0.00%
	国泰瞬利货币 D	0.00	0.00%
	国泰瞬利货币 E	2,990.01	1.38%
	合计	2,990.01	0.00%

### 8.5 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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	国泰瞬利货币 A	0
	国泰瞬利货币 D	0
	国泰瞬利货币 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国泰瞬利货币 A	0
	国泰瞬利货币 D	0
	国泰瞬利货币 E	0
	合计	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰瞬利货币 A	国泰瞬利货币 D	国泰瞬利货币 E
基金合同生效日（2017 年 8 月 4 日）基金份额总额	3,920,744.00	-	-
本报告期期初基金份额总额	174,587.10	-	-
本报告期基金总申购份额	4,350,315.24	22,402,010,916.39	12,226.13
减：本报告期基金总赎回份额	1,686,447.78	6,105,911,314.67	20,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,838,454.56	28,458,314,026.71	217,286.53

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合

伙)。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人及高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
上海证券	1	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资历雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、

行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
上海证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	271,633,648.77	100.00%	43,160,000,000.00	100.00%	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日

			期
1	国泰基金管理有限公司关于国泰瞬利交易型货币市场基金调整 A 类基金份额的销售服务费率并修改基金合同等法律文件的公告	《上海证券报》	2023-04-28

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足投资人的理财需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》和本基金基金合同的有关规定，本基金管理人经与本基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2023 年 4 月 28 日起调整本基金 A 类基金份额的销售服务费率，并相应修改基金合同等法律文件的相关条款。本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率由 0.25% 调整为 0.01%。具体可查阅本基金管理人于 2023 年 4 月 28 日发布的《国泰基金管理有限公司关于国泰瞬利交易型货币市场基金调整 A 类基金份额的销售服务费率并修改基金合同等法律文件的公告》。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

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

基金托管人住所或办公场所。

### 12.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日