

泰康现金管家货币市场基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期为 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 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..... | 6 |
| § 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 其他指标..... | 14 |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况..... | 14 |
| § 4 管理人报告 | 16 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 16 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 17 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 17 |
| 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..... | 18 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 18 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 18 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 19 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 19 |
| 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..... | 19 |
| § 5 托管人报告 | 20 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 20 |
| 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.. | 20 |
| 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..... | 20 |
| § 6 审计报告 | 21 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 21 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 21 |
| § 7 年度财务报表 | 23 |
| 7.1 资产负债表..... | 23 |
| 7.2 利润表..... | 24 |
| 7.3 净资产变动表..... | 25 |
| 7.4 报表附注..... | 28 |
| § 8 投资组合报告 | 57 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 57 |

| | |
|--|-----------|
| 8.2 债券回购融资情况..... | 57 |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限..... | 57 |
| 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明..... | 58 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 58 |
| 8.6 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..... | 59 |
| 8.7 “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..... | 59 |
| 8.8 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细..... | 59 |
| 8.9 投资组合报告附注..... | 60 |
| § 9 基金份额持有人信息..... | 62 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 62 |
| 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况..... | 62 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 62 |
| 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况..... | 63 |
| § 10 开放式基金份额变动..... | 64 |
| § 11 重大事件揭示..... | 65 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议..... | 65 |
| 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..... | 65 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 65 |
| 11.4 基金投资策略的改变..... | 65 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 65 |
| 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..... | 65 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 65 |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况..... | 67 |
| 11.9 其他重大事件..... | 67 |
| § 12 影响投资者决策的其他重要信息..... | 71 |
| 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..... | 71 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 71 |
| § 13 备查文件目录..... | 72 |
| 13.1 备查文件目录..... | 72 |
| 13.2 存放地点..... | 72 |
| 13.3 查阅方式..... | 72 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | | | |
|-----------------|--------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 基金名称 | 泰康现金管家货币市场基金 | | | |
| 基金简称 | 泰康现金管家货币 | | | |
| 基金主代码 | 004861 | | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | | |
| 基金合同生效日 | 2017年9月8日 | | | |
| 基金管理人 | 泰康基金管理有限公司 | | | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | | | |
| 报告期末基金份额总额 | 10,521,201,070.82份 | | | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 泰康现金管家货币A | 泰康现金管家货币B | 泰康现金管家货币C | 泰康现金管家货币D |
| 下属分级基金的交易代码 | 004861 | 004862 | 004863 | 004864 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 119,137,417.76份 | 1,556,298,673.31份 | 4,386,242,637.53份 | 4,459,522,342.22份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在综合考虑基金资产安全性、收益性和流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资人创造稳定的收益。 |
| 投资策略 | <p>本基金在分析各类资产的信用风险、流动性风险及其经风险调整后的收益率水平或盈利能力的基础上，通过比较或合理预期各类资产的风险与收益率变化，确定并动态地调整优先配置的资产类别和配置比例。</p> <p>本基金在对国内外宏观经济形势研究基础上，对利率期限结构和债券市场变化趋势进行深入分析和预测，确定并动态调整利率品种的期限配置策略。本基金综合分析经济基本面、政策面、资金面以及收益水平和流动性风险通过在行业和个券方面进行分散化投资，同时规避高信用风险行业和主体的前提下，适度提高组合收益并控制投资风险。</p> <p>本基金在严格遵守杠杆比例的前提下，通过对流动性状况深入分析，综合比较回购利率与短期债券收益率、存款利率，判断是否存在利差套利空间，进而确定是否进行杠杆操作。</p> <p>本基金将综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例，通过现金留存、银行定期存款提前支取、持有高流动性券种、正回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性，以满足日常的基金资产变现需求。</p> |
| 业绩比较基准 | 人民币七天通知存款利率（税后）。 |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。 |

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 | | 泰康基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 陈玮光 | 郭明 |
| | 联系电话 | 010-89620366 | (010) 66105799 |
| | 电子邮箱 | tkfchenwg06@tkfunds.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4001895522 | 95588 |
| 传真 | | 010-89620100 | (010) 66105798 |
| 注册地址 | | 北京市西城区复兴门内大街 156 号 3 层 1-10 内 302 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址 | | 北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 3、5 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | | 100033 | 100140 |
| 法定代表人 | | 金志刚 | 陈四清 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|--------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.tkfunds.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人办公地、基金托管人的住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------------------|--------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙) | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼 |
| 注册登记机构 | 泰康基金管理有限公司 | 北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 3、5 层 |

§ 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 | 2023 年 | | | | 2022 年 | | | | 2021 年 | | | |
|--------------------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|------------------------|------------------------|------------------------|--------------------------|-----------------------|-----------------------|------------------------|--------------------|
| | 泰康现 金管家 货币 A | 泰康现 金管家 货币 B | 泰康现 金管家 货币 C | 泰康现 金管家 货币 D | 泰康现 金管家 货币 A | 泰康现 金管家 货币 B | 泰康现 金管家 货币 C | 泰康现 金管家 货币 D | 泰康现 金管家 货币 A | 泰康现 金管家 货币 B | 泰康现 金管家 货币 C | 泰康现 金管家 货币 D |
| 本期已 实现收 益 | 2,989, 008.54 | 11,375 ,425.9 8 | 58,624 ,588.3 1 | 64,237 ,518.1 4 | 2,231, 391.67 | 1,710, 098.18 | 3,341, 382.19 | 6,115, 733.94 | 806,85 0.02 | 1,836, 889.80 | 3,148, 198.80 | |
| 本期利 润 | 2,989, 008.54 | 11,375 ,425.9 8 | 58,624 ,588.3 1 | 64,237 ,518.1 4 | 2,231, 391.67 | 1,710, 098.18 | 3,341, 382.19 | 6,115, 733.94 | 806,85 0.02 | 1,836, 889.80 | 3,148, 198.80 | |
| 本期净 值收益 率 | 2.0309 % | 2.2764 % | 2.2764 % | 2.0314 % | 1.8487 % | 2.0930 % | 2.0930 % | 1.3277 % | 2.1025 % | 2.3472 % | 2.3472 % | |
| 3.1.2 期末数 据和指 标 | 2023 年末 | | | | 2022 年末 | | | | 2021 年末 | | | |
| 期末基 金资产 净值 | 119,13 7,417. 76 | 1,556, 298,67 3.31 | 4,386, 242,63 7.53 | 4,459, 522,34 2.22 | 186,13 0,091. 82 | 757,98 6,791. 39 | 641,20 1,034. 02 | 2,567, 003,26 6.15 | 88,669 ,118.3 9 | 50,240 ,227.9 2 | 120,69 5,479. 68 | |
| 期末基 金份额 净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | |
| 3.1.3 累计期 末指标 | 2023 年末 | | | | 2022 年末 | | | | 2021 年末 | | | |
| 累计净 值收益 率 | 16.294 6% | 18.069 3% | 18.069 5% | 3.3861 % | 13.979 8% | 15.441 5% | 15.441 6% | 1.3277 % | 11.910 9% | 13.074 8% | 13.074 9% | |

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

（2）本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。

（3）本基金收益分配是按日结转份额。

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

泰康现金管家货币 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.4927% | 0.0017% | 0.3403% | 0.0000% | 0.1524% | 0.0017% |
| 过去六个月 | 0.9688% | 0.0018% | 0.6805% | 0.0000% | 0.2883% | 0.0018% |
| 过去一年 | 2.0309% | 0.0018% | 1.3500% | 0.0000% | 0.6809% | 0.0018% |
| 过去三年 | 6.1020% | 0.0040% | 4.0500% | 0.0000% | 2.0520% | 0.0040% |
| 过去五年 | 10.9026% | 0.0034% | 6.7537% | 0.0000% | 4.1489% | 0.0034% |
| 自基金合同生效起至今 | 16.2946% | 0.0038% | 8.5290% | 0.0000% | 7.7656% | 0.0038% |

泰康现金管家货币 B

| 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 |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.5536% | 0.0017% | 0.3403% | 0.0000% | 0.2133% | 0.0017% |

| | | | | | | |
|------------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 过去六个月 | 1.0912% | 0.0018% | 0.6805% | 0.0000% | 0.4107% | 0.0018% |
| 过去一年 | 2.2764% | 0.0018% | 1.3500% | 0.0000% | 0.9264% | 0.0018% |
| 过去三年 | 6.8679% | 0.0040% | 4.0500% | 0.0000% | 2.8179% | 0.0040% |
| 过去五年 | 12.2412% | 0.0034% | 6.7537% | 0.0000% | 5.4875% | 0.0034% |
| 自基金合同生效起至今 | 18.0693% | 0.0038% | 8.5290% | 0.0000% | 9.5403% | 0.0038% |

泰康现金管家货币 C

| 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 |
|------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.5536% | 0.0017% | 0.3403% | 0.0000% | 0.2133% | 0.0017% |
| 过去六个月 | 1.0912% | 0.0018% | 0.6805% | 0.0000% | 0.4107% | 0.0018% |
| 过去一年 | 2.2764% | 0.0018% | 1.3500% | 0.0000% | 0.9264% | 0.0018% |
| 过去三年 | 6.8680% | 0.0040% | 4.0500% | 0.0000% | 2.8180% | 0.0040% |
| 过去五年 | 12.2413% | 0.0034% | 6.7537% | 0.0000% | 5.4876% | 0.0034% |
| 自基金合同生效起至今 | 18.0695% | 0.0038% | 8.5290% | 0.0000% | 9.5405% | 0.0038% |

泰康现金管家货币 D

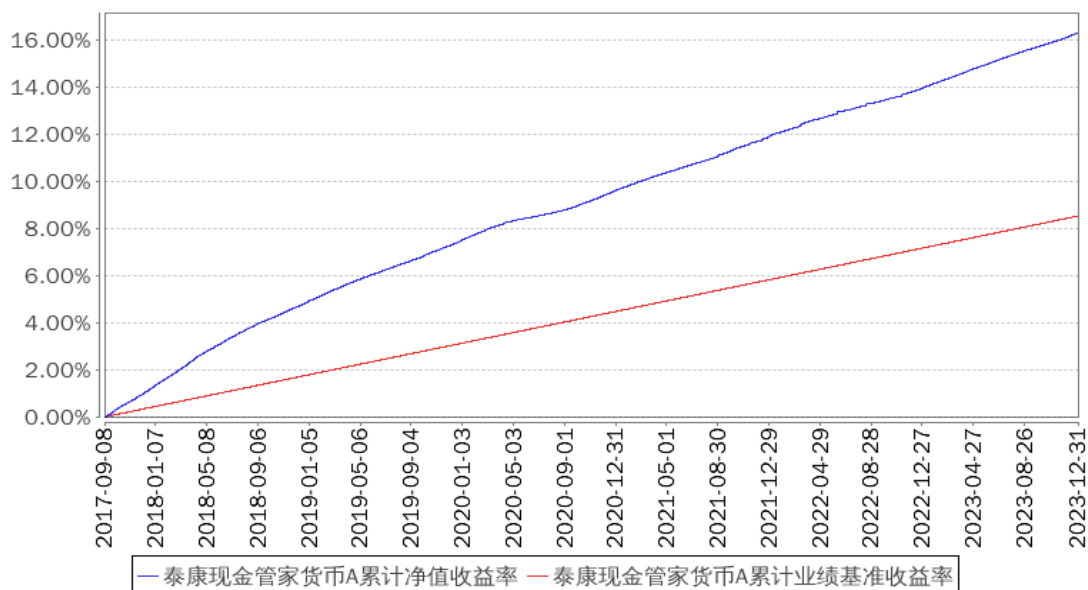
| 阶段 | 份额净值收益 | 份额净值 收益率标 | 业绩比较 基准收益 | 业绩比较基准 收益率标准 差 | ①—③ | ②—④ |
|----|--------|--------------|--------------|----------------------|-----|-----|
|----|--------|--------------|--------------|----------------------|-----|-----|

| | 率① | 准差② | 率③ | ④ | | |
|------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.4929% | 0.0017% | 0.3403% | 0.0000% | 0.1526% | 0.0017% |
| 过去六个月 | 0.9691% | 0.0018% | 0.6805% | 0.0000% | 0.2886% | 0.0018% |
| 过去一年 | 2.0314% | 0.0018% | 1.3500% | 0.0000% | 0.6814% | 0.0018% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.3861% | 0.0041% | 2.3930% | 0.0000% | 0.9931% | 0.0041% |

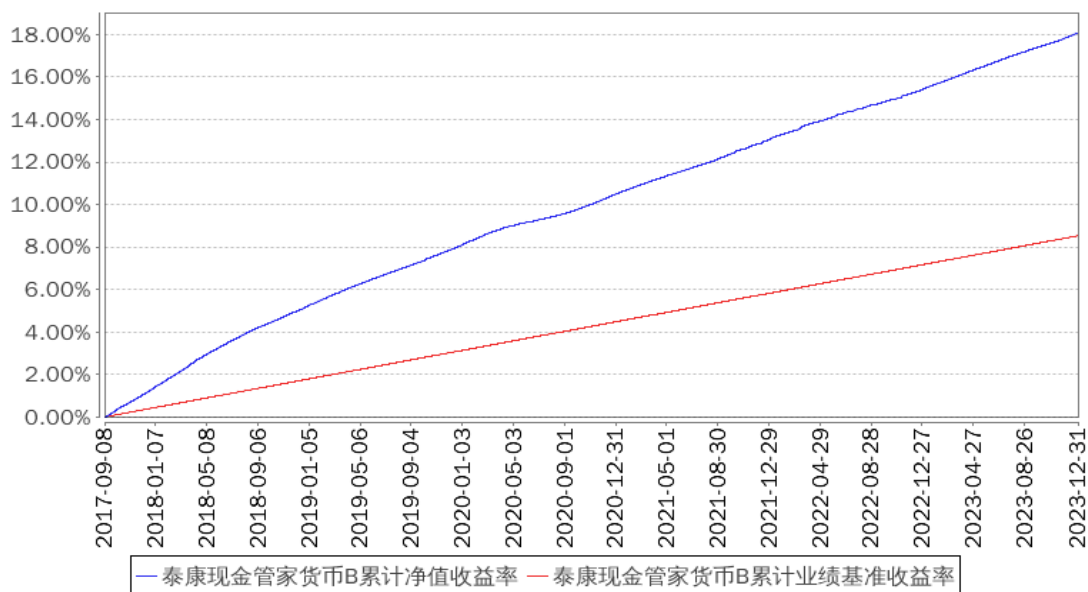
注：泰康现金管家货币 A、泰康现金管家货币 B、泰康现金管家货币 C、泰康现金管家货币 D 收益分配均按日结转份额。

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

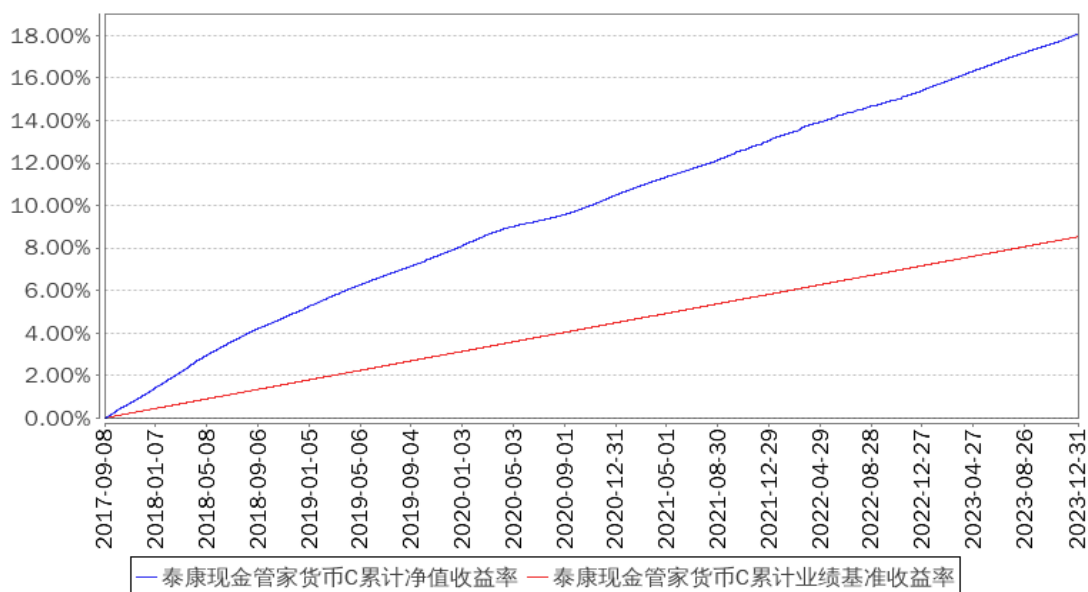
泰康现金管家货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



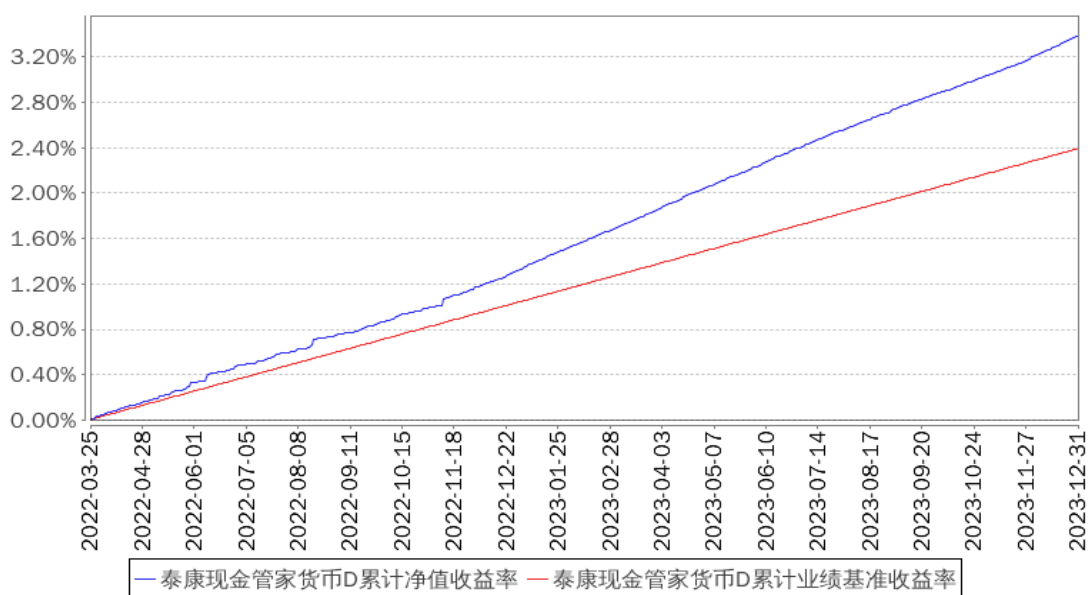
泰康现金管家货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



泰康现金管家货币C累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



泰康现金管家货币D累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

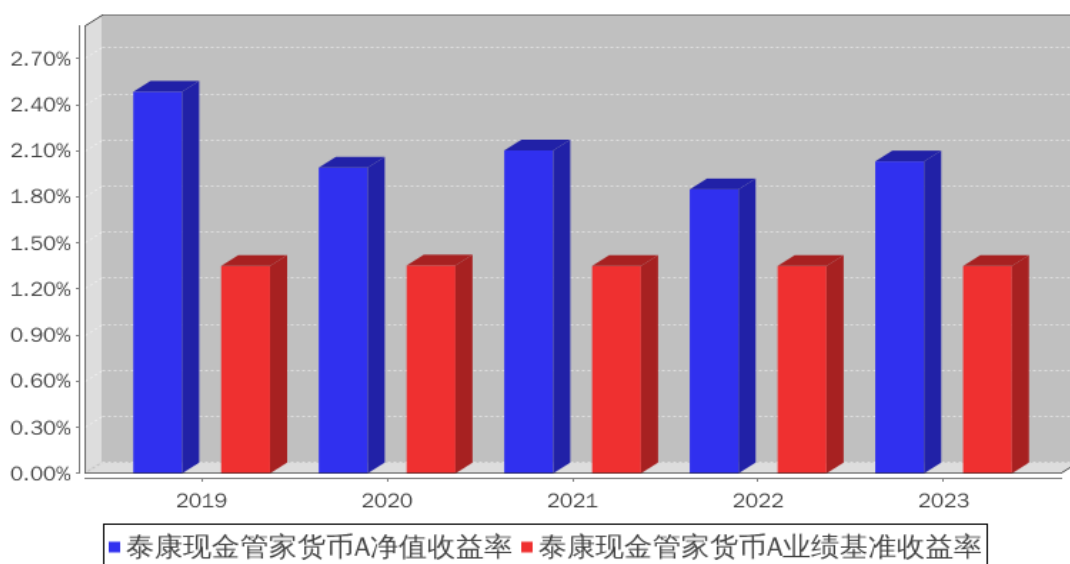


注：1、本基金基金合同于 2017 年 09 月 08 日生效。

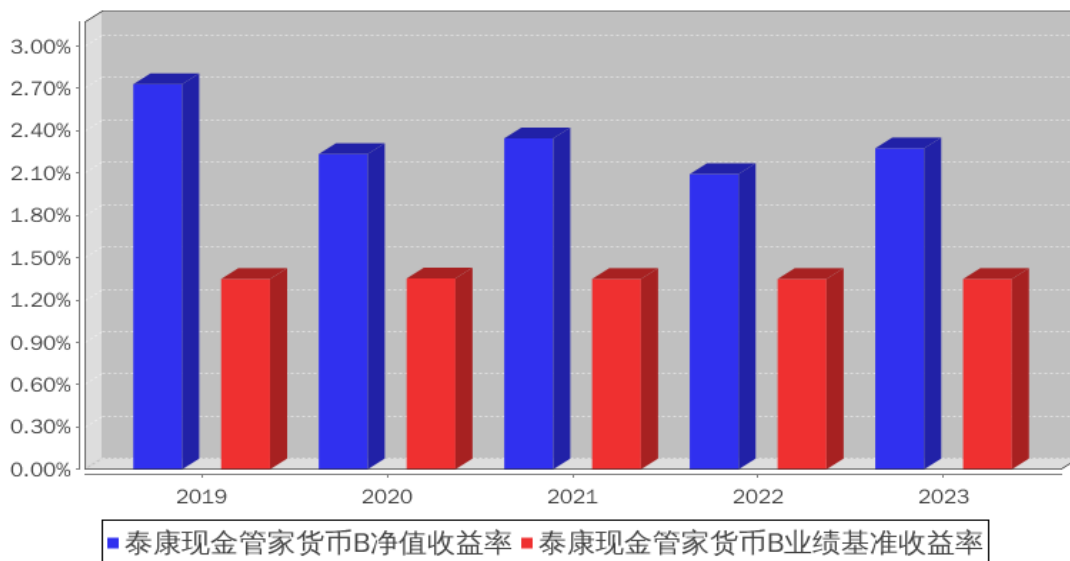
2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

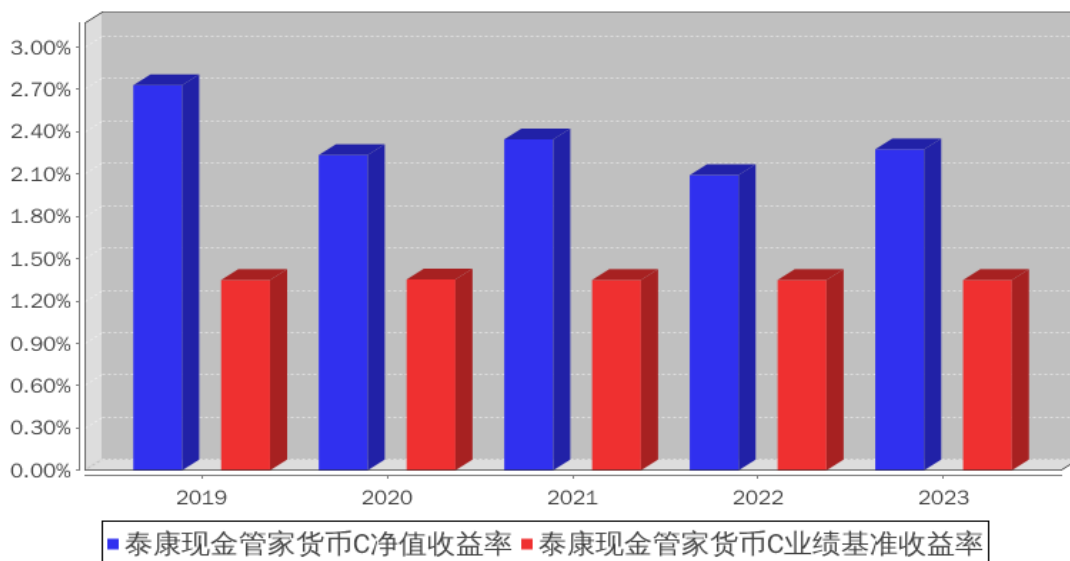
泰康现金管家货币A基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



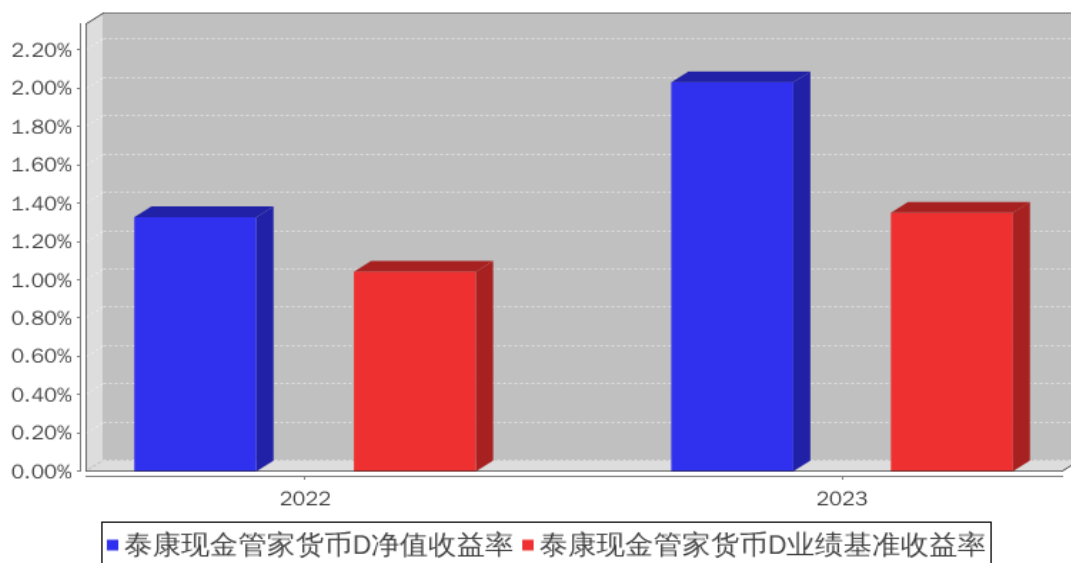
泰康现金管家货币B基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



泰康现金管家货币C基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



泰康现金管家货币D基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

泰康现金管家货币 A

| 年度 | 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 | 年度利润 分配合计 | 备注 |
|--------|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 2023 年 | 2,993,622.37 | - | -4,613.83 | 2,989,008.54 | - |
| 2022 年 | 2,224,390.76 | - | 7,000.91 | 2,231,391.67 | - |
| 2021 年 | 803,667.81 | - | 3,182.21 | 806,850.02 | - |
| 合计 | 6,021,680.94 | - | 5,569.29 | 6,027,250.23 | - |

泰康现金管家货币 B

| 年度 | 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 | 年度利润 分配合计 | 备注 |
|--------|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 2023 年 | 11,325,646.16 | - | 49,779.82 | 11,375,425.98 | - |
| 2022 年 | 1,660,600.58 | - | 49,497.60 | 1,710,098.18 | - |
| 2021 年 | 1,843,198.58 | - | -6,308.78 | 1,836,889.80 | - |
| 合计 | 14,829,445.32 | - | 92,968.64 | 14,922,413.96 | - |

泰康现金管家货币 C

| 年度 | 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 | 年度利润 分配合计 | 备注 |
|--------|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 2023 年 | 58,380,827.23 | - | 243,761.08 | 58,624,588.31 | - |
| 2022 年 | 3,304,110.01 | - | 37,272.18 | 3,341,382.19 | - |
| 2021 年 | 3,165,038.40 | - | -16,839.60 | 3,148,198.80 | - |

| | | | | | |
|----|---------------|---|------------|---------------|---|
| 合计 | 64,849,975.64 | - | 264,193.66 | 65,114,169.30 | - |
|----|---------------|---|------------|---------------|---|

泰康现金管家货币 D

| 年度 | 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 | 年度利润 分配合计 | 备注 |
|--------|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 2023 年 | 64,134,654.77 | - | 102,863.37 | 64,237,518.14 | - |
| 2022 年 | 5,954,971.65 | - | 160,762.29 | 6,115,733.94 | - |
| 合计 | 70,089,626.42 | - | 263,625.66 | 70,353,252.08 | - |

§ 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

泰康基金管理有限公司（以下简称“泰康基金”）前身为泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）公募事业部，2015年4月，泰康资产公募基金管理业务资格正式获得监管机构批准，成为首家获得该业务资格的保险资产管理公司。2021年9月1日，泰康资产获得证监会批准设立子公司泰康基金，2021年10月12日，泰康基金完成工商注册。2022年11月18日，泰康资产旗下公募基金产品的基金管理人变更为泰康基金。

泰康基金注册地为北京，注册资本为1.2亿元人民币。截至2023年12月31日，泰康基金共管理77只证券投资基金，已形成包括货币、债券、偏债混合、偏股混合、主动权益、沪港深系列、主动量化及被动指数、FOF基金等不同类型、不同风险收益特征的产品系列，并在养老目标基金、宽基及细分行业主题ETF、双碳、科技、大健康等方面均进行了战略布局，为广大投资者提供了丰富多元的投资选择。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 任慧娟 | 本基金基金经理 | 2017年9月8日 | - | 17年 | 任慧娟于2015年8月加入泰康公募，现任泰康基金固定收益基金经理。曾任阳光财产保险公司资产管理中心固定收益投资部高级投资经理。2015年12月9日至2022年10月26日担任泰康薪意保货币市场基金基金经理。2016年5月9日至今担任泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年7月13日至今担任泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年8月24日至今担任泰康丰盈债券型证券投资基金基金经理。2016年12月21日至2019年5月8日担任泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017年9月8日至今担任泰康现金管家货币市场基金基金经理。2020年6月30日至今担任泰康申润一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2022年8月1日至今担任泰康丰盛纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2022年9月20 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 日至 2024 年 1 月 12 日担任泰康安泓纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2022 年 9 月 28 日至今担任泰康丰泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

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相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金管理人制定了公平交易制度和流程，并按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的相关规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源，保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。在投资管理活动中，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

本报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的

单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

宏观经济方面，2023 年是压力逐步呈现的一年，年初由于疫情放开有一定修复，但在此后房地产和消费等压力凸显。四季度通过增发特别国债等方式对冲了经济下行，但全年通胀偏低迷的情况延续。

债券市场方面，2023 年利率走出了“N”字型，利率在一季度窄幅震荡、二季度到 8 月份前后明显下行，与经济运行的节奏基本一致。9-11 月由于资金制约、特别国债增发等因素，利率出现一定调整，但 12 月的提前配置行情又重新带来利率下行。

报告期内，本基金以同业存单、存款、逆回购、短期融资券为主要配置资产，根据申购赎回情况、各品种各期限资产的市场收益率情况调整各类资产占比、平均剩余期限及杠杆水平，以便获得较高的收益。负债端严格管理，控制好机构客户占比及客户集中度，保持较为稳定的负债结构。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 份额净值增长率为 2.0309%；截至本报告期末本基金 B 份额净值增长率为 2.2764%；截至本报告期末本基金 C 份额净值增长率为 2.2764%；截至本报告期末本基金 D 份额净值增长率为 2.0314%；同期业绩比较基准增长率为 1.3500%。

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 2024 年，宏观经济实际增速可能震荡筑底，力保 GDP 目标实现，但名义 GDP 的压力或将持续较大，改善通胀预期和微观主体盈利的挑战较大。居民部门面临着资产负债表需要修复的约束，房地产和消费信心都需要提振。政策在 2024 年将继续扮演较为关键的角色。

对于 2024 年债券市场，预计利率震荡下行的趋势没有改变。基本面和风险偏好对长端利率形成支撑；短端则关键看资金面的制约能否打开，随着中美货币政策周期从收敛走向同步，我们预计资金的制约有望逐步缓解。机构的负债成本在历史上对利率的下限形成约束，不过未来负债成本的引导下行也是大势所趋。

我们将紧密跟踪经济和市场的动态变化，力争把握机会、规避风险，为基金持有人取得较好回报。负债端持续严格管理，创造稳定的负债结构。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：

本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，定期与不定期地对基金的投资、交易、产品、市场销售、信息技术等方面进行事前、事中或事后的监督检查。

同时，公司在产品开发、销售募集、投资交易、运营管理等业务环节，进行事前合规性审核，以有效防范业务风险；公司通过投资交易系统控制和人工审核控制相结合的方式，对基金投资交易情况进行监督，以确保基金投资满足监管法规、基金合同和公司制度的规定；公司设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；公司监察稽核人员日常对基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并定期向风险控制委员会报告。

4.7 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，设有估值小组，并制定了相关制度及流程。估值小组设成员若干名，成员由各相关部门选派，包括运营管理部、风险控制部、各投资部门（包括固定收益投资部、权益投资部、量化投资部、FOF 及多资产配置部）、监察稽核部等。估值小组成员具有一定的工作经验及专业胜任能力。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间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。

与估值相关的机构包括上海、深圳、北京证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国基金业协会等。

本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管人复核确认。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，根据相关法律法规和基金合同要求以及实际运作情况，本基金 A 级应分配且已分配利润 2,989,008.54 元，B 级应分配且已分配利润 11,375,425.98 元，本基金 C 级应分配且已分配利润 58,624,588.31 元，本基金 D 级应分配且已分配利润 64,237,518.14 元；本基金本报告期末无应分配而尚未分配利润的情况。

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

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对泰康现金管家货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——泰康基金管理有限公司在泰康现金管家货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对泰康基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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 | 普华永道中天审字(2024)第 25527 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 | 泰康现金管家货币市场基金全体基金份额持有人： |
| 审计意见 | <p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了泰康现金管家货币市场基金(以下简称“泰康现金管家货币”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了泰康现金管家货币 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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。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> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于泰康现金管家货币,并履行了职业道德方面的其他责任。</p> |
| 强调事项 | 无。 |
| 其他事项 | 无。 |
| 其他信息 | 无。 |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>泰康现金管家货币的基金管理人泰康基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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,基金管理人管理层负责评估泰康现金管家货币的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算泰康现金管家货币、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督泰康现金管家货币的财务报告过程。</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>(一)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>(二)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>(三)评价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>(四)对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,就可能对泰康现金管家货币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泰康现金管家货币不能持续经营。</p> <p>(五)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 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) |
| 注册会计师的姓名 | 赵钰 陈玉珊 |
| 会计师事务所的地址 | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼 |
| 审计报告日期 | 2024 年 03 月 27 日 |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰康现金管家货币市场基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 7.4.7.1 | 5,960,846,914.23 | 1,601,666,789.62 |
| 结算备付金 | | 6,663,624.08 | 608,415.29 |
| 存出保证金 | | - | 1,621.12 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 4,266,496,180.46 | 1,861,902,618.69 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 4,266,496,180.46 | 1,861,902,618.69 |
| 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 | 1,230,092,987.06 | 1,159,702,557.57 |
| 债权投资 | 7.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 7.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 7.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 26,123,497.91 | 69,302,164.61 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 11,490,223,203.74 | 4,693,184,166.90 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 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 | | 965,367,909.90 | 529,101,099.16 |
| 应付清算款 | | - | 10,110,288.08 |
| 应付赎回款 | | 10,000.00 | 13,979.03 |

| | | | |
|-------------|----------|-------------------|------------------|
| 应付管理人报酬 | | 1,208,558.83 | 443,963.27 |
| 应付托管费 | | 483,423.52 | 177,585.29 |
| 应付销售服务费 | | 1,022,879.90 | 604,942.82 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 21,271.47 | 4,399.53 |
| 应付利润 | | 661,035.11 | 269,244.67 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.9 | 247,054.19 | 137,481.67 |
| 负债合计 | | 969,022,132.92 | 540,862,983.52 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.10 | 10,521,201,070.82 | 4,152,321,183.38 |
| 其他综合收益 | 7.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 7.4.7.12 | - | - |
| 净资产合计 | | 10,521,201,070.82 | 4,152,321,183.38 |
| 负债和净资产总计 | | 11,490,223,203.74 | 4,693,184,166.90 |

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 10,521,201,070.82 份，其中泰康现金管家货币 A 基金份额净值 1.0000 元，份额总额 119,137,417.76 份；泰康现金管家货币 B 基金份额净值 1.0000 元，份额总额 1,556,298,673.31 份；泰康现金管家货币 C 基金份额净值 1.0000 元，份额总额 4,386,242,637.53 份；泰康现金管家货币 D 基金份额净值 1.0000 元，份额总额 4,459,522,342.22 份。

7.2 利润表

会计主体：泰康现金管家货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|----------|---|--|
| 一、营业总收入 | | 175,254,105.45 | 17,276,043.86 |
| 1. 利息收入 | | 92,742,480.87 | 7,871,427.82 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.13 | 67,805,615.86 | 3,305,294.25 |
| 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 | | 24,936,865.01 | 4,566,133.57 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以 “-”填列） | | 82,509,162.08 | 9,402,796.04 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.14 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |

| | | | |
|---------------------------------|------------|----------------|---------------|
| 债券投资收益 | 7.4.7.15 | 82,509,162.08 | 9,402,796.04 |
| 资产支持证券投资 投资收益 | 7.4.7.16 | - | - |
| 贵金属投资收 益 | 7.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 7.4.7.19 | - | - |
| 以摊余成本计 量的金融资产终止确 认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填 列) | 7.4.7.20 | - | - |
| 4. 汇兑收益(损失以 “-”号填列) | | - | - |
| 5. 其他收入(损失以 “-”号填列) | 7.4.7.21 | 2,462.50 | 1,820.00 |
| 减：二、营业总支出 | | 38,027,564.48 | 3,877,437.88 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 9,742,367.15 | 1,015,569.67 |
| 其中：暂估管理人报 酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 3,896,946.83 | 406,227.74 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 8,669,954.38 | 1,126,033.05 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 15,276,469.86 | 1,049,581.20 |
| 其中：卖出回购金融 资产支出 | | 15,276,469.86 | 1,049,581.20 |
| 6. 信用减值损失 | 7.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 85,482.76 | 3,803.67 |
| 8. 其他费用 | 7.4.7.23 | 356,343.50 | 276,222.55 |
| 三、利润总额(亏损 总额以“-”号填列) | | 137,226,540.97 | 13,398,605.98 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损 以“-”号填列) | | 137,226,540.97 | 13,398,605.98 |
| 五、其他综合收益的 税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 137,226,540.97 | 13,398,605.98 |

7.3 净资产变动表

会计主体：泰康现金管家货币市场基金

本报告期：2023年1月1日至2023年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | | | |
|--|--|--------|---------------------|----------------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 4,152,321,183. 38 | - | - | 4,152,321,183.3 8 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 4,152,321,183. 38 | - | - | 4,152,321,183.3 8 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 6,368,879,887. 44 | - | - | 6,368,879,887.4 4 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 137,226,540.97 | 137,226,540.97 |
| (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) | 6,368,879,887. 44 | - | - | 6,368,879,887.4 4 |
| 其中：1. 基金申购款 | 39,174,022,920 .13 | - | - | 39,174,022,920. 13 |
| 2. 基金赎回款 | - 32,805,143,032 .69 | - | - | - 32,805,143,032. 69 |
| (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) | - | - | - 137,226,540.97 | - -137,226,540.97 |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 10,521,201,070 .82 | - | - | 10,521,201,070. 82 |

| 项目 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | | | |
|--|---|--------|----------------|-------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 259,604,825.99 | - | - | 259,604,825.99 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 259,604,825.99 | - | - | 259,604,825.99 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 3,892,716,357.39 | - | - | 3,892,716,357.39 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 13,398,605.98 | 13,398,605.98 |
| (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) | 3,892,716,357.39 | - | - | 3,892,716,357.39 |
| 其中：1. 基金申购款 | 10,643,020,252.89 | - | - | 10,643,020,252.89 |
| 2. 基金赎回款 | -6,750,303,895.50 | - | - | -6,750,303,895.50 |
| (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) | - | - | -13,398,605.98 | -13,398,605.98 |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 4,152,321,183.38 | - | - | 4,152,321,183.38 |

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：

| | | |
|------------|------------|------------|
| <u>金志刚</u> | <u>金志刚</u> | <u>李俊佑</u> |
| 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

泰康现金管家货币市场基金(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[2017]877号《关于准予泰康现金管家货币市场基金注册的批复》核准,由泰康资产管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康现金管家货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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1,057,459,261.81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314号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康现金管家货币市场基金基金合同》于2017年9月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,057,518,704.38份基金份额,其中认购资金利息折合59,442.57份基金份额。本基金的基金管理人为泰康基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司银行(以下简称“工商银行”)。

根据《泰康现金管家货币市场基金招募说明书》,本基金根据投资人认/申购本基金的金额,对投资人持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,因此形成不同的基金份额类别,即A类基金份额、B类基金份额、C类基金份额、D类基金份额。本基金A类、B类、C类、D类基金份额分别设置代码,并分别公布每万份基金已实现收益和7日年化收益率。在基金存续期内,若A类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过300万份时,本基金的登记机构自动将其在该基金账户持有的A类基金份额升级为B类基金份额;若B类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于300万份时,本基金的登记机构自动将其在该基金账户持有的B类基金份额降级为A类基金份额。C、D类份额不进行基金份额的升降级。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康现金管家货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他货币市场工具的,在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的前提下,本基金可参与其他货币市场工具的投资,不须召开份额持有人大会。其投资比例遵循届时有效法律法规或监管机构的相关规定执行。

本基金的业绩比较基准为：人民币七天通知存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的管理人泰康基金管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 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》、《泰康现金管家货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 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。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：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其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。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其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的金融资产主要为债务工具，是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债在初始确认时，以公允价值计量。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券投资起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资或资产支持证券投资的账面价值中。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率每日计提应计利息，同时在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处

于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 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；或者(3) 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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(1) 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。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 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。

(3) 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。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的; 且 2) 交易双方准备按净额结算时, 金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

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。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少, 以及因类别调整而引起的 A、B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征: (1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利, 这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产; 这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位, 并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量; (2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别, 即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具, 且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权; (3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别), 所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征, 并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同); (4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外, 该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征; (5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额, 应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具, 是指根据合同约定, 持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利, 或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时, 自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同: (1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何

影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

以摊余成本计量的金融资产在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.9 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止。本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益。本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若当日净收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额；若当日净收益为负值，则缩减投资人基金份额；若当日净收益为零，则保持投资人基金份额不变。当日申购的基金份额自下一个交易日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个交易日起，不享有基金的收益分配权益。法律法规或监管机构另有规定的从其规定。在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在法律法规允许的前提下调整基金收益的分配原则和支付方式，不须召开基金份额持有人大会审议，但应于变更实施日前在指定媒介公告。

7.4.4.11 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

确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在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）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，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》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起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。

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 2023年12月31日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款 | 530,151.32 | 1,074,435.96 |
| 等于：本金 | 480,947.55 | 1,074,344.04 |
| 加：应计利息 | 49,203.77 | 91.92 |
| 减：坏账准备 | - | - |
| 定期存款 | 5,960,316,762.91 | 1,600,592,353.66 |
| 等于：本金 | 5,930,000,000.00 | 1,598,000,000.00 |
| 加：应计利息 | 30,316,762.91 | 2,592,353.66 |
| 减：坏账准备 | - | - |
| 其中：存款期限1个月以内 | - | - |
| 存款期限1-3个月 | 300,172,777.76 | 500,359,861.06 |
| 存款期限3个月以上 | 5,660,143,985.15 | 1,100,232,492.60 |
| 其他存款 | - | - |
| 等于：本金 | - | - |
| 加：应计利息 | - | - |
| 减：坏账准备 | - | - |

| | | |
|----|------------------|------------------|
| 合计 | 5,960,846,914.23 | 1,601,666,789.62 |
|----|------------------|------------------|

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2023年12月31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 | 52,239,373.31 | 51,906,020.83 | -333,352.48 | - 0.0032 |
| | 银行间市场 | 4,214,256,807.15 | 4,218,003,706.81 | 3,746,899.66 | 0.0356 |
| | 合计 | 4,266,496,180.46 | 4,269,909,727.64 | 3,413,547.18 | 0.0324 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 4,266,496,180.46 | 4,269,909,727.64 | 3,413,547.18 | 0.0324 |
| 项目 | | 上年度末 2022年12月31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 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | 1,861,902,618.69 | 1,863,229,861.37 | 1,327,242.68 | 0.0320 |
| | 合计 | 1,861,902,618.69 | 1,863,229,861.37 | 1,327,242.68 | 0.0320 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 1,861,902,618.69 | 1,863,229,861.37 | 1,327,242.68 | 0.0320 |

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年12月31日 |
|----|--------------------|
|----|--------------------|

| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
|-------|--------------------------|-----------|
| 交易所市场 | 257,271,072.74 | - |
| 银行间市场 | 972,821,914.32 | - |
| 合计 | 1,230,092,987.06 | - |
| 项目 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | |
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 171,032,397.62 | - |
| 银行间市场 | 988,670,159.95 | - |
| 合计 | 1,159,702,557.57 | - |

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - | - |
| 应付赎回费 | - | 20.97 |
| 应付证券出借违约金 | - | - |
| 应付交易费用 | 148,054.19 | 88,460.70 |
| 其中：交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 148,054.19 | 88,460.70 |
| 应付利息 | - | - |
| 预提费用 | 99,000.00 | 49,000.00 |
| 合计 | 247,054.19 | 137,481.67 |

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

泰康现金管家货币 A

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | |
|---------------|--|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 186,130,091.82 | 186,130,091.82 |
| 本期申购 | 203,067,526.60 | 203,067,526.60 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -270,060,200.66 | -270,060,200.66 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 119,137,417.76 | 119,137,417.76 |

泰康现金管家货币 B

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | |
|---------------|--|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 757,986,791.39 | 757,986,791.39 |
| 本期申购 | 3,129,541,266.69 | 3,129,541,266.69 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,331,229,384.77 | -2,331,229,384.77 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 1,556,298,673.31 | 1,556,298,673.31 |

泰康现金管家货币 C

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | |
|------|--|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 641,201,034.02 | 641,201,034.02 |
| 本期申购 | 15,295,723,102.68 | 15,295,723,102.68 |

| | | |
|---------------|--------------------|--------------------|
| 本期赎回(以“-”号填列) | -11,550,681,499.17 | -11,550,681,499.17 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 4,386,242,637.53 | 4,386,242,637.53 |

泰康现金管家货币 D

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12月31日 | |
|---------------|-----------------------------|--------------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 2,567,003,266.15 | 2,567,003,266.15 |
| 本期申购 | 20,545,691,024.16 | 20,545,691,024.16 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -18,653,171,948.09 | -18,653,171,948.09 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 4,459,522,342.22 | 4,459,522,342.22 |

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

泰康现金管家货币 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 上年度末 | - | - | - |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 2,989,008.54 | - | 2,989,008.54 |
| 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 | -2,989,008.54 | - | -2,989,008.54 |
| 本期末 | - | - | - |

泰康现金管家货币 B

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------|-------|-------|---------|
| 上年度末 | - | - | - |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |

| | | | |
|----------------|----------------|---|----------------|
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 11,375,425.98 | - | 11,375,425.98 |
| 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 | -11,375,425.98 | - | -11,375,425.98 |
| 本期末 | - | - | - |

泰康现金管家货币 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|-------|----------------|
| 上年度末 | - | - | - |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 58,624,588.31 | - | 58,624,588.31 |
| 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 | -58,624,588.31 | - | -58,624,588.31 |
| 本期末 | - | - | - |

泰康现金管家货币 D

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|-------|----------------|
| 上年度末 | - | - | - |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 64,237,518.14 | - | 64,237,518.14 |
| 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 | -64,237,518.14 | - | -64,237,518.14 |
| 本期末 | - | - | - |

7.4.7.13 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12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|----|-----------------------------|----------------------------------|
| | | |

| | | |
|-----------|---------------|--------------|
| 活期存款利息收入 | 54,634.05 | 13,456.90 |
| 定期存款利息收入 | 67,646,693.99 | 3,277,903.93 |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 104,267.37 | 13,893.09 |
| 其他 | 20.45 | 40.33 |
| 合计 | 67,805,615.86 | 3,305,294.25 |

7.4.7.14 股票投资收益

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 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12月31 日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日 |
|------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 66,825,734.18 | 7,597,103.94 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 15,683,427.90 | 1,805,692.10 |
| 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 | 82,509,162.08 | 9,402,796.04 |

7.4.7.15.2 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12月31 日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日 |
|------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 23,787,661,411.32 | 4,956,194,205.56 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 23,665,126,536.74 | 4,935,277,797.48 |
| 减：应计利息总额 | 106,851,446.68 | 19,110,715.98 |
| 减：交易费用 | - | - |
| 买卖债券差价收入 | 15,683,427.90 | 1,805,692.10 |

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

无。

7.4.7.20 公允价值变动收益

无。

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | - | - |
| 其他 | 2,462.50 | 1,820.00 |
| 合计 | 2,462.50 | 1,820.00 |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中：申购费补差收取具体情况，视每次转换时的两只基金的费率差异情况而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 审计费用 | 90,000.00 | 40,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 银行费用 | 108,493.70 | 57,022.55 |
| 其他 | 1,849.80 | 23,200.00 |
| 账户维护费 | 36,000.00 | 36,000.00 |
| 合计 | 356,343.50 | 276,222.55 |

7.4.7.24 分部报告

无。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|---------------------|
| 泰康基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”） | 基金托管人 |

| | |
|--------------------|---------------|
| 泰康保险集团股份有限公司 | 基金管理人的最终控股母公司 |
| 泰康资产管理有限责任公司 | 基金管理人控股股东 |
| 嘉兴昱泰资产管理合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 嘉兴舜泰资产管理合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 嘉兴祺泰资产管理合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 嘉兴崇泰资产管理合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 嘉兴宸泰资产管理合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |

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

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 2023年1月1日至2023年 12月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日 |
|------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 9,742,367.15 | 1,015,569.67 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 3,589,267.23 | 376,108.27 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 6,153,099.92 | 639,461.40 |

注：支付基金管理人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 × 0.15% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------------------|----------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,896,946.83 | 406,227.74 |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.06% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.06\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 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 12 月 31 日 | | | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | | |
| | 泰康现金管家货币 A | 泰康现金管家货币 B | 泰康现金管家货币 C | 泰康现金管家货币 D | 合计 |
| 泰康基金管理有限公司 | 36,364.60 | 26,298.23 | 115,867.07 | - | 178,529.90 |
| 合计 | 36,364.60 | 26,298.23 | 115,867.07 | - | 178,529.90 |
| 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 12 月 31 日 | | | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | | |
| | 泰康现金管家货币 A | 泰康现金管家货币 B | 泰康现金管家货币 C | 泰康现金管家货币 D | 合计 |
| 泰康基金管理有限公司 | 3,431.72 | 262.99 | 2,377.77 | - | 6,072.48 |
| 泰康资产管理有限责任公司 | 20,385.08 | 833.49 | 10,140.48 | - | 31,359.05 |
| 合计 | 23,816.80 | 1,096.48 | 12,518.25 | - | 37,431.53 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额、B 类基金份额、C 类基金份额和 D 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25%、0.01%、0.01% 和 0.25%。销售服务费的计算公式为：

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

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

单位：人民币元

| 本期 |
|----------------------------------|
| 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |

| 银行间市场交易的 各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
|---|--------------------|------|-------|------|-------|------|
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 工商银行 | 100,175,60 1.09 | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的 各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| | - | - | - | - | - | - |

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自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 |
| 工商银行 | 530,151.32 | 54,634.05 | 1,074,435.96 | 13,456.90 |

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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

单位：人民币元

| 泰康现金管家货币 A | | | | |
|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 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 |
| 2,993,622.37 | - | -4,613.83 | 2,989,008.54 | - |
| 泰康现金管家货币 B | | | | |
| 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 |
| 11,325,646.16 | - | 49,779.82 | 11,375,425.98 | - |
| 泰康现金管家货币 C | | | | |

| 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 |
|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 58,380,827.23 | - | 243,761.08 | 58,624,588.31 | - |
| 泰康现金管家货币 D | | | | |
| 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 |
| 64,134,654.77 | - | 102,863.37 | 64,237,518.14 | - |

7.4.12 期末（2023 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

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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 2023 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 964,267,395.78 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 |
|-----------|--------------------------|-------------------|--------|-----------|----------------|
| 092218003 | 22 农发清发 03 | 2024 年 1 月 2 日 | 101.19 | 436,000 | 44,120,521.17 |
| 112313190 | 23 浙商银行 CD190 | 2024 年 1 月 2 日 | 99.12 | 1,500,000 | 148,687,007.22 |
| 112313211 | 23 浙商银行 CD211 | 2024 年 1 月 2 日 | 98.77 | 1,000,000 | 98,769,803.50 |
| 112315232 | 23 民生银行 CD232 | 2024 年 1 月 2 日 | 98.93 | 327,000 | 32,350,371.67 |
| 112385575 | 23 深圳前海 微众银行 CD032 | 2024 年 1 月 2 日 | 99.68 | 1,000,000 | 99,683,674.54 |
| 112386927 | 23 徽商银行 CD141 | 2024 年 1 月 2 日 | 99.51 | 1,000,000 | 99,512,837.56 |
| 112394133 | 23 徽商银行 CD027 | 2024 年 1 月 2 日 | 99.54 | 300,000 | 29,861,529.74 |
| 210207 | 21 国开 07 | 2024 年 1 月 2 日 | 101.87 | 1,000,000 | 101,874,049.51 |
| 210406 | 21 农发 06 | 2024 年 1 月 2 日 | 101.44 | 500,000 | 50,718,709.82 |
| 220322 | 22 进出 22 | 2024 年 1 月 2 日 | 100.72 | 500,000 | 50,359,860.81 |
| 230304 | 23 进出 04 | 2024 年 1 月 2 | 100.87 | 1,178,000 | 118,828,686.59 |

| | | | | | |
|-----------|------------|----------------|--------|------------|------------------|
| | | 日 | | | |
| 230306 | 23 进出 06 | 2024 年 1 月 2 日 | 100.51 | 200,000 | 20,102,529.38 |
| 230401 | 23 农发 01 | 2024 年 1 月 2 日 | 102.11 | 300,000 | 30,632,308.34 |
| 230406 | 23 农发 06 | 2024 年 1 月 2 日 | 101.18 | 100,000 | 10,118,326.19 |
| 092218003 | 22 农发清发 03 | 2024 年 1 月 3 日 | 101.19 | 1,064,000 | 107,670,262.68 |
| 合计 | | | | 10,405,000 | 1,043,290,478.72 |

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,100,514.12 元,于 2024 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金,属于高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金及债券型基金。本基金投资的金融工具主要包括现金,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(或回售期限)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在综合考虑基金资产安全性、收益性和流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为投资人创造稳定的收益。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系,公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

为加强公募基金管理的内部控制,促进诚信、合法、有效经营的内部控制环境,保障基金持有人利益,基金管理人遵照国家有关法律法规,遵循合法合规性原则、全面性原则、审慎性原则和适时性原则,制定了系统完善的内部控制制度。内部控制的主要内容包括投资管理业务控制、市场营销与过户登记业务控制、信息披露控制、监察稽核控制等。

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，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行股份有限公司；定期存款存放在具有基金托管资格的大型商业银行，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；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，违约可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于信用等级在 AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具，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。本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净资产的 10%。

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。

7.4.13.2.1 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 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1 | 0.00 | 30,787,498.08 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 416,094,883.47 | 190,699,306.68 |
| 合计 | 416,094,883.47 | 221,486,804.76 |

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
|--------|-------------------------|--------------------------|

| | | |
|--------|------|------|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA | 93,589,279.12 | 20,364,579.33 |
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 93,589,279.12 | 20,364,579.33 |

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA | 0.00 | 0.00 |
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

7.4.13.2.6 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 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| AAA | 3,018,337,691.05 | 1,409,366,391.98 |
| AAA 以下 | 193,760,001.00 | 0.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 3,212,097,692.05 | 1,409,366,391.98 |

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

7.4.13.3 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 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金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。

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发行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。

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未来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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2023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 | | | | | |
| 货币资金 | 5,159,894,691.95 | 800,952,222.28 | - | - | 5,960,846,914.23 |
| 结算备付金 | 6,663,624.08 | - | - | - | 6,663,624.08 |
| 交易性金融资产 | 3,617,740,051.09 | 648,756,129.37 | - | - | 4,266,496,180.46 |
| 买入返售金融资产 | 1,230,092,987.06 | - | - | - | 1,230,092,987.06 |
| 应收申购款 | - | - | - | 26,123,497.91 | 26,123,497.91 |
| 资产总计 | 10,014,391,354.18 | 1,449,708,351.65 | - | 26,123,497.91 | 11,490,223,203.74 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 10,000.00 | 10,000.00 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,208,558.83 | 1,208,558.83 |
| 应付托管费 | - | - | - | 483,423.52 | 483,423.52 |
| 卖出回购金融资产款 | 965,367,909.90 | - | - | - | 965,367,909.90 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,022,879.90 | 1,022,879.90 |
| 应付利润 | - | - | - | 661,035.11 | 661,035.11 |
| 应交税费 | - | - | - | 21,271.47 | 21,271.47 |
| 其他负债 | - | - | - | 247,054.19 | 247,054.19 |
| 负债总计 | 965,367,909.90 | - | - | 3,654,223.02 | 969,022,132.92 |
| 利率敏感度缺口 | 9,049,023,444.28 | 1,449,708,351.65 | - | 22,469,274.89 | 10,521,201,070.82 |
| 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 | | | | | |
| 货币资金 | 1,601,666,789.62 | - | - | - | 1,601,666,789.62 |
| 结算备付金 | 608,415.29 | - | - | - | 608,415.29 |
| 存出保证金 | 1,621.12 | - | - | - | 1,621.12 |
| 交易性金融资产 | 1,861,902,618.69 | - | - | - | 1,861,902,618.69 |
| 买入返售金融资产 | 1,159,702,557.57 | - | - | - | 1,159,702,557.57 |
| 应收申购款 | - | - | - | 69,302,164.61 | 69,302,164.61 |
| 资产总计 | 4,623,882,002.29 | - | - | 69,302,164.61 | 4,693,184,166.90 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 13,979.03 | 13,979.03 |

| | | | | | |
|-----------|------------------|---|---|---------------|------------------|
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 443,963.27 | 443,963.27 |
| 应付托管费 | - | - | - | 177,585.29 | 177,585.29 |
| 应付清算款 | - | - | - | 10,110,288.08 | 10,110,288.08 |
| 卖出回购金融资产款 | 529,101,099.16 | - | - | - | 529,101,099.16 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 604,942.82 | 604,942.82 |
| 应付利润 | - | - | - | 269,244.67 | 269,244.67 |
| 应交税费 | - | - | - | 4,399.53 | 4,399.53 |
| 其他负债 | - | - | - | 137,481.67 | 137,481.67 |
| 负债总计 | 529,101,099.16 | - | - | 11,761,884.36 | 540,862,983.52 |
| 利率敏感度缺口 | 4,094,780,903.13 | - | - | 57,540,280.25 | 4,152,321,183.38 |

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

| | | | |
|----|--|-----------------------------|-------------------|
| 假设 | 假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2023年12月31日） | 上年度末（2022年12月31日） |
| | 市场利率上调 0.25% | -3,680,184.88 | -1,319,004.06 |
| | 市场利率下调 0.25% | 3,687,652.19 | 1,321,089.88 |

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。

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。

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

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 4,266,496,180.46 | 1,861,902,618.69 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 4,266,496,180.46 | 1,861,902,618.69 |

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成

本

计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 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。

§ 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 | 固定收益投资 | 4,266,496,180.46 | 37.13 |
| | 其中：债券 | 4,266,496,180.46 | 37.13 |
| | 资产支持证 券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 1,230,092,987.06 | 10.71 |
| | 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 | 5,967,510,538.31 | 51.94 |
| 4 | 其他各项资产 | 26,123,497.91 | 0.23 |
| 5 | 合计 | 11,490,223,203.74 | 100.00 |

8.2 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 | 10.79 | |
| | 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 | 965,367,909.90 | 9.18 |
| | 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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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 | 108 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 120 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 41 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

8.3.2 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比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------------|--------------------|--------------------|
| 1 | 30 天以内 | 21.34 | 9.18 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 3.15 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 36.09 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 2.59 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 45.79 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 108.96 | 9.18 |

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

在本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

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 | 按实际利率计算的账面价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------------|------------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 544,714,325.82 | 5.18 |
| | 其中：政策性金融债 | 544,714,325.82 | 5.18 |
| 4 | 企业债券 | 52,239,373.31 | 0.50 |
| 5 | 企业短期融资券 | 416,094,883.47 | 3.95 |
| 6 | 中期票据 | 41,349,905.81 | 0.39 |
| 7 | 同业存单 | 3,212,097,692.05 | 30.53 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 4,266,496,180.46 | 40.55 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

8.6 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) | 按实际利率计算的 账面价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|--------------------------|-------------|-------------------------|------------------|
| 1 | 112386661 | 23 广州农村 商业银行 CD103 | 3,000,000 | 298,543,008.13 | 2.84 |
| 2 | 112322071 | 23 邮储银行 CD071 | 2,000,000 | 199,296,101.81 | 1.89 |
| 3 | 112305041 | 23 建设银行 CD041 | 2,000,000 | 199,222,739.82 | 1.89 |
| 4 | 112306112 | 23 交通银行 CD112 | 2,000,000 | 199,082,095.76 | 1.89 |
| 5 | 112313190 | 23 浙商银行 CD190 | 2,000,000 | 198,249,342.96 | 1.88 |
| 6 | 092218003 | 22 农发清发 03 | 1,500,000 | 151,790,783.85 | 1.44 |
| 7 | 230304 | 23 进出 04 | 1,280,000 | 129,117,757.92 | 1.23 |
| 8 | 210207 | 21 国开 07 | 1,000,000 | 101,874,049.51 | 0.97 |
| 9 | 112385575 | 23 深圳前海 微众银行 CD032 | 1,000,000 | 99,683,674.54 | 0.95 |
| 10 | 112386927 | 23 徽商银行 CD141 | 1,000,000 | 99,512,837.56 | 0.95 |

8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|----------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25 (含) -0.5% 间的次数 | 0 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0718% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0313% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0259% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明

在本报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况说明

在本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

8.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

广发银行股份有限公司因小微企业划型不准确、违规发放房地产贷款等原因在本报告编制前一年内受到中国银行保险监督管理委员会的公开处罚。

徽商银行股份有限公司因未按规定开展持续的客户身份识别等行为在本报告编制前一年内受到中国人民银行合肥市中心支行的公开处罚。

交通银行股份有限公司因贷后管理不到位严重违反审慎经营规则在本报告编制前一年内受到中国银行保险监督管理委员会商丘监管分局的公开处罚。

兴业银行股份有限公司因衍生品交易未严格审查交易对手的交易资格等行为在本报告编制前一年内受到中国银行保险监督管理委员会上海监管局的责令改正和公开处罚。

浙商银行股份有限公司因向小微企业客户转嫁成本，违规要求客户承担抵押评估费等原因在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局浙江监管局的公开处罚。

中国建设银行股份有限公司因单个网点在同一会计年度内与超过 3 家保险公司开展保险业务合作等行为在本报告编制前一年内受到中国银行保险监督管理委员会的公开处罚；因并表管理内部审计存在不足等原因在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局的公开处罚。

中国民生银行股份有限公司因规避委托贷款监管、违规利用委托债权投资业务向企业融资等行为在本报告编制前一年内受到国家金融监督管理总局的公开处罚。

报告期内本基金投资的前十名证券发行主体除上述主体收到监管部门处罚决定书或行政监管措施决定书外，其他发行主体未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。

8.9.3 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 | - |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 26,123,497.91 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 26,123,497.91 |

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

- 1、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。
- 2、报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

§ 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

| 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 (%) |
| 泰康现金管家货币 A | 5,507 | 21,633.81 | 4,285,093.48 | 3.60 | 114,852,324.28 | 96.40 |
| 泰康现金管家货币 B | 25 | 62,251,946.93 | 1,542,928,594.76 | 99.14 | 13,370,078.55 | 0.86 |
| 泰康现金管家货币 C | 241,545 | 18,159.11 | 1,463,783,972.84 | 33.37 | 2,922,458,664.69 | 66.63 |
| 泰康现金管家货币 D | 662,069 | 6,735.74 | 0.00 | 0.00 | 4,459,522,342.22 | 100.00 |
| 合计 | 906,791 | 11,602.67 | 3,010,997,661.08 | 28.62 | 7,510,203,409.74 | 71.38 |

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额 (份) | 占总份额比例 (%) |
|----|-------|----------------|------------|
| 1 | 券商类机构 | 300,019,589.02 | 2.85 |
| 2 | 银行类机构 | 203,552,589.11 | 1.93 |
| 3 | 银行类机构 | 200,597,809.86 | 1.91 |
| 4 | 其他机构 | 200,038,326.14 | 1.90 |
| 5 | 其他机构 | 178,802,497.81 | 1.70 |
| 6 | 其他机构 | 150,216,344.12 | 1.43 |
| 7 | 信托类机构 | 121,051,407.05 | 1.15 |
| 8 | 其他机构 | 103,886,810.27 | 0.99 |
| 9 | 券商类机构 | 102,795,561.39 | 0.98 |
| 10 | 银行类机构 | 101,743,031.20 | 0.97 |

9.3 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 | 泰康现金管家货币 A | 1,092,180.86 | 0.9167 |
| | 泰康现金管家货币 B | 6,196,819.18 | 0.3982 |
| | 泰康现金管家货币 C | 903,220.91 | 0.0206 |
| | 泰康现金管家货币 D | 9.64 | 0.0000 |
| | 合计 | 8,192,230.59 | 0.0779 |

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 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 | 泰康现金管家货币 A | 0~10 |
| | 泰康现金管家货币 B | >100 |
| | 泰康现金管家货币 C | 0~10 |
| | 泰康现金管家货币 D | 0~10 |
| | 合计 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 泰康现金管家货币 A | 0~10 |
| | 泰康现金管家货币 B | 0 |
| | 泰康现金管家货币 C | 50~100 |
| | 泰康现金管家货币 D | 0~10 |
| | 合计 | 50~100 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 泰康现金管家货币 A | 泰康现金管家货币 B | 泰康现金管家货币 C | 泰康现金管家货币 D |
|------------------------------|----------------|------------------|-------------------|-------------------|
| 基金合同生效日 (2017年9月8日)基金份额总额 | 307,705.00 | 8,000,800.00 | 1,049,210,199.38 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 186,130,091.82 | 757,986,791.39 | 641,201,034.02 | 2,567,003,266.15 |
| 本报告期基金总申购份额 | 203,067,526.60 | 3,129,541,266.69 | 15,295,723,102.68 | 20,545,691,024.16 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 270,060,200.66 | 2,331,229,384.77 | 11,550,681,499.17 | 18,653,171,948.09 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 119,137,417.76 | 1,556,298,673.31 | 4,386,242,637.53 | 4,459,522,342.22 |

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入及基金份额自动升降级调增份额；基金总赎回份额含转换出及基金份额自动升降级调减份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金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

2023 年 3 月 15 日，泰康基金管理有限公司成立上海分公司，金志刚担任上海分公司负责人。2023 年 4 月 19 日，泰康基金管理有限公司成立深圳分公司，金志刚担任深圳分公司负责人。2023 年 12 月 3 日，金志刚不再担任上海分公司负责人及深圳分公司负责人，并聘任吴辉担任上海分公司负责人，代胜伟担任深圳分公司负责人。

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

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 90,000.00 元；截至 2023 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供审计服务不满 7 年。

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，本基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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 (%) | |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 东吴证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 4 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序 交易单元租用券商选择的首要标准为符合监管机构相关规定，包括但不限于满足以下条件：

- (1) 经营行为规范，近一年内无重大违规行为，未受监管机构重大处罚；
- (2) 财务状况和经营状况良好；
- (3) 内部管理规范，具备健全的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能提供质量较高的市场研究报告，并能根据基金投资需求提供专门的研究报告；
- (5) 能及时提供准确的信息资讯服务；
- (6) 满足基金运作的保密要求；
- (7) 符合中国证监会规定的其他条件。

本基金管理人依据以上标准，定期或者不定期对候选券商研究实力和服务质量进行评估，确定租用交易单元的券商，基金管理人与被选择的券商签订相关协议并通知托管行。

3、本报告期内本基金减少租用 18 个交易单元，华创证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，方正证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，兴业证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，光大证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，广发证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，招商证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中金公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东方证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中泰证券上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个。

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

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|--------|---------------|-----------------|-------------------|-------------------|------|-----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例(%) |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 90,272,180.00 | 100.00 | 15,810,779,000.00 | 100.00 | - | - |
| 中信建投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期，本基金不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 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 | 泰康现金管家货币市场基金暂停直销销售机构大额申购（含转换转入及定投）业务公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 01 月 10 日 |
| 2 | 泰康现金管家货币市场基金 2023 年 | 《证券时报》；中国证监会 | 2023 年 01 月 18 日 |

| | | | |
|----|---|------------------------------|------------------|
| | “春节”假期暂停申购、转换转入业务公告 | 监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | |
| 3 | 泰康现金管家货币市场基金 2022 年第四季度报告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 01 月 19 日 |
| 4 | 关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增海通证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 02 月 17 日 |
| 5 | 泰康基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 03 月 17 日 |
| 6 | 泰康现金管家货币市场基金 2022 年年度报告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 03 月 30 日 |
| 7 | 关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增国金证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 04 月 17 日 |
| 8 | 泰康基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 04 月 21 日 |
| 9 | 泰康现金管家货币市场基金 2023 年第一季度报告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 04 月 21 日 |
| 10 | 泰康现金管家货币市场基金 2023 年“劳动节”假期暂停申购、转换转入业务公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 04 月 26 日 |
| 11 | 关于调整泰康现金管家货币市场基金 C 类基金份额在华宝证券股份有限公司最低申购金额、追加申购最低金额、赎回最低份额和持有最低限额的公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 05 月 25 日 |
| 12 | 泰康现金管家货币市场基金 C 类、D 类基金份额恢复个人投资者大额申购（含转换转入及定投）业务公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 05 月 25 日 |
| 13 | 关于调整泰康现金管家货币市场基金 C 类基金份额在上海天天基金销售有限公司最低申购金额、追加申购最低金额、赎回最低份额和持有最低限额的公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 05 月 25 日 |
| 14 | 关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增广发证券股份有限公司为销售机构并调整部分基金 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 06 月 16 日 |

| | | | |
|----|--|------------------------------|------------------|
| | 最低申购金额、追加申购最低金额、赎回最低份额和持有最低限额的公告 | | |
| 15 | 泰康现金管家货币市场基金 2023 年“端午节”假期暂停申购、转换转入业务公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 06 月 19 日 |
| 16 | 泰康基金管理有限公司关于旗下部分基金产品风险等级调整的公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 06 月 28 日 |
| 17 | 关于调整泰康现金管家货币市场基金 C 类基金份额在平安银行股份有限公司最低申购金额、追加申购最低金额、赎回最低份额和持有最低限额的公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 07 月 06 日 |
| 18 | 泰康现金管家货币市场基金 2023 年第二季度报告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 07 月 20 日 |
| 19 | 关于调整泰康现金管家货币市场基金 C 类基金份额在上海联泰基金销售有限公司最低申购金额、追加申购最低金额、赎回最低份额和持有最低限额的公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 07 月 25 日 |
| 20 | 关于泰康现金管家货币市场基金 C 类基金份额新增中国民生银行股份有限公司为销售机构并调整最低申购金额、追加申购最低金额、赎回最低份额和持有最低限额的公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 08 月 02 日 |
| 21 | 关于调整泰康现金管家货币市场基金 C 类基金份额在蚂蚁（杭州）基金销售有限公司最低申购金额、追加申购最低金额、赎回最低份额和持有最低限额的公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 08 月 04 日 |
| 22 | 泰康现金管家货币市场基金 2023 年中期报告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 08 月 30 日 |
| 23 | 泰康基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 09 月 08 日 |
| 24 | 泰康现金管家货币市场基金 2023 年“中秋节、国庆节”假期暂停申购、转换转入业务公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 09 月 26 日 |
| 25 | 泰康现金管家货币市场基金 2023 年第三季度报告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 10 月 24 日 |

| | | | |
|----|--|------------------------------|------------------|
| 26 | 关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加上海万得基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 11 月 08 日 |
| 27 | 关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加平安银行股份有限公司转换费率优惠活动的公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 11 月 27 日 |
| 28 | 关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加嘉实财富管理有限公司转换费率优惠活动的公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 11 月 29 日 |
| 29 | 泰康现金管家货币市场基金（泰康现金管家货币 C 份额）基金产品资料概要更新 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 12 月 08 日 |
| 30 | 泰康现金管家货币市场基金（泰康现金管家货币 D 份额）基金产品资料概要更新 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 12 月 08 日 |
| 31 | 泰康现金管家货币市场基金（泰康现金管家货币 A 份额）基金产品资料概要更新 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 12 月 08 日 |
| 32 | 泰康现金管家货币市场基金（泰康现金管家货币 B 份额）基金产品资料概要更新 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 12 月 08 日 |
| 33 | 泰康现金管家货币市场基金更新招募说明书（2023 年第 1 次更新） | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 12 月 08 日 |
| 34 | 泰康基金管理有限公司关于深圳分公司负责人变更的公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 12 月 15 日 |
| 35 | 泰康基金管理有限公司关于上海分公司负责人及注册地址变更的公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 12 月 16 日 |
| 36 | 泰康现金管家货币市场基金 2024 年“元旦”假期暂停申购、转换转入业务公告 | 《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2023 年 12 月 27 日 |

§ 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

本基金报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予泰康现金管家货币市场基金注册的文件；
- (二) 《泰康现金管家货币市场基金基金合同》；
- (三) 《泰康现金管家货币市场基金招募说明书》；
- (四) 《泰康现金管家货币市场基金托管协议》；
- (五) 《泰康现金管家货币市场基金产品资料概要》。

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《证券时报》）或登录基金管理人网站（<http://www.tkfunds.com.cn>）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查阅。

泰康基金管理有限公司

2024年3月29日