

# 天弘现金管家货币市场基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 30 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年01月01日起至2024年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 债券回购融资情况	48
7.3 基金投资组合平均剩余期限	48
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	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	50
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	51
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	51
7.9 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	54
§9 开放式基金份额变动	55

§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	58
10.9 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
11.1 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.....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天弘现金管家货币市场基金				
基金简称	天弘现金管家货币				
基金主代码	420006				
基金运作方式	契约型开放式				
基金合同生效日	2012年06月20日				
基金管理人	天弘基金管理有限公司				
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司				
报告期末基金份额总额	10,689,483,251.85份				
基金合同存续期	不定期				
下属分级基金的基金简称	天弘现金管家货币A	天弘现金管家货币B	天弘现金管家货币C	天弘现金管家货币D	天弘现金管家货币E
下属分级基金的交易代码	420006	420106	000832	001251	002847
报告期末下属分级基金的份额总额	86,096,862.96份	1,860,928,474.49份	865,006.10份	1,428,547.31份	8,740,164,360.99份

### 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	资产配置策略、个券选择策略、久期策略、回购策略、套利策略、现金流管理策略等。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其预期收益和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	天弘基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	童建林	张立学
	联系电话	022-83310208	010-68858113
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		95046	95580
传真		022-83865564	010-68858120
注册地址		天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦2 3层	北京市西城区金融大街3号
办公地址		天津市河西区马场道59号天津 国际经济贸易中心A座16 层	北京市西城区金融大街3号A 座
邮政编码		300203	100808
法定代表人		韩歆毅	刘建军

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的 管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	天津市河西区马场道59号天津国际 经济贸易中心A座16层

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期
---------------	-----

	(2024年01月01日-2024年06月30日)				
	天弘 现金 管家 货币A	天弘 现金 管家 货币B	天弘 现金 管家 货币C	天弘 现金 管家 货币D	天弘 现金 管家 货币E
本期已实现收益	787,75 2.91	18,06 5,392. 54	9,228. 69	12,93 0.63	79,61 6,762. 00
本期利润	787,75 2.91	18,06 5,392. 54	9,228. 69	12,93 0.63	79,61 6,762. 00
本期净值收益率	0.897 4%	0.990 8%	0.967 6%	0.897 4%	0.897 5%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2024年06月30日)				
期末基金资产净值	86,09 6,862. 96	1,860, 928,47 4.49	865,00 6.10	1,428, 547.31	8,740, 164,36 0.99
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2024年06月30日)				
累计净值收益率	38.783 7%	40.136 3%	26.105 6%	24.337 8%	20.869 6%

注：1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

2、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。

3、本基金的利润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

天弘现金管家货币A

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	收益率①	收益率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	0.1282%	0.0009%	0.1126%	0.0000%	0.0156%	0.0009%
过去三个月	0.4089%	0.0008%	0.3418%	0.0000%	0.0671%	0.0008%
过去六个月	0.8974%	0.0010%	0.6848%	0.0000%	0.2126%	0.0010%
过去一年	1.7322%	0.0009%	1.3819%	0.0000%	0.3503%	0.0009%
过去三年	5.5959%	0.0010%	4.1955%	0.0000%	1.4004%	0.0010%
自基金合同生效日起至今	38.7837%	0.0051%	17.9145%	0.0000%	20.8692%	0.0051%

天弘现金管家货币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
过去一个月	0.1479%	0.0009%	0.1126%	0.0000%	0.0353%	0.0009%
过去三个月	0.4689%	0.0008%	0.3418%	0.0000%	0.1271%	0.0008%
过去六个月	0.9908%	0.0013%	0.6848%	0.0000%	0.3060%	0.0013%
过去一年	1.9496%	0.0011%	1.3819%	0.0000%	0.5677%	0.0011%
过去三年	5.2208%	0.0023%	4.1955%	0.0000%	1.0253%	0.0023%
自基金合同生效日起至今	40.1363%	0.0055%	17.9145%	0.0000%	22.2218%	0.0055%

天弘现金管家货币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
过去一个月	0.1397%	0.0009%	0.1126%	0.0000%	0.0271%	0.0009%
过去三个月	0.4439%	0.0008%	0.3418%	0.0000%	0.1021%	0.0008%
过去六个月	0.9676%	0.0010%	0.6848%	0.0000%	0.2828%	0.0010%

过去一年	1.8747%	0.0009%	1.3819%	0.0000%	0.4928%	0.0009%
过去三年	4.2757%	0.0026%	4.1955%	0.0000%	0.0802%	0.0026%
自基金份额首次确认日起至今	26.1056%	0.0043%	14.2047%	0.0000%	11.9009%	0.0043%

## 天弘现金管家货币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	0.1282%	0.0009%	0.1126%	0.0000%	0.0156%	0.0009%
过去三个月	0.4089%	0.0008%	0.3418%	0.0000%	0.0671%	0.0008%
过去六个月	0.8974%	0.0010%	0.6848%	0.0000%	0.2126%	0.0010%
过去一年	1.7323%	0.0009%	1.3819%	0.0000%	0.3504%	0.0009%
过去三年	5.5960%	0.0010%	4.1955%	0.0000%	1.4005%	0.0010%
自基金份额首次确认日起至今	24.3378%	0.0030%	13.3557%	0.0000%	10.9821%	0.0030%

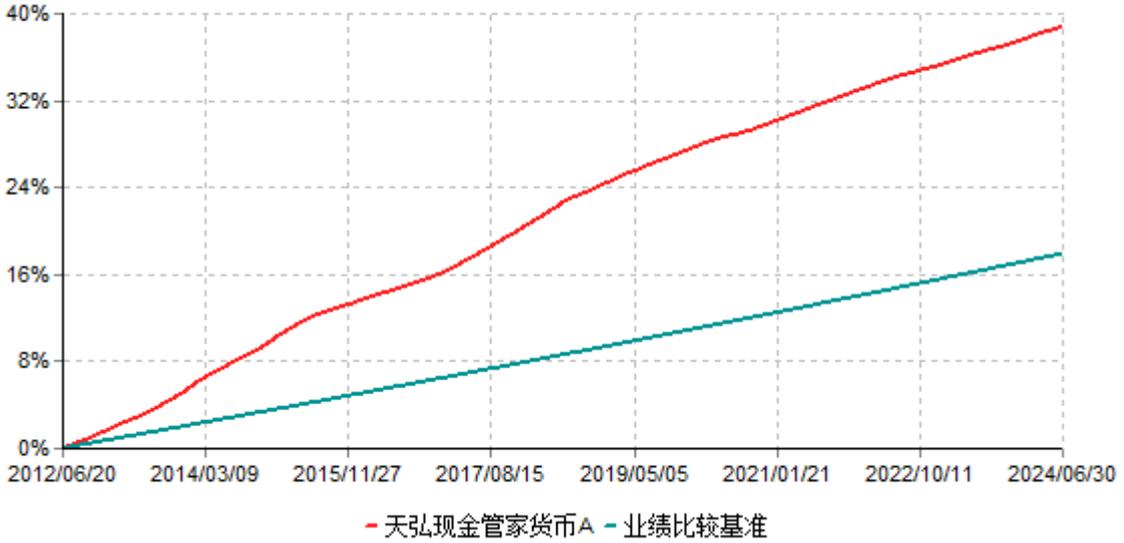
## 天弘现金管家货币E

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	0.1282%	0.0009%	0.1126%	0.0000%	0.0156%	0.0009%
过去三个月	0.4089%	0.0008%	0.3418%	0.0000%	0.0671%	0.0008%
过去六个月	0.8975%	0.0010%	0.6848%	0.0000%	0.2127%	0.0010%
过去一年	1.7323%	0.0009%	1.3819%	0.0000%	0.3504%	0.0009%
过去三年	5.5958%	0.0010%	4.1955%	0.0000%	1.4003%	0.0010%
自基金份额首次确认日起至今	20.8696%	0.0029%	11.5216%	0.0000%	9.3480%	0.0029%

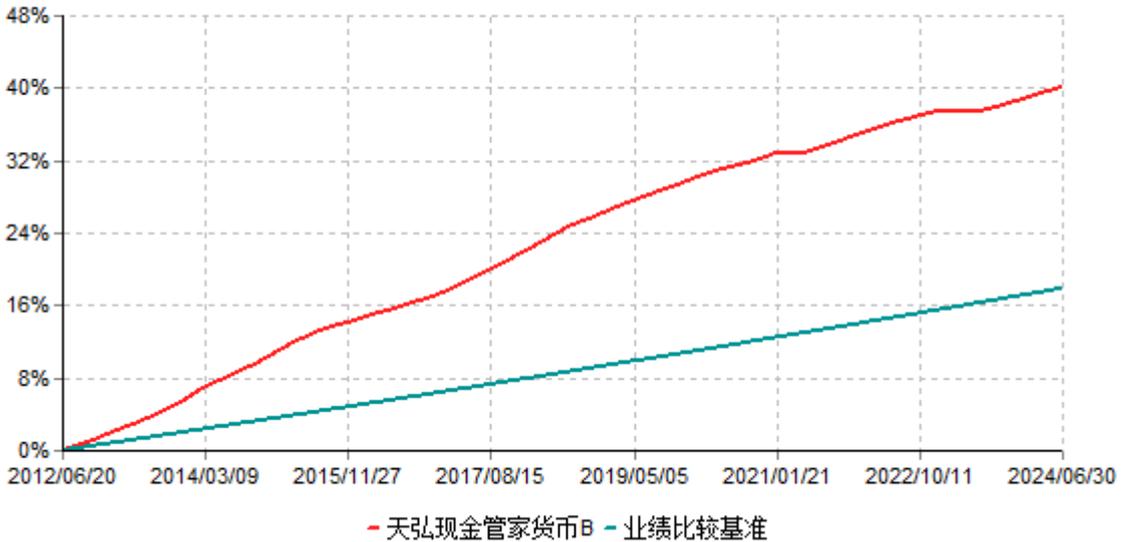
注：本基金的收益分配是按日结转份额。

### 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

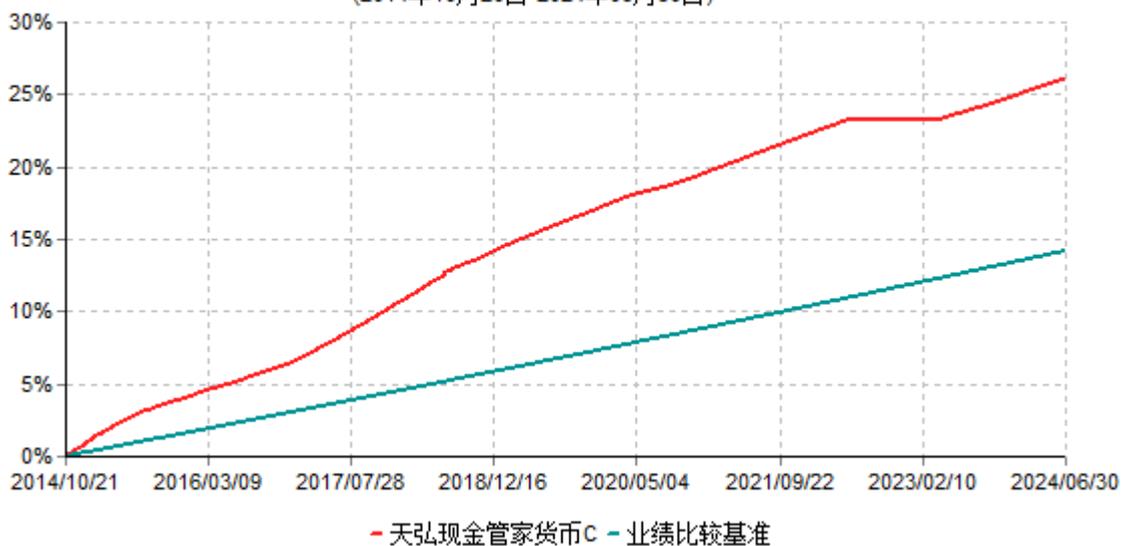
天弘现金管家货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2012年06月20日-2024年06月30日)



天弘现金管家货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2012年06月20日-2024年06月30日)



天弘现金管家货币C累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2014年10月20日-2024年06月30日)



天弘现金管家货币D累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015年05月07日-2024年06月30日)



天弘现金管家货币E累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年07月15日-2024年06月30日)



注：1、本基金合同于2012年06月20日生效。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

3、本基金自2014年10月15日起增设天弘现金管家货币C基金份额。天弘现金管家货币C基金份额的首次确认日为2014年10月21日。本基金自2015年05月05日起增设天弘现金管家货币D基金份额。天弘现金管家货币D基金份额的首次确认日为2015年05月07日。本基金自2016年07月14日起增设天弘现金管家货币E基金份额。天弘现金管家货币E基金份额的首次确认日为2016年07月15日。

## §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

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立，注册资本为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、深圳、四川、浙江设有分公司。公司股权结构为：

股东名称	股权比例
蚂蚁科技集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

截至2024年6月30日，公司共管理运作197只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

#### 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		
李一纯	本基金基金经理	2023年08月	-	9年	女，金融学硕士。历任泰康资产管理有限责任公司债券交易员；2017年6月加盟本公司，历任债券交易员、高级债券交易员、高级宏观研究员、基金经理助理。
刘莹	本基金基金经理	2019年07月	-	15年	女，管理科学与工程硕士。历任泰康资产管理有限公司交易员、信诚人寿保险有限公司研究员、南方基金管理有限公司基金经理、西南证券股份有限公司投资经理。2019年6月加盟本公司。

李晨	本基金基金经理	2016年11月	-	14年	女，金融学硕士。历任泰康资产管理有限责任公司助理研究员。2011年6月加盟本公司，历任本公司投资经理、固定收益部研究员。
田瑶	本基金基金经理助理	2018年11月	-	12年	女，金融学硕士。2012年7月加盟本公司，历任本公司债券研究员、债券交易员。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、本基金基金经理助理协助基金经理进行投资、研究、头寸管理等日常工作。

3、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在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 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因不公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的5%的交易次数为1次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024年上半年，宏观组合政策靠前发力，一季度经济实现平稳开局，二季度延续恢复态势。但外部环境复杂性严峻性有所上升，国内有效需求仍显不足，政策层面对于经济的支持力度持续加大。具体看，央行于1月25日分别下调支农再贷款、支小再贷款和再贴现利率各0.25个百分点，于2月5日下调存款准备金率0.5个百分点、引导5年LPR降低0.25个百分点，并在一季度完成PSL投放。二季度，央行着力促进信贷均衡投放、治理和防范资金空转、整顿手工补息，并推出房地产支持政策组合，包括降低个人住房贷款最低首付比例、取消个人房贷利率下限、下调公积金贷款利率。上半年流动性保持合理充裕，货币市场收益率整体下行。本基金采取稳健的投资策略，遵循资产负债相匹配的原则，动态调整组合久期，合理使用杠杆，稳健配置资产。本基金在报告期内，为持有人创造了与风险相匹配的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2024年06月30日，天弘现金管家货币A本报告期净值收益率为0.8974%，天弘现金管家货币B本报告期净值收益率为0.9908%，天弘现金管家货币C本报告期净值收益率为0.9676%，天弘现金管家货币D本报告期净值收益率为0.8974%，天弘现金管家货币E本报告期净值收益率为0.8975%，同期业绩比较基准收益率为0.6848%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为在前期政策推动下，国内经济会延续恢复态势。具体来看，随着“两重”建设项目陆续下达开工，实物工作量加快形成，投资规模将继续稳步扩大。随着促消费政策的落实落细和消费场景的创新拓展，消费潜力有望进一步释放。有关部门和地区进一步调整优化房地产政策，后续伴随新的去库存、稳市场储备政策落实，房地产市场有望逐步企稳。全球贸易呈现出趋稳改善的迹象，我国外贸仍有较强韧性。综上，我们认为从生产需求、政策支撑等因素分析，经济有望继续延续回升向好的态势。货币政策保持支持性立场，货币市场流动性维持合理充裕，货币市场利率将围绕政策利

率上下运行。本基金将继续保持稳健的投资风格，以获取稳定的票息收益为投资目的，为持有人争取与风险相匹配的收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会成员由公司分管投资的高级管理人员、督察长、首席风控官、分管估值业务高级管理人员以及研究管理人员组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理（投资经理）、股票/债券研究员、基金运营部、风险管理部和内控合规部的相关人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书（更新）等有关规定，本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人（该收益参与下一日的收益分配），并按自然日结转至基金份额持有人的基金账户。

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

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

## §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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在天弘现金管家货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：天弘现金管家货币市场基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,925,649,016.64	3,938,239,778.16
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	8,034,674,099.92	3,686,624,591.93
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		8,034,674,099.92	3,686,624,591.93
资产支持证券 投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,150,942,504.42	2,365,499,350.16
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		25,015,766.46	25,360.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		12,136,281,387.44	9,990,389,080.88
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,440,351,384.37	1,094,237,539.68
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,278,202.39	2,515,640.26
应付托管费		993,394.67	762,315.20
应付销售服务费		1,845,485.75	1,903,169.63
应付投资顾问费		-	-
应交税费		32,040.84	6,214.72
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	297,627.57	475,981.72
负债合计		1,446,798,135.59	1,099,900,861.21
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	10,689,483,251.85	8,890,488,219.67
未分配利润	6.4.7.8	-	-

净资产合计		10,689,483,251.85	8,890,488,219.67
负债和净资产总计		12,136,281,387.44	9,990,389,080.88

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额10,689,483,251.85份，其中天弘现金管家货币市场基金A类基金份额86,096,862.96份，天弘现金管家货币市场基金B类基金份额1,860,928,474.49份，天弘现金管家货币市场基金C类基金份额865,006.10份，天弘现金管家货币市场基金D类基金份额1,428,547.31份，天弘现金管家货币市场基金E类基金份额8,740,164,360.99份。

## 6.2 利润表

会计主体：天弘现金管家货币市场基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		143,039,425.07	118,217,358.51
1.利息收入		66,182,178.83	71,213,961.63
其中：存款利息收入	6.4.7.9	40,291,831.76	44,981,447.90
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		25,890,347.07	26,232,513.73
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		76,857,246.24	47,003,396.88
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	76,857,246.24	47,003,396.88
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-

衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		44,547,358.30	35,117,350.37
1.管理人报酬		17,808,892.75	15,339,014.59
2.托管费		5,396,634.84	4,648,186.19
3.销售服务费		11,276,890.07	11,619,564.71
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		9,899,070.40	3,353,799.00
其中：卖出回购金融资产支出		9,899,070.40	3,353,799.00
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		13,007.02	5,799.25
8.其他费用	6.4.7.18	152,863.22	150,986.63
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		98,492,066.77	83,100,008.14
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		98,492,066.77	83,100,008.14
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		98,492,066.77	83,100,008.14

### 6.3 净资产变动表

会计主体：天弘现金管家货币市场基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	8,890,488,219.67	-	8,890,488,219.67
二、本期期初净资产	8,890,488,219.67	-	8,890,488,219.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,798,995,032.18	-	1,798,995,032.18
（一）、综合收益总额	-	98,492,066.77	98,492,066.77
（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）	1,798,995,032.18	-	1,798,995,032.18
其中：1.基金申购款	42,336,113,495.44	-	42,336,113,495.44
2.基金赎回款	-40,537,118,463.26	-	-40,537,118,463.26
（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）	-	-98,492,066.77	-98,492,066.77
四、本期期末净资产	10,689,483,251.85	-	10,689,483,251.85
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	8,650,490,626.75	-	8,650,490,626.75

二、本期期初净资产	8,650,490,626.75	-	8,650,490,626.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	732,234,283.64	-	732,234,283.64
（一）、综合收益总额	-	83,100,008.14	83,100,008.14
（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）	732,234,283.64	-	732,234,283.64
其中：1.基金申购款	42,247,065,061.99	-	42,247,065,061.99
2.基金赎回款	-41,514,830,778.35	-	-41,514,830,778.35
（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）	-	-83,100,008.14	-83,100,008.14
四、本期期末净资产	9,382,724,910.39	-	9,382,724,910.39

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：

高阳

薄贺龙

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

天弘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[2012]635号《关于核准天弘现金管家货币市场基金募集的批复》核准，由天弘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《天

弘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1,234,347,012.51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(2012)第205号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘现金管家货币市场基金基金合同》于2012年6月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,234,437,256.97份基金份额，其中认购资金利息折合90,244.46份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《天弘现金管家货币市场基金基金合同》、《天弘现金管家货币市场基金招募说明书》、《关于天弘现金管家货币市场基金增设C级基金份额并相应修订基金合同部分条款的公告》、《关于天弘现金管家货币市场基金增设D级基金份额并相应修订基金合同部分条款的公告》和《关于天弘现金管家货币市场基金增设E级基金份额并相应修订基金合同部分条款的公告》的有关规定，本基金根据投资者认(申)购的金额等级或其他条件，对投资者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等级。本基金将设A级、B级、C级、D级和E级五级基金份额，五级基金份额单独设置基金代码，并单独公布每万份基金净收益和七日年化收益率。本基金C级、D级和E级基金份额不进行基金份额升降级。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘现金管家货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于以下金融工具：(1)现金；(2)期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；(3)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；(4)中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：七天通知存款利率(税后)。

#### 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》、《天弘现金管家货币市场基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2024年06月30日的财务状况以及2024年度上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	
	2024年06月30日	
活期存款	3,033,392.58	
等于：本金	3,030,680.03	
加：应计利息	2,712.55	
减：坏账准备	-	
定期存款	1,922,615,624.06	
等于：本金	1,897,000,000.00	
加：应计利息	25,615,624.06	
减：坏账准备	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	1,922,615,624.06	
其他存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
合计	1,925,649,016.64	

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		2024年06月30日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	8,034,674,099.92	8,043,161,237.71	8,487,137.79	0.0794
	合计	8,034,674,099.92	8,043,161,237.71	8,487,137.79	0.0794

资产支持证券	-	-	-	-
合计	8,034,674,099.92	8,043,161,237.71	8,487,137.79	0.0794

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	2,150,942,504.42	-
合计	2,150,942,504.42	-

##### 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

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	154,064.35
其中：交易所市场	-
银行间市场	154,064.35

应付利息	-
预提费用	143,563.22
合计	297,627.57

### 6.4.7.7 实收基金

#### 6.4.7.7.1 天弘现金管家货币A

金额单位：人民币元

项目 (天弘现金管家货币A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	87,837,848.29	87,837,848.29
本期申购	53,239,016.20	53,239,016.20
本期赎回（以“-”号填列）	-54,980,001.53	-54,980,001.53
本期末	86,096,862.96	86,096,862.96

#### 6.4.7.7.2 天弘现金管家货币B

金额单位：人民币元

项目 (天弘现金管家货币B)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,513,241.81	37,513,241.81
本期申购	6,833,327,532.17	6,833,327,532.17
本期赎回（以“-”号填列）	-5,009,912,299.49	-5,009,912,299.49
本期末	1,860,928,474.49	1,860,928,474.49

#### 6.4.7.7.3 天弘现金管家货币C

金额单位：人民币元

项目 (天弘现金管家货币C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,197,808.10	1,197,808.10
本期申购	9,228.69	9,228.69

本期赎回（以“-”号填列）	-342,030.69	-342,030.69
本期末	865,006.10	865,006.10

#### 6.4.7.7.4 天弘现金管家货币D

金额单位：人民币元

项目 (天弘现金管家货币D)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,389,317.83	1,389,317.83
本期申购	889,998.54	889,998.54
本期赎回（以“-”号填列）	-850,769.06	-850,769.06
本期末	1,428,547.31	1,428,547.31

#### 6.4.7.7.5 天弘现金管家货币E

金额单位：人民币元

项目 (天弘现金管家货币E)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,762,550,003.64	8,762,550,003.64
本期申购	35,448,647,719.84	35,448,647,719.84
本期赎回（以“-”号填列）	-35,471,033,362.49	-35,471,033,362.49
本期末	8,740,164,360.99	8,740,164,360.99

注：申购含红利再投份额、分级份额调增和转换转入份额；赎回含分级份额调减和转换转出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 天弘现金管家货币A

单位：人民币元

项目 (天弘现金管家货币A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-

本期利润	787,752.91	-	787,752.91
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	-787,752.91	-	-787,752.91
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.8.2 天弘现金管家货币B

单位：人民币元

项目 (天弘现金管家货币B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	18,065,392.54	-	18,065,392.54
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	-18,065,392.54	-	-18,065,392.54
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.8.3 天弘现金管家货币C

单位：人民币元

项目 (天弘现金管家货币C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	9,228.69	-	9,228.69
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	-9,228.69	-	-9,228.69
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.8.4 天弘现金管家货币D

单位：人民币元

项目 (天弘现金管家货币D)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	12,930.63	-	12,930.63
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	-12,930.63	-	-12,930.63
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.8.5 天弘现金管家货币E

单位：人民币元

项目 (天弘现金管家货币E)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	79,616,762.00	-	79,616,762.00
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	-79,616,762.00	-	-79,616,762.00
本期末	-	-	-

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	67,505.03
定期存款利息收入	40,224,326.73
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	40,291,831.76

**6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入**

本基金本报告期未取得股票投资收益。

**6.4.7.11 债券投资收益****6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	73,287,921.05
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,569,325.19
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	76,857,246.24

**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）	5,867,129,896.17

成交总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,815,576,459.49
减：应计利息总额	47,984,111.49
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	3,569,325.19

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期未取得股利收益。

#### 6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期未取得其他收入。

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
----	-------------------------------

审计费用	74,590.88
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,600.00
合计	152,863.22

#### 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

截至本财务报表批准报出日，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
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	17,808,892.75	15,339,014.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,170,747.86	6,139,653.10
应支付基金管理人的净管理费	11,638,144.89	9,199,361.49

注:1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%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×该日适用费率/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,396,634.84	4,648,186.19

注:支付基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.10%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×该日适用费率/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日					
	当期发生的基金应支付的销售服务费					
	天弘现金	天弘现金	天弘现金	天弘现金	天弘现金	合计

	管家货币A	管家货币B	管家货币C	管家货币D	管家货币E	
天弘基金管理有限公司	5,678.74	66,320.45	0.04	1,549.70	10,827.65	84,376.58
中国邮政储蓄银行股份有限公司	13,020.89	7,134.35	-	-	-	20,155.24
合计	18,699.63	73,454.80	0.04	1,549.70	10,827.65	104,531.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日					
	当期发生的基金应支付的销售服务费					
	天弘现金管家货币A	天弘现金管家货币B	天弘现金管家货币C	天弘现金管家货币D	天弘现金管家货币E	合计
天弘基金管理有限公司	7,072.28	-	0.01	1,399.30	11,308.23	19,779.82
中国邮政储蓄银行股份有限公司	16,274.80	-	-	-	-	16,274.80
合计	23,347.08	-	0.01	1,399.30	11,308.23	36,054.62

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日各级基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金管理有限公司，再由天弘基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。天弘现金管家货币A、天弘现金管家货币B、天弘现金管家货币C、天弘现金管家货币D和天弘现金管家货币E按0.25%、0.01%、0.20%/0.11%、0.25%和0.25%计提销售服务费。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费=前一日各级基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、自2023年04月19日起，天弘现金管家货币C的销售服务费率由0.20%调整为0.11%。销售服务费率调整公告详见官网。

#### 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

单位：人民币元

本期 2024年01月01日至2024年06月30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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	51,131,263.01	-	-	490,187,000.00	25,412.92
上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	-	127,000,000.00	6,610.96	348,068,000.00	42,953.72

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.5.2 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

天弘现金管家货币A

无

天弘现金管家货币B

无

天弘现金管家货币C

无

天弘现金管家货币D

无

天弘现金管家货币E

无

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	3,033,392.58	67,505.03	48,188,571.48	231,139.39

注：本基金由基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司保管的银行存款，按银行同业利率或约定利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

**6.4.10.8 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——固定净值型货币市场基金**

天弘现金管家货币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

787,752.91	-	-	787,752.91	-
------------	---	---	------------	---

天弘现金管家货币B

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
18,065,392.54	-	-	18,065,392.54	-

天弘现金管家货币C

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
9,228.69	-	-	9,228.69	-

天弘现金管家货币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
12,930.63	-	-	12,930.63	-

天弘现金管家货币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
79,616,762.00	-	-	79,616,762.00	-

注：本基金在本年度累计分配收益98,492,066.77元，其中以红利再投资方式转入实收基金98,492,066.77元，计入应付收益科目0.00元。

#### 6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/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

本基金本报告期末未持有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2024年06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1,440,351,384.37元，是以如下债券作为抵押：

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
101901150	19赣高速MTN002	2024-07-01	103.21	700,000	72,246,144.61
101901185	19中电投MTN016B	2024-07-01	103.04	347,000	35,753,158.11
101901295	19京国资MTN002	2024-07-01	102.71	900,000	92,438,508.60
102101565	21中铁股MTN004	2024-07-01	102.41	600,000	61,446,534.77
102102121	21华电股MTN005	2024-07-01	102.47	400,000	40,989,039.09
112304032	23中国银行CD032	2024-07-01	99.80	1,000,000	99,802,369.35
112315358	23民生银行CD358	2024-07-01	99.64	1,000,000	99,641,590.27
112315360	23民生银行CD360	2024-07-01	99.64	1,000,000	99,635,425.89
112315511	23民生银行CD511	2024-07-01	98.85	1,000,000	98,849,722.67
112403002	24农业银行CD002	2024-07-01	99.93	495,000	49,464,084.82
112420018	24广发银行CD018	2024-07-01	99.88	2,000,000	199,763,812.16
220028	22付息国债28	2024-07-01	101.42	1,074,000	108,922,767.80
220332	22进出32	2024-07-01	101.69	1,300,000	132,202,466.87
230306	23进出06	2024-07-01	101.56	1,400,000	142,190,810.68
230421	23农发21	2024-07-01	101.76	2,000,000	203,523,885.04
合计				15,216,000	1,536,870,320.73

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024年06月30日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 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

本基金为货币市场基金，本基金投资于各类固定收益类金融工具，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。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面风险管理理念，建立了以风险委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立风险委员会，负责审议风险管理的宏观政策，指导监督公司风险管理目标的落实等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责指导、协调和监督各业务或职能部门开展风险管理工作；决定公司风险控制政策和程序，审批公司风险管理标准和重要业务风险管理口径；听取风险汇报，并就报告的重大风险管理事项进行决策；听取创新业务或产品风险评估报告；组织和协调重大风险事件的应对，直至风险得到妥善处理；审议公司重要的风险管理制度和流程。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，内控合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、大类风险的识别、计量和控制。风险管理部由督察长分管。内审部对公司内部控制和风险管理的有效性，经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇报。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。

#### 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。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，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，不投资于短期信用评级在A-1级以下或长期信用评级在AAA级以下的债券，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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	345,714,695.72	323,808,472.41
合计	345,714,695.72	323,808,472.41

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

**6.4.13.2.3 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	6,787,007,065.83	2,714,448,342.52
合计	6,787,007,065.83	2,714,448,342.52

**6.4.13.2.4 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	586,581,991.32	515,711,299.71
AAA以下	-	-
未评级	315,370,347.05	132,656,477.29
合计	901,952,338.37	648,367,777.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

**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2024年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有1,440,076,479.96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%。本期末，本基金前10名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为17.13%，本基金投资组合的平均剩余期限为115天，平均剩余存续期为115天。本基金持有的现金、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符合法律法规的相关要求。

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%。本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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交易对手管理制度：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存款和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 2024年06月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	1,728,312,019.04	197,336,997.60	-	-	-	1,925,649,016.64
交易性金融资产	5,576,533,601.49	2,458,140,498.43	-	-	-	8,034,674,099.92
买入返售金融资产	2,150,942,504.	-	-	-	-	2,150,942,504.

	42					42
应收申购款	-	-	-	-	25,015,766.46	25,015,766.46
资产总计	9,455,788,124.95	2,655,477,496.03	-	-	25,015,766.46	12,136,281,387.44
负债						
卖出回购金融资产款	1,440,351,384.37	-	-	-	-	1,440,351,384.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,278,202.39	3,278,202.39
应付托管费	-	-	-	-	993,394.67	993,394.67
应付销售服务费	-	-	-	-	1,845,485.75	1,845,485.75
应交税费	-	-	-	-	32,040.84	32,040.84
其他负债	-	-	-	-	297,627.57	297,627.57
负债总计	1,440,351,384.37	-	-	-	6,446,751.22	1,446,798,135.59
利率敏感度缺口	8,015,436,740.58	2,655,477,496.03	-	-	18,569,015.24	10,689,483,251.85
上年度末 2023年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	2,878,940,542.16	1,059,299,236.00	-	-	-	3,938,239,778.16
交易性金融资产	2,899,968,674.20	786,655,917.73	-	-	-	3,686,624,591.93
买入返售金融资产	2,365,499,350.16	-	-	-	-	2,365,499,350.16
应收申购款	-	-	-	-	25,360.63	25,360.63
资产总计	8,144,408,566.52	1,845,955,153.73	-	-	25,360.63	9,990,389,080.88
负债						
卖出回购金融资产款	1,094,237,539.68	-	-	-	-	1,094,237,539.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,515,640.26	2,515,640.26
应付托管费	-	-	-	-	762,315.20	762,315.20
应付销售服务费	-	-	-	-	1,903,169.63	1,903,169.63
应交税费	-	-	-	-	6,214.72	6,214.72
其他负债	-	-	-	-	475,981.72	475,981.72
负债总计	1,094,237,539.68	-	-	-	5,663,321.53	1,099,900,861.21
利率敏感度缺口	7,050,171,026.	1,845,955,153.	-	-	-5,637,960.	8,890,488,219.

	84	73		90	67
--	----	----	--	----	----

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率下降25个基点	8,111,391.21	3,619,032.66
	市场利率上升25个基点	-8,086,917.24	-3,610,441.20

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于2024年06月30日，本基金未持有交易性权益类投资(2023年12月31日：同)。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2024年06月30日，本基金未持有交易性权益类投资(2023年12月31日：同)，因此其他价格风险对于本基金净资产无重大影响(2023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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	8,034,674,099.92	3,686,624,591.93
第三层次	-	-
合计	8,034,674,099.92	3,686,624,591.93

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年06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(2023年12月31日：同)。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融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	8,034,674,099.92	66.20
	其中：债券	8,034,674,099.92	66.20
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,150,942,504.42	17.72
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,925,649,016.64	15.87
4	其他各项资产	25,015,766.46	0.21
5	合计	12,136,281,387.44	100.00

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	9.23	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,440,351,384.37	13.47
	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基金资产净值比例的简单平均值；对于货币市场基金，只要其投资的市场（如银行间市场）可交易，即可视为交易日，下同。

## 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%。

## 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	115
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	80

注：投资组合平均剩余期限指交易日的组合平均剩余期限，若报告期末为非交易日，“报告期末投资组合平均剩余期限”项目则列示非交易日的数据。

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

根据本货币市场基金基金合同的约定，其投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过120天。本报告期内，本货币市场基金投资组合平均剩余期限未发生超过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	34.92	13.47
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	11.96	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	15.97	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	2.24	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	47.75	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	112.83	13.47

#### 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

本报告期内，本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未发生超过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	111,559,631.82	1.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	477,917,162.59	4.47
	其中：政策性金融债	477,917,162.59	4.47
4	企业债券	72,703,626.13	0.68
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	585,486,613.55	5.48
7	同业存单	6,787,007,065.83	63.49
8	其他	-	-
9	合计	8,034,674,099.92	75.16
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
1	112389450	23青岛银行CD068	4,000,000	399,156,935. 42	3.73
2	112491218	24南京银行CD005	4,000,000	394,522,873. 88	3.69
3	112414131	24江苏银行CD131	3,000,000	298,756,308. 50	2.79
4	112495070	24宁波银行CD012	3,000,000	298,514,658. 52	2.79
5	230421	23农发21	2,000,000	203,523,885. 04	1.90
6	112420018	24广发银行CD018	2,000,000	199,763,812. 16	1.87
7	112370268	23西安银行CD073	2,000,000	199,447,838. 70	1.87
8	112492681	24杭州银行CD022	2,000,000	199,366,632.	1.87

				13	
9	112480987	24宁波银行CD070	2,000,000	199,171,465. 61	1.86
10	112497518	24重庆农村商行CD 036	2,000,000	198,751,989. 21	1.86

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

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0999%
报告期内偏离度的最低值	0.0524%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0752%

注：表内各项数据均按报告期内的交易日统计。

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内，本货币市场基金投资组合未发生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

本报告期内，本货币市场基金投资组合未发生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前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额净值保持在人民币1.00元。

为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，应按其他公允指标对组合的账面价值进行调整，调整差额确认为“公允价值变动损益”，并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1.00元，可恢复使用摊余成本法估

算公允价值。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

**7.9.2 本基金投资的前十名证券发行主体中，【广发银行股份有限公司】于2023年08月03日收到国家金融监督管理总局出具公开处罚的通报；【杭州银行股份有限公司】于2024年01月09日收到国家金融监督管理总局浙江监管局出具公开处罚的通报；【江苏银行股份有限公司】于2023年08月10日收到国家金融监督管理总局江苏监管局出具公开批评、公开处罚的通报；【南京银行股份有限公司】于2023年08月25日收到国家外汇管理局江苏省分局出具公开处罚的通报；【宁波银行股份有限公司】分别于2023年11月27日、2024年06月14日收到国家金融监督管理总局宁波监管局出具公开处罚的通报；【青岛银行股份有限公司】分别于2023年12月28日、2024年01月02日收到国家金融监督管理总局青岛监管局出具公开处罚的通报；【西安银行股份有限公司】于2023年12月28日收到国家金融监督管理总局陕西监管局出具公开处罚的通报。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。**

### 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	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	25,015,766.46
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	25,015,766.46

### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
天弘现金管家货币A	9,775	8,807.86	3,894,000.15	4.52%	82,202,862.81	95.48%
天弘现金管家货币B	16	116,308,029.66	1,860,928,474.49	100.00%	-	-
天弘现金管家货币C	179	4,832.44	-	-	865,006.10	100.00%
天弘现金管家货币D	13,824	103.34	3.03	0.00%	1,428,544.28	100.00%
天弘现金管家货币E	3,284,889	2,660.72	62,635.58	0.00%	8,740,101,725.41	100.00%
合计	3,308,506	3,230.91	1,864,885,113.25	17.45%	8,824,598,138.60	82.55%

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

## 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	银行类机构	604,297,626.36	5.65%
2	银行类机构	302,431,843.05	2.83%
3	银行类机构	300,000,000.00	2.81%
4	银行类机构	200,783,257.16	1.88%
5	银行类机构	150,658,149.51	1.41%
6	银行类机构	100,716,353.13	0.94%
7	保险类机构	100,137,923.86	0.94%
8	基金类机构	50,671,232.74	0.47%
9	保险类机构	10,577,152.18	0.10%
10	其他机构	10,076,990.10	0.09%

注：上述持有人类别严格按照XBRL模板中“银行类机构、保险类机构、券商类机构、信托类机构、基金类机构、其他机构、个人”进行分类。

### 8.3 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	天弘现金管家货币A	7,743.22	0.01%
	天弘现金管家货币B	-	-
	天弘现金管家货币C	206.08	0.02%
	天弘现金管家货币D	605.27	0.04%
	天弘现金管家货币E	99,781.86	0.00%
	合计	108,336.43	0.00%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	天弘现金管家货币 A	0
	天弘现金管家货币 B	0
	天弘现金管家货币 C	0
	天弘现金管家货币 D	0
	天弘现金管家货币 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	天弘现金管家货币 A	0
	天弘现金管家货币 B	0
	天弘现金管家货币 C	0
	天弘现金管家货币 D	0
	天弘现金管家货币 E	0
	合计	0

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘现金 管家货币A	天弘现金 管家货币B	天弘现金 管家货币C	天弘现金 管家货币D	天弘现金 管家货币E
基金合同生效日(2 012年06月20日)基 金份额总额	576,166,94 0.77	658,270,31 6.20	-	-	-
本报告期期初基金 份额总额	87,837,848. 29	37,513,241. 81	1,197,808.1 0	1,389,317.8 3	8,762,550,0 03.64
本报告期基金总申	53,239,016.	6,833,327,5	9,228.69	889,998.54	35,448,647,

购份额	20	32.17			719.84
减：本报告期基金 总赎回份额	54,980,001. 53	5,009,912.2 99.49	342,030.69	850,769.06	35,471,033, 362.49
本报告期期末基金 份额总额	86,096,862. 96	1,860,928.4 74.49	865,006.10	1,428,547.3 1	8,740,164.3 60.99

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，聂挺进先生担任公司副总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，本基金的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

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

### 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，本基金管理人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

#### 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，本基金托管人的托管业务部门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

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	
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-

申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；具有较强的综合服务能力，能及时、全面提供高质量的关于宏观策略、行业、资本市场、个股分析的研究服务及丰富全面的信息咨询服务；具有较强的证券交易服务能力，能够提供安全、便捷、优质的证券交易服务及合理的佣金费率。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：申港证券深圳交易单元、中泰证券上海交易单元。

### 10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过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	天弘基金管理有限公司关于天弘现金管家货币市场基金B类基金份额对机构投资者恢复申购及转换业务、取消	中国证监会规定媒介	2024-01-16

	单个基金账户持有限额并暂停大额申购及转换转入业务的公告		
2	天弘现金管家货币市场基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2024-01-16
3	天弘现金管家货币市场基金2023年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2024-01-22
4	天弘基金管理有限公司关于天弘现金管家货币市场基金B类基金份额调整机构投资者大额申购、转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2024-02-03
5	天弘基金将严格落实《证监会新闻发言人就“两融”融券业务有关情况答记者问》相关要求	中国证监会规定媒介	2024-02-06
6	天弘现金管家货币市场基金2023年年度报告	中国证监会规定媒介	2024-03-29
7	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2024-03-30
8	天弘现金管家货币市场基金2024年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2024-04-22
9	天弘基金管理有限公司关于天弘现金管家货币市场基金B类基金份额调整机构投资者大额申购及转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2024-06-11
10	天弘现金管家货币市场基金（A类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2024-06-28
11	天弘现金管家货币市场基金（B类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2024-06-28

12	天弘现金管家货币市场基金（C类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2024-06-28
13	天弘现金管家货币市场基金（D类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2024-06-28
14	天弘现金管家货币市场基金（E类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2024-06-28

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过本基金总份额20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘现金管家货币市场基金募集的文件
- 2、天弘现金管家货币市场基金基金合同
- 3、天弘现金管家货币市场基金托管协议
- 4、天弘现金管家货币市场基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

### 12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的住所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：[www.thfund.com.cn](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司  
二〇二四年八月三十日