

华润元大现金收益货币市场基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：华润元大基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 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 1 月 1 日起至 6 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 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 11 |
| 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..... | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| § 5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表..... | 14 |
| 6.2 利润表..... | 15 |
| 6.3 净资产变动表..... | 16 |
| 6.4 报表附注..... | 18 |
| § 7 投资组合报告 | 35 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 35 |
| 7.2 债券回购融资情况..... | 36 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限..... | 36 |
| 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..... | 37 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 37 |
| 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..... | 37 |
| 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..... | 37 |
| 7.8 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..... | 37 |
| 7.9 投资组合报告附注..... | 37 |
| § 8 基金份额持有人信息..... | 38 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 38 |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况..... | 38 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 39 |
| 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..... | 39 |
| § 9 开放式基金份额变动..... | 39 |
| § 10 重大事件揭示..... | 40 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 40 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 40 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 40 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况..... | 42 |
| 10.9 其他重大事件..... | 42 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 43 |
| 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..... | 43 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 43 |
| § 12 备查文件目录..... | 43 |
| 12.1 备查文件目录..... | 43 |
| 12.2 存放地点..... | 44 |
| 12.3 查阅方式..... | 44 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金名称 | 华润元大现金收益货币市场基金 | |
| 基金简称 | 华润元大现金收益货币 | |
| 基金主代码 | 000324 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2013 年 10 月 29 日 | |
| 基金管理人 | 华润元大基金管理有限公司 | |
| 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 | 22,655,757.66 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华润元大现金收益货币 A | 华润元大现金收益货币 B |
| 下属分级基金的交易代码 | 000324 | 000325 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 12,655,757.66 份 | 10,000,000.00 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在保持低风险性和高流动性的前提下，力争获得较高于业绩比较基准的投资收益。 |
| 投资策略 | 整体资产配置方面，本基金根据宏观经济形势、央行货币政策、货币市场的资金供求状况等因素，对短期利率走势进行综合判断，并根据前述判断形成的利率预期动态调整基金投资组合的平均剩余期限。在类别资产配置上，根据整体策略要求，决定组合中类别资产的配置内容和各类别投资的比例。在个券选择层面，首先将考虑安全性，优先选择高信用等级的债券品种以规避违约风险。 |
| 业绩比较基准 | 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，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|----------------|---------------------|
| 名称 | 华润元大基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 刘豫皓 |
| | 联系电话 | 0755-88399008 |
| | 电子邮箱 | kf@cryuantafund.com |
| 客户服务电话 | 4000-1000-89 | 95588 |
| 传真 | 0755-88399045 | 010-66105798 |
| 注册地址 | 深圳市前海深港合作区兴海大道 | 北京市西城区复兴门内大街 55 |

| | | |
|-------|--|-------------------|
| | 3040 号前海世茂金融中心二期 1 栋 2103-05 单元 | 号 |
| 办公地址 | 深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂金融中心二期 1 栋 2103-05 单元 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | 518066 | 100140 |
| 法定代表人 | 胡昊 | 廖林 |

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 | http://www.cryuantafund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的办公场所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------|--|
| 注册登记机构 | 华润元大基金管理有限公司 | 深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂金融中心二期 1 栋 2103-2105 单元 |

§ 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 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) | |
|-------------------|-------------------------------------|---------------|
| | 华润元大现金收益货币 A | 华润元大现金收益货币 B |
| 本期已实现收益 | 99,148.45 | 55,659.40 |
| 本期利润 | 99,148.45 | 55,659.40 |
| 本期净值收益率 | 0.6120% | 0.6656% |
| 3.1.2 期末数 据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |
| | 期末基金资产净值 | 12,655,757.66 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 |
| 3.1.3 累计期 末指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |
| | 累计净值收益率 | 30.4557% |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，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或交易基金的各项费用。

3、本基金的收益分配方式为按日结转份额。

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

华润元大现金收益货币 A

| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------------|---------|
| 过去一个月 | 0.0914% | 0.0001% | 0.1110% | 0.0000% | - 0.0196% | 0.0001% |
| 过去三个月 | 0.2788% | 0.0003% | 0.3366% | 0.0000% | - 0.0578% | 0.0003% |
| 过去六个月 | 0.6120% | 0.0004% | 0.6732% | 0.0000% | - 0.0612% | 0.0004% |
| 过去一年 | 1.1749% | 0.0008% | 1.3537% | 0.0000% | - 0.1788% | 0.0008% |
| 过去三年 | 3.7775% | 0.0011% | 4.0537% | 0.0000% | - 0.2762% | 0.0011% |
| 自基金合同生效起至今 | 30.4557% | 0.0046% | 14.4173% | 0.0000% | 16.0384% | 0.0046% |

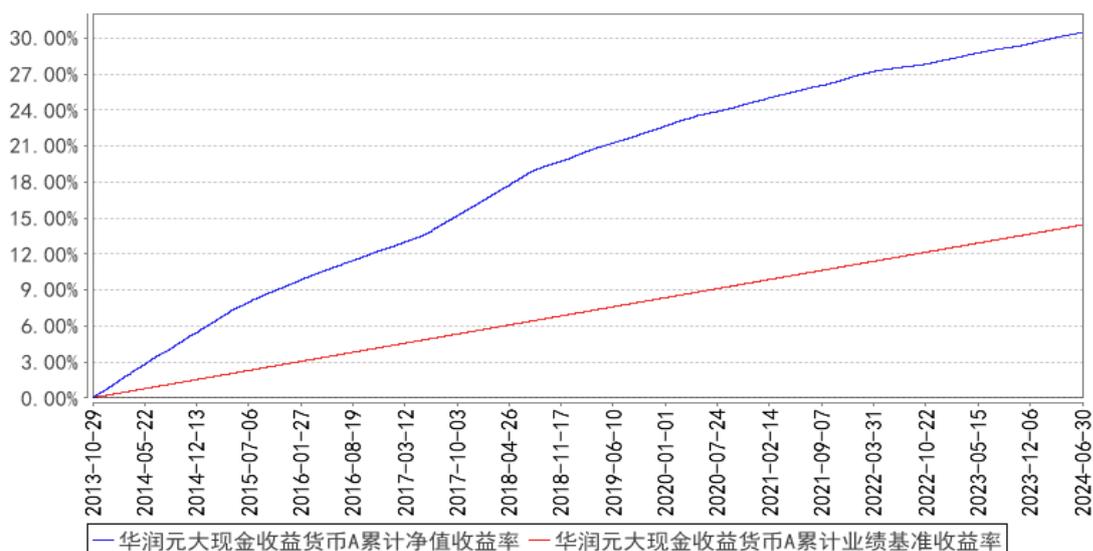
华润元大现金收益货币 B

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

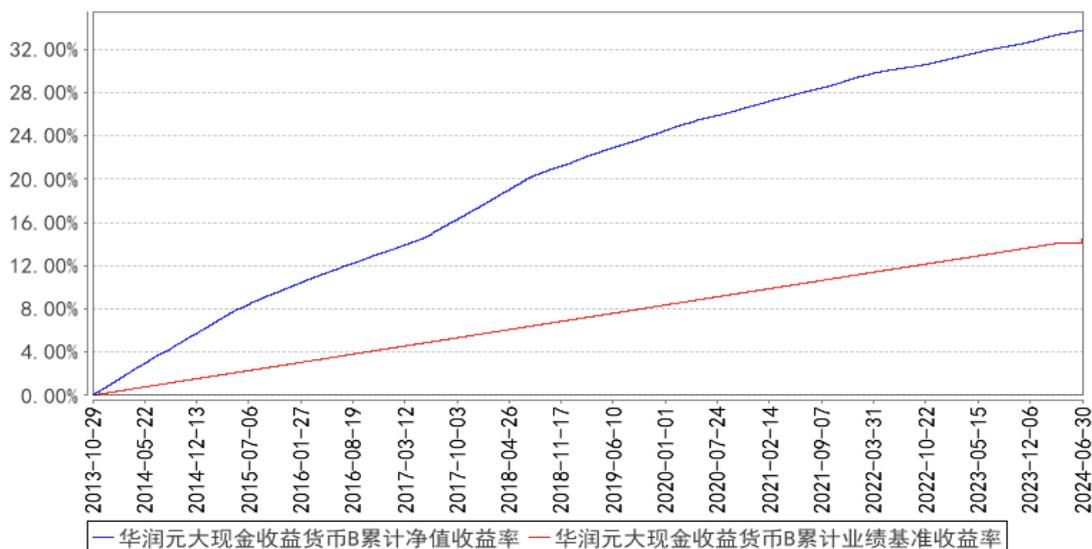
| | 值收益 率① | 收益率标 准差② | 基准收益 率③ | 收益率标准差 ④ | | |
|----------------|--------------|-------------|------------|-------------|------------------|-------------|
| 过去一个月 | 0.0934% | 0.0003% | 0.3588% | 0.0000% | - 0.2654 % | 0.0003 % |
| 过去三个月 | 0.2808% | 0.0003% | 0.3588% | 0.0000% | - 0.0780 % | 0.0003 % |
| 过去六个月 | 0.6702% | 0.0007% | 0.6732% | 0.0000% | - 0.0030 % | 0.0007 % |
| 过去一年 | 1.3559% | 0.0008% | 1.3537% | 0.0000% | 0.0022 % | 0.0008 % |
| 过去三年 | 4.4631% | 0.0011% | 4.0537% | 0.0000% | 0.4094 % | 0.0011 % |
| 自基金合同生效 起至今 | 33.7535 % | 0.0046% | 14.4173% | 0.0000% | 19.336 2% | 0.0046 % |

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

华润元大现金收益货币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



华润元大现金收益货币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



§ 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

华润元大基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2012】1746号文批准，于2013年1月17日完成工商登记注册，总部位于深圳，注册资本6亿元人民币。公司由华润深国投信托有限公司、华润金控投资有限公司、台湾元大证券投资信托股份有限公司共同发起设立，占股比例分别为51%、24.5%、24.5%。

截至2024年6月30日，本基金管理人共管理十五只基金产品：华润元大富时中国A50指数型证券投资基金、华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金、华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金、华润元大量化优选混合型证券投资基金、华润元大核心动力混合型证券投资基金、华润元大现金收益货币市场基金、华润元大现金货币市场基金、华润元大稳健收益债券型证券投资基金、华润元大润鑫债券型证券投资基金、华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金、华润元大润泽债券型证券投资基金、华润元大润禧39个月定期开放债券型证券投资基金、华润元大润丰纯债债券型证券投资基金、华润元大润享三个月定期开放债券型证券投资基金、华润元大泓远利率债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------|-----------------|------|--------|--------------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 尹华 | 本基金的 | 2022年7月 | - | 12年 | 曾任信达澳银基金管理有限公司、华润元 |

| | | | | | | |
|-----|-----------|----------------|-----------------|------|--|--|
| 龙 | 基金经理 | 月 20 日 | | | | 大基金管理有限公司高级债券研究员、基金经理。2021 年加入华润元大基金管理有限公司，现担任固定收益部负责人、高级基金经理。目前担任华润元大现金收益货币市场基金、华润元大现金货币基金、华润元大润鑫债券型证券投资基金、华润元大润丰纯债债券型证券投资基金、华润元大润享三个月定期开放债券型证券投资基金、华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金、华润元大泓远利率债券型证券投资基金基金经理。 |
| 程涛涛 | 本基金基金经理 | 2023 年 9 月 1 日 | - | 6 年 | | 曾任安信证券资产管理部债券交易员、信达澳亚基金债券交易员。2022 年加入华润元大基金管理有限公司，现担任固定收益部基金经理。目前担任华润元大现金收益货币市场基金、华润元大现金货币基金、华润元大稳健收益债券型证券投资基金、华润元大润泽债券型证券投资基金、华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华润元大润享三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。 |
| 金兴健 | 原本基金的基金经理 | 2021 年 4 月 9 日 | 2024 年 6 月 19 日 | 14 年 | | 曾任宝钢集团财务公司资金运用部投资经理、部门经理；华安基金管理有限公司财富管理部投资经理；华安未来资产管理有限公司业务发展部高级项目经理。2017 年加入华润元大基金管理有限公司。2024 年 6 月 19 日起不再担任华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华润元大润鑫债券型证券投资基金、华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金、华润元大稳健收益债券型证券投资基金、华润元大现金收益货币市场基金、华润元大现金货币基金、华润元大润丰纯债债券型证券投资基金基金经理。 |

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内无上述兼任情况。

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循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规及公司内部制度关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，未发生违反公平交易制度的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。基金管理人管理的所有投资组合未存在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的 5% 的情形。

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，中国经济运行总体平稳。上半年 GDP 超 61 万亿，同比增长 5.0%。分产业看，第一产业同比增长 3.5%，第二产业增长 5.8%，第三产业增长 4.6%。分季度看，一季度同比增长 5.3%，二季度增长 4.7%。

分项来看，拉动经济的三驾马车中，货物出口同比增长 6.9%；社会消费品零售总额同比增长 3.7%；固定资产投资同比增长 3.9%。

消费方面，必选消费品表现好于可选消费品，低货值商品表现好于高货值商品，农村消费表现好于城镇消费，汽车和地产相关消费是主要拖累项。

投资方面，国有控股投资增速 6.8%，民间投资增速 0.1%；第二产业投资增速较快，同比增速为 12.6%；第一产业同比增速 3.1%；受地产投资拖累等影响，第三产业投资同比增速仅-0.2%。

分析上半年经济数据，国内总需求较为疲软，拖累了整体经济表现。为提振内需，相关部门密集出台了稳增长政策，且相较往年，政策出台有明显前置的趋势。例如一季度初，央行即宣布全面降准 0.5 个基点，释放万亿长期流动性。

金融数据方面，一季度社会融资规模增量累计为 12.93 万亿元，虽比上年同期少 1.61 万亿元，但总量依然处于较高水平。然而在流动性宽松的背景下，资金套利和资金空转的现象开始增加，社融数据可能不足以反映实体经济的真实融资需求。4 月央行禁止银行手工补息后，急剧缩水的社融数据可能才是实体经济真实融资需求的写照。

金融市场对总需求疲软和货币当局稳增长货币政策的预期在债券收益率的走势中得到体现；宽松的流动性和实体经济融资需求的减弱也起到推波助澜的作用。整个一季度，各期限国债收益率即进入下行快车道。30 年国债利率下行幅度超过 40bps，3 年国债利率下行幅度超过 30bps。进入二季度，央行多次表达对于长端和超长端债券风险的担忧，加上部分机构获利了结的需求，长

端收益率才停止单边下行走势，进入区间震荡走势。而短端依然高歌猛进，3 年国债利率在二季度又继续下行超过 20bps。

货币市场收益率的走势虽一定程度上有其自身规律，但整体上无法偏离大趋势。忽略短期扰动引起的收益率波动，货币市场收益率基本与短端国债收益率走势如出一辙。股份行 1 年期同业存单一级发行利率在上半年下行幅度超过 45bps，3M 存单下行幅度则超过 55bps。

因规模较小，本基金上半年投资策略优先保证流动性，持仓全部为利率债或现金。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期华润元大现金收益货币 A 的基金份额净值收益率为 0.6120%，同期业绩比较基准收益率为 0.6732%，本报告期华润元大现金收益货币 B 的基金份额净值收益率为 0.6702%，同期业绩比较基准收益率为 0.6732%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年的经济数据显示，房地产依然是宏观经济重要拖累项。尽管中央和地方纷纷出台了为数众多的稳地产政策，但目前均未从根本上扭转房地产市场的走势。目前房地产市场尚难言见底。展望下半年，为防止房地产市场继续下坠，更多稳地产相关政策可能陆续出台。

目前金融市场投资面临资产荒，根本原因在于大量资金难以真正流入实体经济，转而在金融市场追逐有限存量资产。资金从金融向实体传导的不畅，一方面是由于目前实体真实融资需求较疲软，另一方面是真实贷款利率依然偏高。继续降低真实贷款利率有利于打开融资需求空间，但银行所面临的严峻息差压力使贷款利率相对刚性，难以下调。下半年预计会有相关政策出台，稳步调降存款利率，缓解银行息差压力，为继续调降贷款利率打开通道。另外，预计会有不止一次的降准或降息操作，使市场收益率曲线继续下移，引导银行更多地向实体经济投放资金。

预计下半年的投资策略与上半年保持一致。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括督察长、投资风险负责人、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。该机构成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。同时，根据基金管理公

司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的约定，本基金根据每日基金收益情况，以基金每万份已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。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。本报告期内，本基金 A 类份额已实现收益为 99,148.45 元，每日分配，每日支付，合计分配 99,148.45 元，B 类份额已实现收益为 55,659.40 元，每日分配，每日支付，合计分配 55,659.40 元，符合本基金基金合同的约定。

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，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 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，本基金托管人在对华润元大现金收益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，华润元大现金收益货币市场基金的管理人——华润元大基金管理有限公司在华润元大现金收益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，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

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

本托管人依法对华润元大基金管理有限公司编制和披露的华润元大现金收益货币市场基金本年度报告中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华润元大现金收益货币市场基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 25,574,518.15 | 15,693,886.89 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | - | 19,978,207.41 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | 19,978,207.41 |
| 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 | - | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | 11.00 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 25,574,518.15 | 35,672,105.30 |
| 负债和净资产 | | | |
| 负债： | | | |
| 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 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 90,065.57 | - |

| | | | |
|-------------|----------|---------------|---------------|
| 应付管理人报酬 | | 3,617.34 | 9,245.18 |
| 应付托管费 | | 1,096.13 | 2,801.58 |
| 应付销售服务费 | | 2,609.22 | 3,969.17 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | 2,427.75 | 5,729.88 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 2,818,944.48 | 2,830,177.10 |
| 负债合计 | | 2,918,760.49 | 2,851,922.91 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 22,655,757.66 | 32,820,182.39 |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | - | - |
| 净资产合计 | | 22,655,757.66 | 32,820,182.39 |
| 负债和净资产总计 | | 25,574,518.15 | 35,672,105.30 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 22,655,757.66 份，其中华润元大现金收益货币 A 类基金份额净值人民币 1.0000 元，份额总额 12,655,757.66 份；华润元大现金收益货币 B 类基金份额净值人民币 1.0000 元，份额总额 10,000,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华润元大现金收益货币市场基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 254,339.36 | 438,221.97 |
| 1. 利息收入 | | 145,347.72 | 144,695.06 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 137,891.20 | 1,413.85 |
| 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 | | 7,456.52 | 143,281.21 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 108,991.64 | 293,526.91 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 108,991.64 | 293,526.91 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.16 | - | - |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |

| | | | |
|---------------------------------|------------|------------|------------|
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列) | 6.4.7.20 | - | - |
| 4. 汇兑收益(损失以 “-”号填列) | | - | - |
| 5. 其他收入(损失以 “-”号填列) | 6.4.7.21 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 99,531.51 | 147,914.63 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 38,260.21 | 69,698.45 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 11,593.82 | 21,120.79 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 20,431.00 | 26,588.53 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资 产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 29,246.48 | 30,506.86 |
| 三、利润总额(亏损总 额以“-”号填列) | | 154,807.85 | 290,307.34 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以 “-”号填列) | | 154,807.85 | 290,307.34 |
| 五、其他综合收益的税 后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 154,807.85 | 290,307.34 |

6.3 净资产变动表

会计主体：华润元大现金收益货币市场基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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 | 32,820,182.39 | - | - | 32,820,182.39 |
| 二、本期期初净 资产 | 32,820,182.39 | - | - | 32,820,182.39 |
| 三、本期增减变 动额(减少以“-” | -10,164,424.73 | - | - | -10,164,424.73 |

| | | | | |
|--|--|--------|-------------|----------------|
| 号填列) | | | | |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 154,807.85 | 154,807.85 |
| (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) | -10,164,424.73 | - | - | -10,164,424.73 |
| 其中：1. 基金申购款 | 15,854,355.76 | - | - | 15,854,355.76 |
| 2. 基金赎回款 | -26,018,780.49 | - | - | -26,018,780.49 |
| (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) | - | - | -154,807.85 | -154,807.85 |
| 四、本期期末净资产 | 22,655,757.66 | - | - | 22,655,757.66 |
| 项目 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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 | 43,365,763.57 | - | - | 43,365,763.57 |
| 二、本期期初净资产 | 43,365,763.57 | - | - | 43,365,763.57 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -2,885,033.78 | - | - | -2,885,033.78 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 290,307.34 | 290,307.34 |
| (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) | -2,885,033.78 | - | - | -2,885,033.78 |
| 其中：1. 基金申购款 | 28,614,811.00 | - | - | 28,614,811.00 |
| 2. 基金赎回款 | -31,499,844.78 | - | - | -31,499,844.78 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净 | - | - | -290,307.34 | -290,307.34 |

| | | | | |
|--------------------|---------------|---|---|---------------|
| 资产变动（净资产减少以“-”号填列） | | | | |
| 四、本期期末净资产 | 40,480,729.79 | - | - | 40,480,729.79 |

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：

| | | |
|------------|------------|------------|
| <u>江先达</u> | <u>张彦军</u> | <u>张彦军</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 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华润元大现金收益货币市场基金(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[2013]1063 号《关于核准华润元大现金收益货币市场基金募集的批复》核准,由华润元大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《华润元大现金收益货币市场基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次募集期间为 2013 年 10 月 14 日至 2013 年 10 月 25 日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 785,900,799.00 元,经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2013)验字第 61032987_H04 号验资报告。经向中国证监会备案,《华润元大现金收益货币市场基金基金合同》于 2013 年 10 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 785,946,367.22 份基金份额,其中认购资金利息折合 45,568.22 份基金份额。本基金的基金管理人为华润元大基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大现金收益货币市场基金基金合同》的有关规定本基金投资范围为现金、通知存款、短期融资券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、1 年以内(含 1 年)的银行定期存款、大额单、期限在 1 年以内(含 1 年)的债券回购、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券、期限在 1 年以内(含 1 年)的中央银行票据(以下简称“央行票据”)、中国证监会、人民银行认可的其它具有良好流动性货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体

会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金报告期所采用的会计政策、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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

(1) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券

取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(2) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|----|------------------------|

| | |
|----------------|---------------|
| 活期存款 | 25,574,518.15 |
| 等于：本金 | 25,565,251.09 |
| 加：应计利息 | 9,267.06 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 25,574,518.15 |

6.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末未持有交易性金融资产。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

截止本报告期末，本基金未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

截止本报告期末，本基金未持有黄金衍生品。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

截至本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

截至本报告期末，本基金未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

截至本报告期末，本基金未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

截至本报告期末，本基金未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

截止本报告期末，本基金未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

截止本报告期末，本基金未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

截止本报告期末，本基金未计提其他权益工具投资减值准备。

6.4.7.8 其他资产

截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | - |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提审计费 | 9,944.48 |
| 预提账户维护费 | 9,000.00 |
| 其他 | 2,800,000.00 |
| 合计 | 2,818,944.48 |

注：其他为本基金收到的基金管理人以自有资金为本基金垫付的资金，用以弥补本基金可能发生的潜在损失。

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华润元大现金收益货币 A

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|----|----------------------------|
|----|----------------------------|

| | 基金份额（份） | 账面金额 |
|---------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 17,920,422.99 | 17,920,422.99 |
| 本期申购 | 5,797,117.68 | 5,797,117.68 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -11,061,783.01 | -11,061,783.01 |
| 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 | 12,655,757.66 | 12,655,757.66 |

华润元大现金收益货币 B

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 14,899,759.40 | 14,899,759.40 |
| 本期申购 | 10,057,238.08 | 10,057,238.08 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -14,956,997.48 | -14,956,997.48 |
| 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 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 |

注：申购含红利再投、转换入和因升降级等导致的强制调增份额/金额，赎回含转换出和因升降级等导致的强制调减份额/金额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华润元大现金收益货币 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|------------|-------|------------|
| 上年度末 | - | - | - |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 99,148.45 | - | 99,148.45 |
| 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 | -99,148.45 | - | -99,148.45 |
| 本期末 | - | - | - |

华润元大现金收益货币 B

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|------|-------|-------|---------|
| 上年度末 | - | - | - |

| | | | |
|----------------|------------|---|------------|
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 55,659.40 | - | 55,659.40 |
| 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 | -55,659.40 | - | -55,659.40 |
| 本期末 | - | - | - |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 137,891.20 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 137,891.20 |

6.4.7.14 股票投资收益

不适用。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 108,607.38 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 384.26 |
| 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 | 108,991.64 |

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 40,877,259.54 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 40,001,880.74 |
| 减：应计利息总额 | 874,994.54 |

| | |
|----------|--------|
| 减：交易费用 | - |
| 买卖债券差价收入 | 384.26 |

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

不适用。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

不适用。

6.4.7.19 股利收益

不适用。

6.4.7.20 公允价值变动收益

不适用。

6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期未计提信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 9,944.48 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 汇款费 | 702.00 |
| 其他 | 600.00 |
| 合计 | 29,246.48 |

注：其他为上清所查询费 600 元。

6.4.7.24 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

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，本基金无需要作说明的重大或有事项。

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，本基金无需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

本基金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 |
|------------------------|-----------------------|
| 华润元大基金管理有限公司 | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |

| | |
|--------------------|-------------------------|
| 华润深国投信托有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 元大证券投资信托股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 华润金控投资有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 深圳华润元大资产管理有限公司 | 基金管理人的子公司 |
| 珠海华润银行股份有限公司 | 与基金管理人受同一实际控制的公司、基金销售机构 |
| 国信证券股份有限公司(“国信证券”) | 基金管理人控股股东的联营公司 |

注：以下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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

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

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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1月1日至2024年6月30日 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 38,260.21 | 69,698.45 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 11,972.15 | 20,157.03 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 26,288.06 | 49,541.42 |

注：(1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.33% 的年费率计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.33%÷当年天数。

(2) 根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人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，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 11,593.82 | 21,120.79 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷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 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | |
|----------------|--|--------------|-----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 华润元大现金收益货币 A | 华润元大现金收益货币 B | 合计 |
| 华润元大基金管理有限公司 | 10,342.55 | - | 10,342.55 |
| 中国工商银行 | 8,250.83 | 350.74 | 8,601.57 |
| 珠海华润银行 | 85.26 | - | 85.26 |
| 合计 | 18,678.64 | 350.74 | 19,029.38 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 华润元大现金收益货币 A | 华润元大现金收益货币 B | 合计 |
| 华润元大基金管理有限公司 | 11,425.15 | 361.07 | 11,786.22 |
| 中国工商银行 | 9,245.29 | 731.16 | 9,976.45 |
| 珠海华润银行 | 93.71 | - | 93.71 |
| 合计 | 20,764.15 | 1,092.23 | 21,856.38 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日对应级别基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华润元大基金管理有限公司，再由华润元大基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A 级基金份额和 B 级基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25% 和 0.01%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日该级别基金资产净值 × 对应销售服务费年费率 / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2024年1月1日至2024年6月 30日 | | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
|--------|--------------------------------|------------|---------------------------------|----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行 | 25,574,518.15 | 137,891.20 | 353,320.38 | 1,413.85 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行间同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 华润元大现金收益货币 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 |
| 100,871.90 | - | -1,723.45 | 99,148.45 | - |
| 华润元大现金收益货币 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 |
| 57,238.08 | - | -1,578.68 | 55,659.40 | - |

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/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

不适用。

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，本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由涉及金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、监事会、董事会下设风险控制委员会，督察长、管理层下设风险管理委员会，合规与风险管理部和各业务部门构成的四级风险管理架构体系。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于本期末，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（上年度末：同）。

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6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | - | 19,978,207.41 |

| | | |
|----|---|---------------|
| 合计 | - | 19,978,207.41 |
|----|---|---------------|

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

（2）未评级债券包括债券期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注中列示的卖出回购金融资产款余

额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因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。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2024 年 6 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 | 25,574,518.15 | - | - | - | - | 25,574,518.15 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - |
| 债权投资 | - | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 25,574,518.15 | - | - | - | - | 25,574,518.15 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | 90,065.57 | 90,065.57 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 3,617.34 | 3,617.34 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 1,096.13 | 1,096.13 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------------------------|---------------|----------|-------|-------|---------------|---------------|
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 2,609.22 | 2,609.22 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | 2,427.75 | 2,427.75 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | 2,818,944.48 | 2,818,944.48 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 2,918,760.49 | 2,918,760.49 |
| 利率敏感度缺口 | 25,574,518.15 | - | - | - | -2,918,760.49 | 22,655,757.66 |
| 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 | 15,693,886.89 | - | - | - | - | 15,693,886.89 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | 19,978,207.41 | - | - | - | - | 19,978,207.41 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - |
| 债权投资 | - | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | 11.00 | 11.00 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 35,672,094.30 | - | - | - | 11.00 | 35,672,105.30 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 9,245.18 | 9,245.18 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 2,801.58 | 2,801.58 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - | - |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 3,969.17 | 3,969.17 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | 5,729.88 | 5,729.88 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | 2,830,177.10 | 2,830,177.10 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 2,851,922.91 | 2,851,922.91 |
| 利率敏感度缺口 | 35,672,094.30 | - | - | - | -2,851,911.91 | 32,820,182.39 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

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 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |

| | 动 | 本期末 (2024 年 6 月 30 日) | 上年度末 (2023 年 12 月 31 日) |
|----------------|---|-----------------------|-------------------------|
| | | 市场利率减少 25 个基准点 | - |
| 市场利率增加 25 个基准点 | - | -2,756.49 | |

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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | |
|---------------|------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | - | - | 19,978,207.41 | 60.87 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | - | - | 19,978,207.41 | 60.87 |

注：本期末本基金未持有交易性权益类投资（上年度末：同），因此当市场价格发生合理、可能的变动时，对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | - | 19,978,207.41 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | - | 19,978,207.41 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证 券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 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 | 25,574,518.15 | 100.00 |
| 4 | 其他各项资产 | - | - |
| 5 | 合计 | 25,574,518.15 | 100.00 |

7.2 债券回购融资情况

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%。

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 | 0 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 41 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 0 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产 净值的比例 (%) | 各期限负债占基金资产 净值的比例 (%) |
|----|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 1 | 30 天以内 | 112.84 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | - | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | - | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | - | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |

| | | | |
|---|----------------------------|--------|---|
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | - | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 112.84 | - |

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

报告期内本基金未出现投资组合平均剩余续存期超过 240 天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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 | 0.0338% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0017% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0084% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未出现负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按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

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

本基金所持有的债券采用摊余成本法进行估值，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价或折价，在其剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

本基金通过每日分红使基金份额净值维持在 1.00 元。

7.9.2 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

本报告期内本基金投资的前十名证券中没有出现发行主体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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

无。

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，投资组合报告中数字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 (%) |
| 华润元大现金收益货币 A | 828 | 15,284.73 | 5,083,489.96 | 40.17 | 7,572,267.70 | 59.83 |
| 华润元大现金收益货币 B | 1 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | 100.00 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 829 | 27,329.02 | 15,083,489.96 | 66.58 | 7,572,267.70 | 33.42 |

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）。

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 | 信托类机构 | 10,000,000.00 | 44.14 |
| 2 | 其他机构 | 2,530,140.39 | 11.17 |
| 3 | 其他机构 | 2,419,045.57 | 10.68 |
| 4 | 个人 | 1,426,797.23 | 6.30 |
| 5 | 个人 | 254,099.31 | 1.12 |
| 6 | 个人 | 250,232.36 | 1.10 |
| 7 | 个人 | 240,292.99 | 1.06 |
| 8 | 个人 | 198,146.50 | 0.87 |
| 9 | 个人 | 194,547.10 | 0.86 |
| 10 | 个人 | 164,221.69 | 0.72 |

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 | 华润元大现金收益货币 A | 2.18 | 0.0000 |
| | 华润元大现金收益货币 B | 0.00 | 0.0000 |
| | 合计 | 2.18 | 0.0000 |

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 华润元大现金收益货币 A | 0 |
| | 华润元大现金收益货币 B | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 华润元大现金收益货币 A | 0 |
| | 华润元大现金收益货币 B | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华润元大现金收益货币 A | 华润元大现金收益货币 B |
|---------------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日（2013 年 10 月 29 日）基金份额总额 | 384,791,572.53 | 401,154,794.69 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 17,920,422.99 | 14,899,759.40 |
| 本报告期基金总申购份额 | 5,797,117.68 | 10,057,238.08 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 11,061,783.01 | 14,956,997.48 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 12,655,757.66 | 10,000,000.00 |

注：注：本基金总申购份额含红利再投、转换入份额和因份额升降级等导致的强制调增份额，总

赎回份额含转换出份额和因份额升降级等导致的强制调减份额。

§ 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，本基金管理人发生重大人事变动如下：2024 年 3 月 7 日召开了 2024 年第一次临时股东会、第四届董事会第十七次临时会议，选举胡昊先生担任董事长职务，费凡先生不再担任董事长职务；2024 年 3 月 7 日和 2024 年 3 月 20 日分别召开了 2024 年第一次临时股东会和第四届监事会第三次会议，选举吴艳女士担任公司监事、监事会主席，肖震宇先生不再担任公司监事、监事会主席。2024 年 5 月 27 日召开了第四届董事会第十八次临时会议，周明先生不再担任市场负责人职务。上述变更已按照规定报相关监管机构备案。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计的会计师事务所。本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

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

管理人及其高级管理人员本报告期内未发生受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|-----|------|-----------|----|
|------|-----|------|-----------|----|

| | 元数量 | 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 (%) | |
|------|-----|------|------------------|----|----------------|---|
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需
要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2、选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。本基金本报告期内租用的基金专用交易单元未发生变化。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 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 (%) |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过 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 | 华润元大基金管理有限公司 2023 年第 4 季度报告提示性公告 | 基金管理人网站 | 2024 年 1 月 19 日 |
| 2 | 华润元大现金收益货币市场基金 2023 年第 4 季度报告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2024 年 1 月 19 日 |
| 3 | 关于提醒投资者防范不法分子冒用本公司名义从事诈骗活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 | 2024 年 2 月 26 日 |
| 4 | 华润元大基金管理有限公司关于董事长变更的公告 | 基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2024 年 3 月 9 日 |
| 5 | 华润元大基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2024 年 3 月 29 日 |
| 6 | 华润元大现金收益货币市场基金 2023 年年度报告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2024 年 3 月 29 日 |
| 7 | 华润元大基金管理有限公司关于网上交易机构版上线公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2024 年 4 月 1 日 |
| 8 | 华润元大基金管理有限公司上海分公司营业场所变更的公告 | 基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2024 年 4 月 11 日 |
| 9 | 华润元大基金管理有限公司关于暂停网站直销平台运营及维护服务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 | 2024 年 4 月 15 日 |
| 10 | 华润元大现金收益货币市场基金 2024 年第 1 季度报告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2024 年 4 月 22 日 |
| 11 | 华润元大基金管理有限公司 2024 年第 1 季度报告提示性公告 | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电 | 2024 年 4 月 22 日 |

| | | | |
|----|----------------------------------|---------------------------|-----------------|
| | | 子披露网站 | |
| 12 | 华润元大基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2024 年 5 月 29 日 |
| 13 | 华润元大现金收益货币市场基金基金经理变更公告 | 基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2024 年 6 月 20 日 |
| 14 | 华润元大现金收益货币市场基金招募说明书（2024 年第 1 号） | 中国证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2024 年 6 月 24 日 |
| 15 | 华润元大现金收益货币市场基金产品资料概要更新 | 基金管理人网站、证监会基金电子披露网站 | 2024 年 6 月 24 日 |

§ 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|----------------|----------------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |
| 机构 | 1 | 2024 年 6 月 28 日至 2024 年 6 月 30 日 | 0.00 | 15,000,000.00 | 5,000,000.00 | 10,000,000.00 | 44.1389 |
| 个人 | 1 | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 25 日 | 14,899,759.40 | 59,793.39 | 14,956,997.48 | 2,555.31 | 0.0113 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。 | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准本基金募集的批复；
- 2、本基金基金合同；
- 3、本基金托管协议；
- 4、本报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

基金持有人可在办公时间到基金管理人和基金托管人的办公场所或网站免费查阅。

华润元大基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日