

中金现金管家货币市场基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 30 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 2024 年 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..... | 6 |
| §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..... | 10 |
| 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..... | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 11 |
| 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..... | 12 |
| 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..... | 12 |
| §5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 12 |
| 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..... | 12 |
| 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） | 13 |
| 6.1 资产负债表..... | 13 |
| 6.2 利润表..... | 14 |
| 6.3 净资产变动表..... | 15 |
| 6.4 报表附注..... | 17 |
| §7 投资组合报告 | 37 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 37 |
| 7.2 债券回购融资情况..... | 37 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 38 |
| 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..... | 39 |

| | |
|--|-----------|
| 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 | 39 |
| 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..... | 39 |
| 7.9 投资组合报告附注..... | 40 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 40 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 40 |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况..... | 41 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 41 |
| 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..... | 41 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 41 |
| §10 重大事件揭示..... | 42 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 42 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 42 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 43 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况..... | 43 |
| 10.9 其他重大事件..... | 44 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 44 |
| 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 | 44 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 44 |
| §12 备查文件目录..... | 45 |
| 12.1 备查文件目录..... | 45 |
| 12.2 存放地点..... | 45 |
| 12.3 查阅方式..... | 45 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | | |
|-----------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| 基金名称 | 中金现金管家货币市场基金 | | |
| 基金简称 | 中金现金管家 | | |
| 基金主代码 | 000882 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2014 年 11 月 28 日 | | |
| 基金管理人 | 中金基金管理有限公司 | | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 91,835,187,844.83 份 | | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中金现金管家 A | 中金现金管家 B | 中金现金管家 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 000882 | 000883 | 005065 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 102,462,564.77 份 | 15,428,144,321.66 份 | 76,304,580,958.40 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在保障基金资产的安全性和流动性的前提下，通过积极主动管理，力争实现超越业绩比较基准的稳定收益。 |
| 投资策略 | 在保持基金资产相对稳定的前提下，通过对市场资金供求、基金申赎情况进行动态分析，确定本基金流动性目标，相应调整基金资产在高流动性资产和相对流动性较低资产之间的配比。结合各类资产的收益率水平、流动性特征、信用风险等因素来确定并动态调整基金资产中央行票据、国债、债券回购等各类属品种的配置比例。具体包括：1、短期利率预期策略；2、类属配置策略；3、期限配置策略；4、跨市场和品种套利策略；5、流动性管理策略。详见《中金现金管家货币市场基金基金合同》。 |
| 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，属于证券投资基金中的低风险品种，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 | 中金基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 王小飞 |
| | 联系电话 | 021-60637103 |
| | 电子邮箱 | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | 400-868-1166 | 021-60637228 |
| 传真 | 010-66159121 | 021-60635778 |
| 注册地址 | 北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸写字楼 2 座 26 层 05 室 | 北京市西城区金融大街 25 号 |
| 办公地址 | 北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸大厦 B 座 43 层 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |

| | | |
|-------|--------|--------|
| 邮政编码 | 100004 | 100033 |
| 法定代表人 | 李金泽 | 张金良 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|--------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.ciccfund.com/ |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|-------------------------------|
| 注册登记机构 | 中金基金管理有限公司 | 北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 43 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 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) | | |
|---------------|-------------------------------------|-------------------|-------------------|
| | 中金现金管家 A | 中金现金管家 B | 中金现金管家 C |
| 本期已实现收益 | 1,057,884.15 | 203,200,622.09 | 621,851,538.69 |
| 本期利润 | 1,057,884.15 | 203,200,622.09 | 621,851,538.69 |
| 本期净值收益率 | 0.9086% | 1.0290% | 0.9137% |
| 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 | 102,462,564.77 | 15,428,144,321.66 | 76,304,580,958.40 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 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 | 26.5930% | 29.5394% | 11.7476% |

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、本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中金现金管家 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 | 0.1303% | 0.0004% | 0.1110% | 0.0000% | 0.0193% | 0.0004% |
| 过去三个月 | 0.4293% | 0.0009% | 0.3366% | 0.0000% | 0.0927% | 0.0009% |
| 过去六个月 | 0.9086% | 0.0008% | 0.6732% | 0.0000% | 0.2354% | 0.0008% |
| 过去一年 | 1.8047% | 0.0008% | 1.3537% | 0.0000% | 0.4510% | 0.0008% |
| 过去三年 | 5.4509% | 0.0009% | 4.0537% | 0.0000% | 1.3972% | 0.0009% |
| 自基金合同生效起至今 | 26.5930% | 0.0041% | 12.9563% | 0.0000% | 13.6367% | 0.0041% |

中金现金管家 B

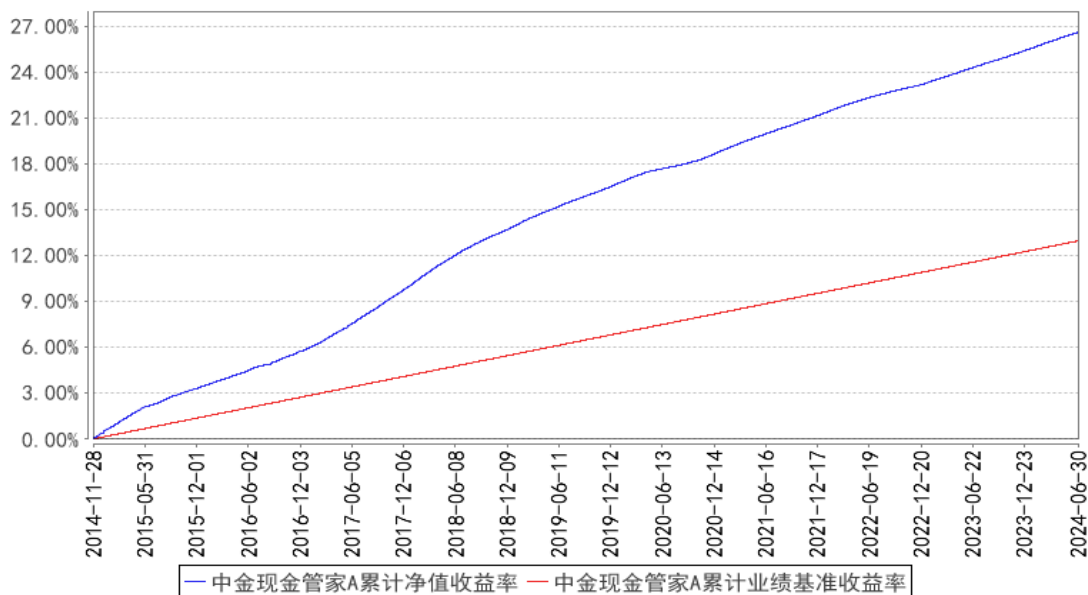
| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去一个月 | 0.1501% | 0.0004% | 0.1110% | 0.0000% | 0.0391% | 0.0004% |
| 过去三个月 | 0.4895% | 0.0009% | 0.3366% | 0.0000% | 0.1529% | 0.0009% |
| 过去六个月 | 1.0290% | 0.0008% | 0.6732% | 0.0000% | 0.3558% | 0.0008% |
| 过去一年 | 2.0498% | 0.0008% | 1.3537% | 0.0000% | 0.6961% | 0.0008% |
| 过去三年 | 6.2135% | 0.0009% | 4.0537% | 0.0000% | 2.1598% | 0.0009% |
| 自基金合同生效起至今 | 29.5394% | 0.0041% | 12.9563% | 0.0000% | 16.5831% | 0.0041% |

中金现金管家 C

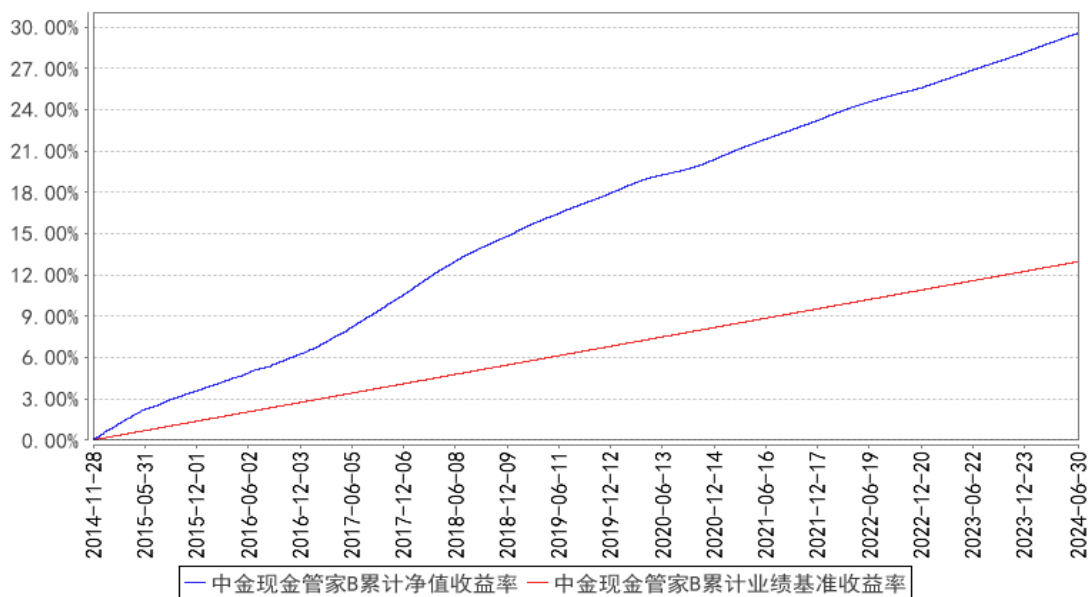
| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去一个月 | 0.1312% | 0.0004% | 0.1110% | 0.0000% | 0.0202% | 0.0004% |
| 过去三个月 | 0.4321% | 0.0009% | 0.3366% | 0.0000% | 0.0955% | 0.0009% |
| 过去六个月 | 0.9137% | 0.0008% | 0.6732% | 0.0000% | 0.2405% | 0.0008% |
| 过去一年 | 1.8153% | 0.0008% | 1.3537% | 0.0000% | 0.4616% | 0.0008% |
| 过去三年 | 5.4836% | 0.0009% | 4.0537% | 0.0000% | 1.4299% | 0.0009% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.7476% | 0.0015% | 7.6636% | 0.0000% | 4.0840% | 0.0015% |

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

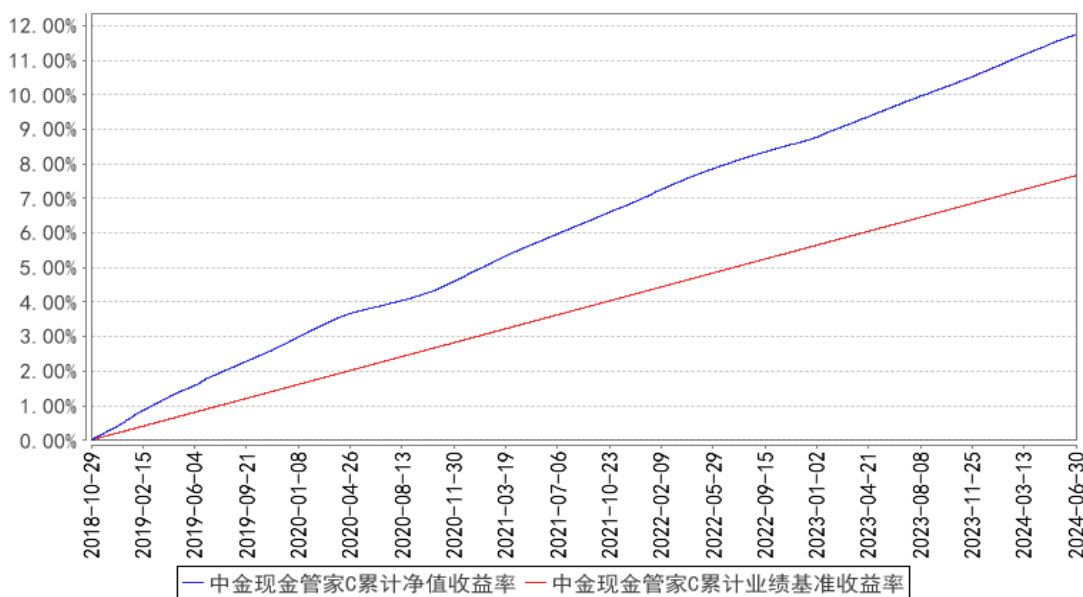
中金现金管家A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中金现金管家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



中金现金管家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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于2014年2月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东，是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本6亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金充分发挥母公司品牌及资源优势，持续增强公司整体竞争实力。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室，办公地址为北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座43层。

截至2024年6月30日，公司共管理51只公募基金，证券投资基金管理规模1631.27亿元。

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 | | |
| 石玉 | 本基金基金经理 | 2016年7月16日 | - | 18年 | 石玉女士，管理学硕士。历任中国科技证券有限责任公司、华泰联合证券有限责任公司职员，天弘基金管理有限公司金融工程分析师、固定收益研究员，中国国际金融股份有限公司资产管理部高级研究员、投资经理助理、投资经理。现任中金基金管理有限公司固定收益部基金经理。 |
| 杨力 | 本基金基 | 2023年4 | - | 8年 | 杨力元女士，经济学硕士。曾任中金基金 |

| | | | | | |
|---|-----|--------|--|--|---|
| 元 | 金经理 | 月 12 日 | | | 管理有限公司交易部债券交易员、固定收益部基金经理助理。现任中金基金管理有限公司固定收益部基金经理。 |
|---|-----|--------|--|--|---|

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、本基金无基金经理助理。

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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，本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形。

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有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

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，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，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司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未超过该证券当日成交量的 5%。

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，海外主要经济体通胀虽有回落但粘性仍强，10 年期美国国债收益率先上后下，从年初的 3.9% 上升至 4 月末的 4.70%，随后震荡下行至 6 月末的 4.36%。国内方面，上半年 GDP 同比增长 5.0%，二季度增长 4.7%，增速较一季度有所回落。整体来看，基建和制造业投资回升，地产投资维持低景气，居民消费需求平稳，出口数据较为亮眼。金融数据表现一般，一是与

信贷“挤水分”的因素有关，二是当下实体融资需求仍然不足。通胀方面，CPI 同比上涨 0.1%，核心 CPI 基本稳定；PPI 同比下降 2.1%，降幅有所收窄。货币政策方面，央行 1 月初通过降准 0.5% 释放长期流动性 1 万亿，关键时点积极投放公开市场操作，流动性保持合理充裕。资金利率方面，DR007 基本围绕在政策利率附近，一二季度均值均为 1.87%；R007 有所下行，一季度均值 2.13%，二季度均值 1.94%，流动性分层缓解。

2024 年上半年，债券市场收益率整体下行。1-2 月，受到国内经济动能偏弱、权益市场表现不佳、机构配置需求旺盛、央行降准操作落地等因素影响，债券市场明显走强，期限利差和信用利差持续压缩，超长期国债表现尤为亮眼；3-4 月，受到地产政策、债券供给担忧以及市场关注到长期国债收益率的久期风险等因素影响，部分交易盘止盈，债市波动加大；5-6 月，实体融资需求仍偏弱、禁止手工补息后机构配债需求较多、非银资金面整体宽松，债券收益率继续下行。上半年，中债-总财富（总值）指数上涨 3.83%，中债-中期票据总财富（总值）指数上涨 2.80%，中证同业存单 AAA 指数上涨 1.27%。

操作上，组合以同业存单、存款、逆回购为主要配置资产，同时密切跟踪资金面和客户集中度，在保障组合流动性和安全性前提下，积极调节组合久期，力争提高组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内中金现金管家 A 的基金份额净值收益率为 0.9086%，同期业绩基准收益率为 0.6732%；中金现金管家 B 的基金份额净值收益率为 1.0290%，同期业绩基准收益率为 0.6732%；中金现金管家 C 的基金份额净值收益率为 0.9137%，同期业绩基准收益率为 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

展望下半年，国内经济有望温和修复，财政政策维持积极，基建投资继续发力。海外经济体降息周期的开启有助于国内制造业和出口的表现。地产投资在政策优化后或边际回暖，但实质性改善程度仍有待观察。实体融资需求偏弱，稳增长需支持性的货币政策，降准降息仍有空间。

预计下半年债市风险整体可控，但波动较上半年或有所加大。当前的基本面对债市有一定支撑，存款利率下调、禁止手工补息使得债券配置需求较旺，美联储降息有落地可能性、国内货币政策空间进一步打开，预计债市大幅调整的风险可控。但当前债券绝对收益率整体处于较低水平、抗回撤能力偏弱，机构行为偏一致，债券市场波动或将加大。重点关注稳增长的政策力度以及效果、市场风险偏好变化、资金利率中枢变化以及关注长期债券久期风险。

本基金将坚持货币基金作为现金管理类产品的定位，密切跟踪货币政策和货币市场利率走势，以投资银行存单存款、利率债、高等级信用债和逆回购为主，在努力保障组合流动性和安全性的前提下，追求较为稳健的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《资产管理产品相关会计处理规定》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

基金管理人建立并执行基金估值相关管理制度，设置估值委员会研究、指导基金估值业务。各估值委员会委员和基金会计均具有相关工作经历和专业胜任能力。参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金自基金合同生效之日起每个开放日将实现的基金净收益（或净损失）分配给基金份额持有人，参与下一日基金收益分配，并结转到投资者基金账户，使基金份额净值始终保持 1.0000 元。本基金收益分配方式为红利再投资。

本基金本报告期内 A 类份额累计应分配利润 1,057,884.15 元，实际分配金额 1,057,884.15 元，B 类份额累计应分配利润 203,200,622.09 元，实际分配 203,200,622.09 元，C 份额累计应分配利润 621,851,538.69 元，实际分配 621,851,538.69 元。

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

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中金现金管家货币市场基金

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 | 47,409,661,520.17 | 27,435,263,487.87 |
| 结算备付金 | | - | 77,310,977.24 |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 44,865,264,397.95 | 34,285,271,420.26 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 44,852,842,334.06 | 34,238,891,077.08 |
| 资产支持证券投资 | | 12,422,063.89 | 46,380,343.18 |
| 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 | 7,997,543,745.45 | 6,949,441,548.74 |
| 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 | | 1,499,494.81 | 10,029,523.23 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 100,273,969,158.38 | 68,757,316,957.34 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |

| | | | |
|-------------|----------|--------------------|-------------------|
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 8,393,241,986.69 | 3,354,088,934.47 |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 23,630,490.86 | 18,354,520.03 |
| 应付托管费 | | 4,889,067.08 | 3,797,486.90 |
| 应付销售服务费 | | 15,799,573.58 | 12,144,462.15 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 339,932.98 | 256,677.42 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 880,262.36 | 955,292.47 |
| 负债合计 | | 8,438,781,313.55 | 3,389,597,373.44 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 91,835,187,844.83 | 65,367,719,583.90 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | - | - |
| 净资产合计 | | 91,835,187,844.83 | 65,367,719,583.90 |
| 负债和净资产总计 | | 100,273,969,158.38 | 68,757,316,957.34 |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，中金现金管家 A 的基金份额净值为 1.0000 元，期末份额总额为 102,462,564.77 份；中金现金管家 B 的基金份额净值为 1.0000 元，期末份额总额为 15,428,144,321.66 份；中金现金管家 C 的基金份额净值为 1.0000 元，期末份额总额为 76,304,580,958.40 份。基金份额总额 91,835,187,844.83 份。

6.2 利润表

会计主体：中金现金管家货币市场基金

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 | 上年度可比期间 |
|-------------------|----------|---------------------------------|---------------------------------|
| | | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 一、营业总收入 | | 1,106,292,272.58 | 845,414,529.51 |
| 1. 利息收入 | | 654,657,517.50 | 548,166,258.13 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 554,523,200.17 | 414,049,841.33 |
| 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 | | 100,134,317.33 | 134,116,416.80 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 451,634,512.02 | 297,248,271.38 |
| 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 | 451,241,257.66 | 295,164,707.37 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.16 | 393,254.36 | 2,083,564.01 |
| 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 | - | - |
| 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） | 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 | 243.06 | - |
| 减：二、营业总支出 | | 280,182,227.65 | 217,087,688.39 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 128,040,531.90 | 97,305,919.67 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 26,491,144.53 | 20,132,259.29 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 83,096,806.72 | 63,496,463.20 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 42,053,443.79 | 35,818,959.50 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 42,053,443.79 | 35,818,959.50 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 316,501.55 | 161,868.02 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 183,799.16 | 172,218.71 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 826,110,044.93 | 628,326,841.12 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 826,110,044.93 | 628,326,841.12 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 826,110,044.93 | 628,326,841.12 |

6.3 净资产变动表

会计主体：中金现金管家货币市场基金

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 | 65,367,719,583.90 | - | - | 65,367,719,583.90 |

| | | | | |
|--|--|--------|-----------------|---------------------|
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 65,367,719,583.90 | - | - | 65,367,719,583.90 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 26,467,468,260.93 | - | - | 26,467,468,260.93 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 826,110,044.93 | 826,110,044.93 |
| （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） | 26,467,468,260.93 | - | - | 26,467,468,260.93 |
| 其中：1. 基金申购款 | 693,951,032,156.94 | - | - | 693,951,032,156.94 |
| 2. 基金赎回款 | -667,483,563,896.01 | - | - | -667,483,563,896.01 |
| （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） | - | - | -826,110,044.93 | -826,110,044.93 |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 91,835,187,844.83 | - | - | 91,835,187,844.83 |
| 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 | 44,891,017,863.33 | - | - | 44,891,017,863.33 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |

| | | | | |
|--|---------------------|---|-----------------|---------------------|
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 44,891,017,863.33 | - | - | 44,891,017,863.33 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 17,828,325,305.97 | - | - | 17,828,325,305.97 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 628,326,841.12 | 628,326,841.12 |
| （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） | 17,828,325,305.97 | - | - | 17,828,325,305.97 |
| 其中：1. 基金申购款 | 670,299,270,357.23 | - | - | 670,299,270,357.23 |
| 2. 基金赎回款 | -652,470,945,051.26 | - | - | -652,470,945,051.26 |
| （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） | - | - | -628,326,841.12 | -628,326,841.12 |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 62,719,343,169.30 | - | - | 62,719,343,169.30 |

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：

宗喆

二

白娜

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

中金现金管家货币市场基金(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于 2014 年 10 月 31 日证监许可[2014]1152 号《关于核准中金现金管家货币市场基金注册的批复》核准,由中金基金管理有限公司(以下简称“中金基金”)依照《中华人民共和国

国证券投资基金法》及配套规则、《中金现金管家货币市场基金基金招募说明书》和《中金现金管家货币市场基金基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）。

本基金通过中金基金直销柜台、中金基金网上直销平台及中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）共同销售，募集期为 2014 年 11 月 19 日至 2014 年 11 月 25 日。经向中国证监会备案，《中金现金管家货币市场基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2014 年 11 月 28 日正式生效，基金合同生效日基金实收份额为 402,261,594.73 份（含利息转份额 16,754.29 份），发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

根据基金合同和《中金现金管家货币市场基金更新招募说明书》的相关内容，本基金根据投资者认/申购本基金的金额或销售渠道不同，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类别。本基金设 A 类、B 类和 C 类三类基金份额（以下简称中金现金管家 A、中金现金管家 B 和中金现金管家 C），三类基金份额单独设置基金代码，并单独公布每万份基金已实现收益和 7 日年化收益率。投资者可自行选择认/申购的基金份额类别，不同基金份额类别之间不得互相转换，但依据本基金的基金合同和招募说明书的约定因认/申购、赎回、基金转换等交易及收益结转份额而发生基金份额自动升级或降级的除外。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《货币市场基金监督管理办法》、基金合同和《中金现金管家货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为现金；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；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；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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，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 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

的个人所得税。

(d)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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 | 5,007,274,545.92 |
| 等于：本金 | 5,005,303,103.89 |
| 加：应计利息 | 1,971,442.03 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | 42,402,386,974.25 |
| 等于：本金 | 42,150,000,000.00 |
| 加：应计利息 | 252,386,974.25 |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限1个月以内 | 500,350,000.04 |
| 存款期限1-3个月 | - |
| 存款期限3个月以上 | 41,902,036,974.21 |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 47,409,661,520.17 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2024年6月30日 | | | |
|--------|-------|-------------------|-------------------|---------------|--------|
| | | 按实际利率计算的账面价值 | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度(%) |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | 44,852,842,334.06 | 44,889,583,231.99 | 36,740,897.93 | 0.0400 |
| | 合计 | 44,852,842,334.06 | 44,889,583,231.99 | 36,740,897.93 | 0.0400 |
| 资产支持证券 | | 12,422,063.89 | 12,459,563.89 | 37,500.00 | 0.0000 |
| 合计 | | 44,865,264,397.95 | 44,902,042,795.88 | 36,778,397.93 | 0.0400 |

注：偏离金额=影子定价-按实际利率计算的账面价值，偏离度=偏离金额/通过按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值。

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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年6月30日 | |
|-------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 347,215,074.00 | - |
| 银行间市场 | 7,650,328,671.45 | - |
| 合计 | 7,997,543,745.45 | - |

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

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

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

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

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 | 766,536.22 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 766,536.22 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 113,726.14 |
| 合计 | 880,262.36 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中金现金管家 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 | 87,679,191.14 | 87,679,191.14 |
| 本期申购 | 231,752,451.44 | 231,752,451.44 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -216,969,077.81 | -216,969,077.81 |
| 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 | 102,462,564.77 | 102,462,564.77 |

中金现金管家 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 | 6,979,819,664.40 | 6,979,819,664.40 |
| 本期申购 | 66,971,443,901.29 | 66,971,443,901.29 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -58,523,119,244.03 | -58,523,119,244.03 |
| 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 | 15,428,144,321.66 | 15,428,144,321.66 |

中金现金管家 C

| 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 | 58,300,220,728.36 | 58,300,220,728.36 |
| 本期申购 | 626,747,835,804.21 | 626,747,835,804.21 |

| | | |
|---------------|---------------------|---------------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -608,743,475,574.17 | -608,743,475,574.17 |
| 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 | 76,304,580,958.40 | 76,304,580,958.40 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中金现金管家 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 | 1,057,884.15 | - | 1,057,884.15 |
| 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 | -1,057,884.15 | - | -1,057,884.15 |
| 本期末 | - | - | - |

中金现金管家 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 | 203,200,622.09 | - | 203,200,622.09 |
| 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 | -203,200,622.09 | - | -203,200,622.09 |
| 本期末 | - | - | - |

中金现金管家 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 | 621,851,538.69 | - | 621,851,538.69 |
| 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 | -621,851,538.69 | - | -621,851,538.69 |
| 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 | | 29,967,467.51 |
| 定期存款利息收入 | | 524,527,847.53 |
| 其他存款利息收入 | | - |
| 结算备付金利息收入 | | 27,885.13 |
| 其他 | | - |
| 合计 | | 554,523,200.17 |

6.4.7.14 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

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 | | 437,647,047.33 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | | 13,594,210.33 |
| 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 | | 451,241,257.66 |

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 | | 48,999,400,504.81 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | | 48,622,637,535.51 |
| 减：应计利息总额 | | 363,168,758.97 |
| 减：交易费用 | | - |

| | |
|----------|---------------|
| 买卖债券差价收入 | 13,594,210.33 |
|----------|---------------|

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|--------------------------|----------------------------|
| 资产支持证券投资收益——利息收入 | 393,254.36 |
| 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入 | - |
| 资产支持证券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 资产支持证券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 393,254.36 |

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额 | 34,261,251.41 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 33,853,000.00 |
| 减：应计利息总额 | 408,251.41 |
| 减：交易费用 | - |
| 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

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.19 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | - |
| 其他 | 243.06 |
| 合计 | 243.06 |

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

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 | 44,753.80 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 划款手续费 | 60,773.02 |
| 其他 | 600.00 |
| 合计 | 183,799.16 |

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------------|------------------------|
| 中金基金 | 基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构 |
| 建设银行 | 基金托管人、基金销售机构 |
| 中金公司 | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 中国中金财富证券有限公司(以下简称“中金财富证券”) | 基金管理人股东的一级全资子公司、基金销售机构 |

| | |
|------------|-----------------|
| 中金浦成投资有限公司 | 基金管理人股东的一级全资子公司 |
|------------|-----------------|

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

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 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：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 | |
|-------|----------------------------|-----------------------|---------------------------------|-----------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例(%) |
| 中金公司 | 3,506,252,310.00 | 100.00 | 86,736,538,264.00 | 100.00 |

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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 | 128,040,531.90 | 97,305,919.67 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 54,952,026.84 | 39,111,759.44 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 73,088,505.06 | 58,194,160.23 |

注：支付基金管理人中金基金的基金管理费按前一日基金资产净值 0.29%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：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.29%/当年天数。

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 | 上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 |
|----|------------------------|----------------------------|
|----|------------------------|----------------------------|

| | 月 30 日 | 6 月 30 日 |
|----------------|---------------|---------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 26,491,144.53 | 20,132,259.29 |

注：支付基金托管人建设银行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：日托管费=前一日基金资产净值×0.06%/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 | | | |
| | 中金现金管家 A | 中金现金管家 B | 中金现金管家 C | 合计 |
| 建设银行 | 27,182.93 | 129,480.66 | - | 156,663.59 |
| 中金财富证券 | 96,654.90 | 2,205.21 | 6,307,370.39 | 6,406,230.50 |
| 中金基金 | 8,982.69 | 493,541.12 | - | 502,523.81 |
| 合计 | 132,820.52 | 625,226.99 | 6,307,370.39 | 7,065,417.90 |
| 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 | | | |
| | 中金现金管家 A | 中金现金管家 B | 中金现金管家 C | 合计 |
| 建设银行 | 27,152.52 | 240.53 | - | 27,393.05 |
| 中金财富证券 | 81,701.03 | 965.08 | 7,407,432.17 | 7,490,098.28 |
| 中金基金 | 16,728.57 | 390,446.23 | - | 407,174.80 |
| 合计 | 125,582.12 | 391,651.84 | 7,407,432.17 | 7,924,666.13 |

注：1、中金现金管家 A 类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.25%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 A 类基金份额销售服务费=前一日 A 类基金份额资产净值×0.25%/当年天数。

2、中金现金管家 B 类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.01%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 B 类基金份额销售服务费=前一日 B 类基金份额资产净值×0.01%/当年天数。

3、中金现金管家 C 类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.24%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 C 类基金份额销售服务费=前一日 C 类基金份额资产净值×0.24%/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

单位：人民币元

| 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 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 |
| 建设银行 | - | - | - | - | 5,565,090,000.00 | 566,425.24 |
| 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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 |
| - | - | - | - | - | - | - |

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | |
|----------------------------------|--|---------------|----------|
| | 中金现金管家 A | 中金现金管家 B | 中金现金管家 C |
| 基金合同生效日（2014 年 11 月 28 日）持有的基金份额 | - | 10,000,450.00 | - |
| 报告期初持有的基金份额 | - | 0.00 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | 55,432,539.92 | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | 0.00 | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | 0.00 | - |
| 报告期末持有的基金份额 | - | 55,432,539.92 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | 0.3593% | - |
| 项目 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | |
| | 中金现金管家 A | 中金现金管家 B | 中金现金管家 C |
| 基金合同生效日（2014 年 11 月 28 日）持有的基金份额 | - | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | - | - | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | - | - | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | - | - |

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

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

份额单位：份

中金现金管家 B

| 关联方名称 | 本期末 2024年6月30日 | | 上年度末 2023年12月31日 | |
|------------|-------------------|-----------------------------|---------------------|-----------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%) | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%) |
| 建设银行 | 1,000,048,842.20 | 6.48 | - | - |
| 中金公司 | 500,024,421.10 | 3.24 | - | - |
| 中金浦成投资有限公司 | 1,002,821,693.96 | 6.50 | - | - |

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 |
| 建设银行 | 5,007,274,545.92 | 29,967,467.51 | 5,574,643.74 | 26,238.12 |

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

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在承销期内未参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 中金现金管家 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 |
| 1,057,884.15 | - | - | 1,057,884.15 | - |
| 中金现金管家 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 |
| 203,200,622.09 | - | - | 203,200,622.09 | - |
| 中金现金管家 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 |
| 621,851,538.69 | - | - | 621,851,538.69 | - |

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，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 8,393,241,986.69 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 |
|-----------|---------------|----------------|------------|------------|------------------|
| 112402009 | 24 工商银行 CD009 | 2024 年 7 月 1 日 | 99.32 | 911,000 | 90,478,678.28 |
| 112402043 | 24 工商银行 CD043 | 2024 年 7 月 1 日 | 99.27 | 900,000 | 89,343,798.28 |
| 112404030 | 24 中国银行 CD030 | 2024 年 7 月 1 日 | 98.60 | 482,000 | 47,526,483.07 |
| 112405194 | 24 建设银行 CD194 | 2024 年 7 月 1 日 | 98.58 | 1,569,000 | 154,673,430.86 |
| 150210 | 15 国开 10 | 2024 年 7 月 1 日 | 102.68 | 236,000 | 24,232,565.44 |
| 170208 | 17 国开 08 | 2024 年 7 月 1 日 | 104.02 | 3,000,000 | 312,055,135.79 |
| 190409 | 19 农发 09 | 2024 年 7 月 1 日 | 103.00 | 200,000 | 20,600,096.70 |
| 200208 | 20 国开 08 | 2024 年 7 月 1 日 | 101.11 | 1,500,000 | 151,659,184.84 |
| 220303 | 22 进出 03 | 2024 年 7 月 1 日 | 100.81 | 400,000 | 40,322,400.83 |
| 220322 | 22 进出 22 | 2024 年 7 月 1 日 | 101.98 | 1,000,000 | 101,984,932.46 |
| 220403 | 22 农发 03 | 2024 年 7 月 1 日 | 101.29 | 1,300,000 | 131,677,259.21 |
| 230211 | 23 国开 11 | 2024 年 7 月 1 日 | 101.53 | 11,400,000 | 1,157,463,030.71 |
| 230411 | 23 农发 11 | 2024 年 7 月 1 日 | 101.81 | 4,000,000 | 407,244,099.70 |
| 240301 | 24 进出 01 | 2024 年 7 月 1 日 | 101.05 | 3,000,000 | 303,158,618.57 |
| 249934 | 24 贴现国债 34 | 2024 年 7 月 1 日 | 99.72 | 800,000 | 79,777,651.96 |
| 249935 | 24 贴现国债 35 | 2024 年 7 月 1 日 | 99.67 | 800,000 | 79,739,830.65 |
| 112304047 | 23 中国银行 CD047 | 2024 年 7 月 3 日 | 99.38 | 3,000,000 | 298,129,702.35 |
| 112402009 | 24 工商银行 CD009 | 2024 年 7 月 3 日 | 99.32 | 989,000 | 98,225,480.60 |
| 112402024 | 24 工商银行 CD024 | 2024 年 7 月 3 日 | 99.22 | 4,000,000 | 396,899,579.22 |
| 112416060 | 24 上海银行 CD060 | 2024 年 7 月 3 日 | 99.42 | 4,256,000 | 423,124,319.02 |
| 230211 | 23 国开 11 | 2024 年 7 月 3 日 | 101.53 | 1,900,000 | 192,910,505.12 |
| 112303142 | 23 农业银行 CD142 | 2024 年 7 月 4 日 | 99.93 | 2,180,000 | 217,857,701.97 |
| 112303206 | 23 农业银行 CD206 | 2024 年 7 月 4 日 | 99.56 | 2,180,000 | 217,041,257.46 |
| 112306281 | 23 交通银行 CD281 | 2024 年 7 月 4 日 | 99.26 | 2,174,000 | 215,791,699.27 |
| 112408070 | 24 中信银行 CD070 | 2024 年 7 月 4 日 | 99.14 | 2,044,000 | 202,650,216.68 |
| 112416055 | 24 上海银行 CD055 | 2024 年 7 月 4 日 | 99.42 | 1,277,000 | 126,957,014.44 |
| 112480636 | 24 宁波银行 CD063 | 2024 年 7 月 4 日 | 99.11 | 1,383,000 | 137,065,358.27 |
| 112496783 | 24 杭州银行 CD063 | 2024 年 7 月 4 日 | 99.42 | 5,000,000 | 497,091,540.20 |

| | | | | | |
|-----------|---------------|----------------|--------|------------|------------------|
| 150210 | 15 国开 10 | 2024 年 7 月 4 日 | 102.68 | 2,264,000 | 232,468,339.69 |
| 249933 | 24 贴现国债 33 | 2024 年 7 月 4 日 | 99.74 | 3,000,000 | 299,226,798.39 |
| 112304062 | 23 中国银行 CD062 | 2024 年 7 月 5 日 | 98.98 | 5,000,000 | 494,902,700.85 |
| 112403055 | 24 农业银行 CD055 | 2024 年 7 月 5 日 | 98.94 | 2,223,000 | 219,933,952.70 |
| 112404024 | 24 中国银行 CD024 | 2024 年 7 月 5 日 | 98.66 | 1,312,000 | 129,438,137.32 |
| 112405194 | 24 建设银行 CD194 | 2024 年 7 月 5 日 | 98.58 | 431,000 | 42,488,367.56 |
| 112408065 | 24 中信银行 CD065 | 2024 年 7 月 5 日 | 99.69 | 5,000,000 | 498,436,691.49 |
| 112409066 | 24 浦发银行 CD066 | 2024 年 7 月 5 日 | 99.25 | 2,000,000 | 198,495,924.90 |
| 112413055 | 24 浙商银行 CD055 | 2024 年 7 月 5 日 | 99.40 | 3,600,000 | 357,855,035.13 |
| 112416059 | 24 上海银行 CD059 | 2024 年 7 月 5 日 | 99.43 | 1,125,000 | 111,854,372.93 |
| 112418155 | 24 华夏银行 CD155 | 2024 年 7 月 5 日 | 98.63 | 380,000 | 37,478,945.14 |
| 112492724 | 24 宁波银行 CD005 | 2024 年 7 月 5 日 | 99.68 | 2,635,000 | 262,668,841.58 |
| 合计 | | | | 90,851,000 | 9,100,929,679.63 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

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

本基金投资于各类货币市场工具，属于低风险稳定收益品种。本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险等。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对相应风险进行控制，从而实现本基金的投资目标。

本基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制在合理水平，保障业务稳健运行。

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家上市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管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过

信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

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 | 3,926,728,757.62 | 4,311,985,354.50 |
| 合计 | 3,926,728,757.62 | 4,311,985,354.50 |

注：以上按短期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。（上年度末：同）

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6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 34,006,005,657.77 | 24,628,829,788.65 |
| 合计 | 34,006,005,657.77 | 24,628,829,788.65 |

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6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 1,570,196,889.58 | 1,311,824,144.72 |
| AAA 以下 | - | 270,402,945.68 |
| 未评级 | 1,765,135,151.97 | 256,185,795.97 |
| 合计 | 3,335,332,041.55 | 1,838,412,886.37 |

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 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 2024年6月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 12,422,063.89 | 46,380,343.18 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 12,422,063.89 | 46,380,343.18 |

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。（上年度末：同）

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。基金管理人制定了《中金基金管理有限公司流动性风险管理办法》，对基金组合的流动性管理的组织架构和职责分工、流动性风险的流程管理、流动性压力测试、流动性风险预警、指标超标及危机的处理、流动性风险管理工具、各类资产的流动性风险管理指标与措施等方面进行了规定，并遵守《中金基金管理有限公司投资风险控制指标管理办法》中对风险控制的相关规定，对本基金组合的各项流动性指标进行监控。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成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。首先，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，以备支付基金份额持有人的赎回款项，可以满足短期少量赎回的流动性需要；其次，基于分散投资的原则，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，在个券方面无高集中度的特征；第三，本基金的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，且本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过该基金资产净值的 10%，正常市场环境下，大部分资产可以较快变现应对赎回。因此在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券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，导致基金收益的不确定性。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

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金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6月30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 | 47,155,303,103.89 | - | - | 254,358,416.28 | 47,409,661,520.17 |
| 交易性金融资产 | 41,464,259,930.39 | 3,264,164,871.68 | - | 136,839,595.88 | 44,865,264,397.95 |
| 买入返售金融资产 | 7,994,107,024.52 | - | - | 3,436,720.93 | 7,997,543,745.45 |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,499,494.81 | 1,499,494.81 |
| 资产总计 | 96,613,670,058.80 | 3,264,164,871.68 | - | 396,134,227.90 | 100,273,969,158.38 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 8,390,502,797.73 | - | - | 2,739,188.96 | 8,393,241,986.69 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 15,799,573.58 | 15,799,573.58 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 23,630,490.86 | 23,630,490.86 |
| 应付托管费 | - | - | - | 4,889,067.08 | 4,889,067.08 |
| 应交税费 | - | - | - | 339,932.98 | 339,932.98 |
| 其他负债 | - | - | - | 880,262.36 | 880,262.36 |
| 负债总计 | 8,390,502,797.73 | - | - | 48,278,515.82 | 8,438,781,313.55 |
| 利率敏感度缺口 | 88,223,167,261.07 | 3,264,164,871.68 | - | 347,855,712.08 | 91,835,187,844.83 |
| 上年度末 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 | 26,268,973,056.39 | 1,050,000,000.00 | - | 116,290,431.48 | 27,435,263,487.87 |
| 结算备付金 | 77,272,727.27 | - | - | 38,249.97 | 77,310,977.24 |
| 交易性金融资产 | 30,812,003,391.26 | 3,361,368,230.68 | - | 111,899,798.32 | 34,285,271,420.26 |
| 买入返售金融资产 | 6,942,430,893.64 | - | - | 7,010,655.10 | 6,949,441,548.74 |
| 应收申购款 | - | - | - | 10,029,523.23 | 10,029,523.23 |
| 资产总计 | 64,100,680,068.56 | 4,411,368,230.68 | - | 245,268,658.10 | 68,757,316,957.34 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 3,350,614,474.06 | - | - | 3,474,460.41 | 3,354,088,934.47 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 12,144,462.15 | 12,144,462.15 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 18,354,520.03 | 18,354,520.03 |
| 应付托管费 | - | - | - | 3,797,486.90 | 3,797,486.90 |
| 应交税费 | - | - | - | 256,677.42 | 256,677.42 |
| 其他负债 | - | - | - | 955,292.47 | 955,292.47 |
| 负债总计 | 3,350,614,474.06 | - | - | 38,982,899.38 | 3,389,597,373.44 |
| 利率敏感度缺口 | 60,750,065,594.50 | 4,411,368,230.68 | - | 206,285,758.72 | 65,367,719,583.90 |

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

本报告期末，在“影子定价”机制有效的前提下，若其他市场变量保持不变，市场利率上升或下降 25 个基点，对本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

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

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大其他价格风险。

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

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 | 44,865,264,397.95 | 34,285,271,420.26 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 44,865,264,397.95 | 34,285,271,420.26 |

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。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间

及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

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无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

不以公允价值计量的金融工具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之间无重大差异。

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 | 44,865,264,397.95 | 44.74 |
| | 其中：债券 | 44,852,842,334.06 | 44.73 |
| | 资产支持证券 | 12,422,063.89 | 0.01 |
| 2 | 买入返售金融资产 | 7,997,543,745.45 | 7.98 |
| | 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 | 47,409,661,520.17 | 47.28 |
| 4 | 其他各项资产 | 1,499,494.81 | 0.00 |
| 5 | 合计 | 100,273,969,158.38 | 100.00 |

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例 (%) | |
|----|--------------|------------------|----------------|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 5.26 | |
| | 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 | 8,393,241,986.69 | 9.14 |
| | 其中：买断式回购融资 | - | - |

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本基金本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

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 | 110 |
| 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 | 89 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 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期限未超过 120 天。

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 | 17.49 | 9.14 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 4.95 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 11.66 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 18.22 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 56.44 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 108.76 | 9.14 |

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限未超过 240 天。

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 | 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 | 458,744,281.00 | 0.50 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 3,269,454,488.61 | 3.56 |
| | 其中：政策性金融债 | 3,126,031,596.12 | 3.40 |
| 4 | 企业债券 | 113,580,446.66 | 0.12 |
| 5 | 企业短期融资券 | 3,926,728,757.62 | 4.28 |
| 6 | 中期票据 | 3,078,328,702.40 | 3.35 |
| 7 | 同业存单 | 34,006,005,657.77 | 37.03 |

| | | | |
|----|----------------------|-------------------|-------|
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 44,852,842,334.06 | 48.84 |
| 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) | 按实际利率计算的账 面价值 (元) | 占基金资产 净值比例 (%) |
|----|-----------|-----------------|-------------|----------------------|-------------------|
| 1 | 230211 | 23 国开 11 | 13,300,000 | 1,350,373,535.83 | 1.47 |
| 2 | 112403059 | 24 农业银行 CD059 | 11,500,000 | 1,143,686,657.65 | 1.25 |
| 3 | 112403052 | 24 农业银行 CD052 | 7,000,000 | 692,590,741.55 | 0.75 |
| 4 | 112413055 | 24 浙商银行 CD055 | 6,000,000 | 596,425,058.55 | 0.65 |
| 5 | 112408065 | 24 中信银行 CD065 | 5,000,000 | 498,436,691.49 | 0.54 |
| 6 | 112492724 | 24 宁波银行 CD005 | 5,000,000 | 498,422,849.30 | 0.54 |
| 7 | 112495616 | 24 徽商银行 CD039 | 5,000,000 | 497,405,211.46 | 0.54 |
| 8 | 112416060 | 24 上海银行 CD060 | 5,000,000 | 497,091,540.20 | 0.54 |
| 8 | 112496737 | 24 苏州银行 CD071 | 5,000,000 | 497,091,540.20 | 0.54 |
| 8 | 112496783 | 24 杭州银行 CD063 | 5,000,000 | 497,091,540.20 | 0.54 |
| 9 | 112496778 | 24 杭州联合银行 CD031 | 5,000,000 | 497,077,155.41 | 0.54 |
| 10 | 112497380 | 24 长沙银行 CD092 | 5,000,000 | 496,921,440.38 | 0.54 |

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 | 0.0661% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0316% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0437% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明

本基金本报告期内每个交易日，负偏离度的绝对值均未超过 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况说明

本基金本报告期内每个交易日，正偏离度的绝对值均未超过 0.5%。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量 (份) | 按实际利率计算的 账面价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|---------|---------|------------------|---------------|
| 1 | 143715 | 徐租 36A1 | 250,000 | 12,422,063.89 | 0.01 |

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中,中国农业银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、上海银行股份有限公司本期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。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

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 | 1,499,494.81 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,499,494.81 |

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(%) |
| 中金现金管家 A | 42,636 | 2,403.19 | 5,201,050.90 | 5.08 | 97,261,513.87 | 94.92 |
| 中金现 | 677,831 | 22,761.05 | 8,906,760,241.42 | 57.73 | 6,521,384,080.24 | 42.27 |

| | | | | | | |
|----------|-----------|----------|------------------|-------|-------------------|-------|
| 金管家 B | | | | | | |
| 中金现金管家 C | 9,258,569 | 8,241.51 | 545,179,744.88 | 0.71 | 75,759,401,213.52 | 99.29 |
| 合计 | 9,979,036 | 9,202.81 | 9,457,141,037.20 | 10.30 | 82,378,046,807.63 | 89.70 |

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 | 1,821,675,066.06 | 1.98 |
| 2 | 其他机构 | 1,002,821,693.96 | 1.09 |
| 3 | 银行类机构 | 1,000,048,842.20 | 1.09 |
| 4 | 银行类机构 | 516,022,082.23 | 0.56 |
| 5 | 银行类机构 | 502,347,533.73 | 0.55 |
| 6 | 券商类机构 | 500,918,304.88 | 0.55 |
| 7 | 券商类机构 | 500,024,421.10 | 0.54 |
| 8 | 银行类机构 | 403,065,615.96 | 0.44 |
| 9 | 银行类机构 | 300,346,395.23 | 0.33 |
| 10 | 银行类机构 | 300,227,760.80 | 0.33 |

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 | 中金现金管家 A | 1,629,113.89 | 1.5900 |
| | 中金现金管家 B | 635,341.87 | 0.0041 |
| | 中金现金管家 C | 308,192.81 | 0.0004 |
| | 合计 | 2,572,648.57 | 0.0028 |

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 | 中金现金管家 A | 10~50 |
| | 中金现金管家 B | 10~50 |
| | 中金现金管家 C | 10~50 |
| | 合计 | 50~100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 中金现金管家 A | 0~10 |
| | 中金现金管家 B | 0 |
| | 中金现金管家 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 中金现金管家 A | 中金现金管家 B | 中金现金管家 C |
|---------------------|--------------|----------------|----------|
| 基金合同生效日（2014 年 11 月 | 3,245,429.82 | 399,076,299.81 | - |

| | | | |
|----------------|----------------|-------------------|--------------------|
| 28 日) 基金份额总额 | | | |
| 本报告期期初基金份额总额 | 87,679,191.14 | 6,979,819,664.40 | 58,300,220,728.36 |
| 本报告期基金总申购份额 | 231,752,451.44 | 66,971,443,901.29 | 626,747,835,804.21 |
| 减: 本报告期基金总赎回份额 | 216,969,077.81 | 58,523,119,244.03 | 608,743,475,574.17 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 102,462,564.77 | 15,428,144,321.66 | 76,304,580,958.40 |

注: 报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额; 基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金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

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2024 年 1 月 20 日, 本基金管理人发布公告, 李金泽先生自 2024 年 1 月 19 日起担任公司董事长、法定代表人; 宗喆先生自 2024 年 1 月 19 日起担任公司总经理、董事; 胡长生先生自 2024 年 1 月 19 日起不再担任公司董事长、法定代表人, 不再代履公司总经理职务。

2024 年 3 月 2 日, 本基金管理人发布公告, 宗喆先生自 2024 年 2 月 29 日起担任公司财务负责人。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内, 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

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙), 该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务, 无改聘情况。

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

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|------------------|-----------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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 (%) |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | 3,506,252,310.00 | 100.00 | - | - |

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内每个交易日，偏离度绝对值均未超过 0.5%。

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 | 中金基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-1-19 |
| 2 | 中金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 | 2024-1-19 |
| 3 | 中金基金管理有限公司董事长、高级管理人员变更公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-1-20 |
| 4 | 关于中金现金管家货币市场基金暂停大额申购（包括转换转入、定期定额投资）业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-2-6 |
| 5 | 中金基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-3-2 |
| 6 | 中金基金管理有限公司关于不法分子假冒“中金基金”名义进行诈骗活动的风险提示 | 中国证监会规定媒介 | 2024-3-22 |
| 7 | 中金基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-3-29 |
| 8 | 中金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 | 2024-3-29 |
| 9 | 中金基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-4-20 |
| 10 | 中金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 | 2024-4-20 |
| 11 | 关于中金现金管家货币市场基金暂停大额申购（包括转换转入、定期定额投资）业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-4-26 |
| 12 | 关于中金现金管家货币市场基金暂停大额申购（包括转换转入、定期定额投资）业务的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2024-5-9 |
| 13 | 中金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 | 中国证监会规定媒介 | 2024-5-15 |
| 14 | 中金现金管家货币市场基金基金产品资料概要更新 | 中国证监会规定媒介 | 2024-6-24 |

§ 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，本基金不存在单一投资者持有份额比例达到或超过总份额 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，本基金不存在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、中国证监会准予中金现金管家货币市场基金募集注册的文件
- 2、《中金现金管家货币市场基金基金合同》
- 3、《中金现金管家货币市场基金托管协议》
- 4、《中金现金管家货币市场基金招募说明书》及其更新
- 5、中金现金管家货币市场基金申请募集注册的法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批复、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批复、营业执照
- 8、报告期内中金现金管家货币市场基金在规定媒介上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

咨询电话：(86) 010-63211122 400-868-1166

传真：(86) 010-66159121

中金基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日