

# 国泰货币市场证券投资基金

## 2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年十月二十五日

## § 1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2024 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 07 月 01 日起至 2024 年 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	国泰货币
基金主代码	020007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 6 月 21 日
报告期末基金份额总额	82,975,724,101.84 份
投资目标	在保证本金安全和资产流动性最大化的前提下，追求超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金主要为投资者提供流动性现金管理工具，主要结合短期利率变动，合理安排债券组合期限和类属比例，在保证本金安全性、流动性的前提下，获得超过基准的较高收益。根据对宏观经济指标长期趋势的判断、市场预期相对于趋势偏离的程度和各类金融工具的流动性特征，决定组合中债券与其他资产的比例分布。考虑法律法规的相关规定、各类属资产的到期收益率、税收、相对收益差额及不同类属资产的流动性指标等因素决定债券组合的类属配置。通过期限配置和收益率曲线配置来建立债券组合。

业绩比较基准	同期 7 天通知存款利率（税后）	
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票基金、债券基金和混合型基金。	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国泰货币 A	国泰货币 B
下属分级基金的交易代码	020007	005253
报告期末下属分级基金的份额总额	1,671,502,120.92 份	81,304,221,980.92 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2024年7月1日-2024年9月30日)	
	国泰货币 A	国泰货币 B
1. 本期已实现收益	6,913,551.51	364,722,104.74
2. 本期利润	6,913,551.51	364,722,104.74
3. 期末基金资产净值	1,671,502,120.92	81,304,221,980.92

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 1、国泰货币 A：

阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.4037%	0.0008%	0.3393%	0.0000%	0.0644%	0.0008%
过去六个月	0.8644%	0.0009%	0.6750%	0.0000%	0.1894%	0.0009%
过去一年	1.9049%	0.0010%	1.3509%	0.0000%	0.5540%	0.0010%
过去三年	6.0676%	0.0010%	4.0509%	0.0000%	2.0167%	0.0010%
过去五年	10.9934%	0.0011%	6.7509%	0.0000%	4.2425%	0.0011%
自基金合同 生效起至今	67.5658%	0.0052%	30.8180%	0.0017%	36.7478%	0.0035%

## 2、国泰货币 B:

阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.4643%	0.0008%	0.3393%	0.0000%	0.1250%	0.0008%
过去六个月	0.9856%	0.0009%	0.6750%	0.0000%	0.3106%	0.0009%
过去一年	2.1500%	0.0010%	1.3509%	0.0000%	0.7991%	0.0010%
过去三年	6.8344%	0.0010%	4.0509%	0.0000%	2.7835%	0.0010%
自新增 B 类 份额起至今	10.4008%	0.0011%	5.8611%	0.0000%	4.5397%	0.0011%

注：(1)本基金收益分配按月结转份额。为了更好地满足投资人的理财需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《国泰货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定，基金管理人国泰基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经与基金托管人中国农业银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）协商一致，并报中国证监会备案，本公司决定自2019年5月7日起修改国泰货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”）的收益分配方式，变更前，本基金的收益分配采取“每日分配收益，按月结转份额”，即根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，每日为投资者计算当日收益并分配，每月集中支付收益。此次变更后，本基金的收益分配将采取“每日分配，按日支付”，即根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，每日为投资者计算当日收益并分配，每日进行支付。

(2)自2020年5月29日起，本基金增加B类基金份额并分别设置对应的基金代码。

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

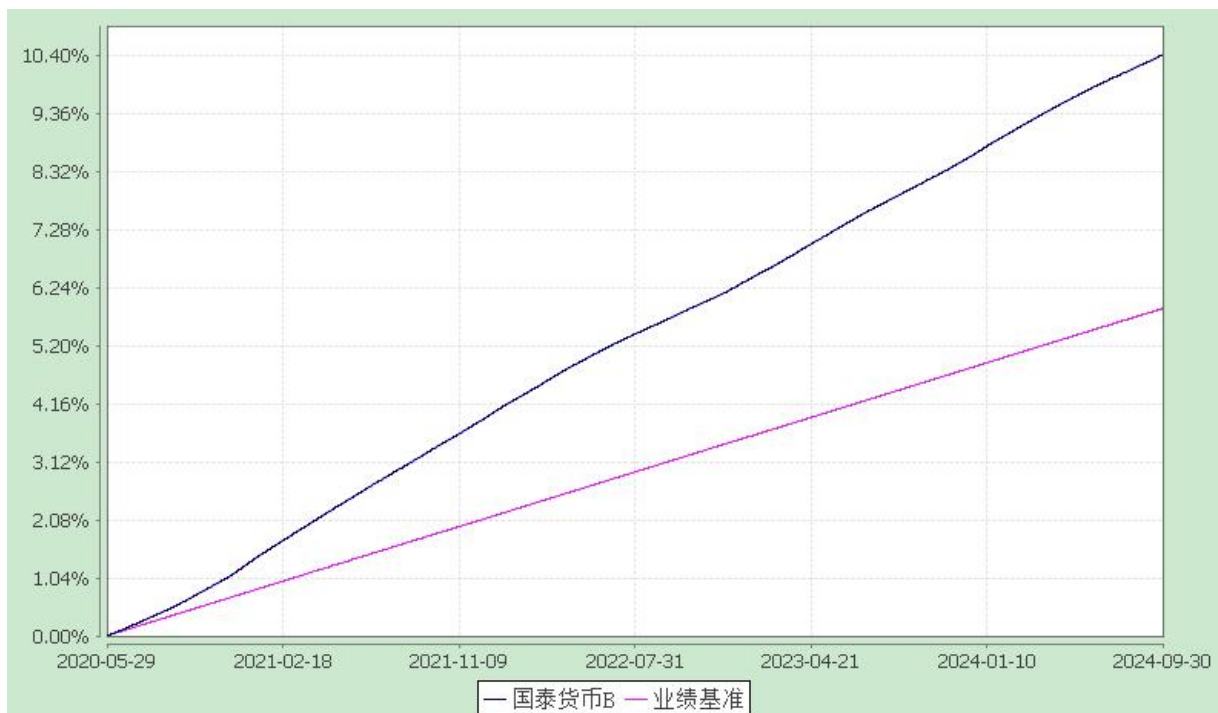
国泰货币市场证券投资基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2005 年 6 月 21 日至 2024 年 9 月 30 日)

1、国泰货币 A



2、国泰货币 B



注：(1)本基金合同生效日为2005年6月21日，本基金在一个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

(2)自2009年1月1日起，本基金的业绩比较基准变更为：同期7天通知存款利率（税后）。（详见2008年12月29日在《中国证券报》刊登的《关于变更国泰货币市场证券投资基金业绩比较基准和修改基金合同的公告》）

(3)自2020年5月29日起，本基金增加B类基金份额并分别设置对应的基金代码。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
丁士恒	国泰利是宝货币、国泰惠鑫一年定期开放债券、国泰货币、国泰现金管理货币、国泰瞬利货币 ETF、国泰利享中短债债券、国泰利享安益短债债券、国泰鑫鸿一年定期开放债券发起式、国泰利恒 30 天持有债券的基金经理	2020-05-15	-	10 年	硕士研究生。2014 年 1 月加入国泰基金，任交易员。2020 年 5 月起任国泰货币市场证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰利是宝货币市场基金、国泰瞬利交易型货币市场基金、国泰利享中短债债券型证券投资基金和国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2022 年 12 月起兼任国泰利享安益短债债券型证券投资基金的基金经理，2023 年 8 月起兼任国泰鑫鸿一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2024 年 3 月起兼任国泰利恒 30 天持有期债券型证券投资基金的基金经理。
陶然	国泰利是宝货币、国泰货币、国泰瞬利货币 ETF、国泰利享中短债债券、国泰利优 30 天滚	2020-07-07	-	13 年	硕士研究生，CFA。曾任职于海富通基金管理有限公司、华安基金管理有限公司、汇添富基金管理股份有限公司。2020 年 3 月加入国泰基

	<p>动持有短债债券、国泰利泽 90 天滚动持有中短债债券、国泰中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期、国泰利盈 60 天滚动持有中短债、国泰利安中短债债券、国泰润利纯债债券的基金经理</p>			<p>金，拟任基金经理。2020 年 7 月至 2022 年 8 月任国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，2020 年 7 月至 2022 年 11 月任国泰现金管理货币市场基金的基金经理，2020 年 7 月起任国泰货币市场证券投资基金、国泰利是宝货币市场基金、国泰瞬利交易型货币市场基金和国泰利享中短债债券型证券投资基金的基金经理，2021 年 6 月起兼任国泰利优 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理，2021 年 8 月起兼任国泰利泽 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金的基金经理，2022 年 5 月起兼任国泰中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理，2022 年 11 月起兼任国泰利盈 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金的基金经理，2022 年 12 月起兼任国泰利安中短债债券型证券投资基金的基金经理，2024 年 8 月起兼任国泰润利纯债债券型证券投资基金的基金经理。</p>
<p>周峥奇</p>	<p>国泰货币、国泰安益灵活配置混合的基金经理</p>	<p>2024-04-29</p>	<p>-</p>	<p>12 年</p> <p>硕士。曾任职于上海国际货币经纪有限责任公司、鑫元基金管理有限公司和中航信托股份有限公司。2024 年 4 月加入国泰基金，拟任基金经理。2024 年 4 月起任国泰货币市场证券投资基金的基金经理，2024 年 8 月起兼任国泰安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>

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

2、证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度债券收益率依然维持震荡下行趋势，季度末涨幅有一定缩小，收益率曲线牛陡。全季度周期内，由于央行降准降息叠加购买短债卖出长债，3 年国债下行较多。7 月收益率整体下行，央行宣布开展国债借入操作，此举旨在通过信用方式借入国债影响长端利率，中旬央行宣布降息使得收益率转为下行。8 月收益率先上后下，央行通过预期管理、借入国债、强监管、卖出国债等方式修正利率单边下行预期，债市有所调整。信用债表现不及利率债，后半段有一定修复。9 月受宏观政策刺



激以及股市提振影响，债市出现调整，在央行双降后公布支持资本市场的结构性货币政策工具，股债跷跷板效应显现。随后政治局会议超预期讨论经济，股市进一步上涨，债券收益率跟随上行。

三季度总体流动性合理充裕，DR007 均值 1.805%略高于政策利率。1 年同业存单在 1.83%-2.00% 区间震荡，短端利率于低位处小幅震荡，同业存款在季末银行回表的情况下，利率有一定提升。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类本报告期内的净值增长率为 0.4037%，同期业绩比较基准收益率为 0.3393%。

本基金 B 类本报告期内的净值增长率为 0.4643%，同期业绩比较基准收益率为 0.3393%。

#### 4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	54,017,896,065.77	54.47
	其中：债券	53,331,541,997.85	53.78
	资产支持证券	686,354,067.92	0.69
2	买入返售金融资产	12,228,889,625.33	12.33
	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	32,494,164,271.76	32.77
4	其他资产	425,915,521.69	0.43
5	合计	99,166,865,484.55	100.00

#### 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	6.22	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	14,603,501,015.81	17.60
	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比例取报告期内每交易日融资余额占基金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%。

## 5.3 基金投资组合平均剩余期限

### 5.3.1 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	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

### 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的平均剩余期限未超过120天。

### 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序	平均剩余期限	各期限资产占基金资产	各期限负债占基金资产净值
---	--------	------------	--------------

号		净值的比例 (%)	的比例 (%)
1	30天以内	40.11	19.47
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.71	-
2	30天（含）—60天	10.05	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.19	-
3	60天（含）—90天	32.08	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	7.68	-
4	90天（含）—120天	1.23	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	35.59	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	119.06	19.47

#### 5.4 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的平均剩余存续期未超过240天。

#### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	18,921,100,034.31	22.80

	其中：政策性金融债	14,762,470,421.23	17.79
4	企业债券	504,919,381.08	0.61
5	企业短期融资券	3,220,469,638.69	3.88
6	中期票据	1,065,990,052.39	1.28
7	同业存单	29,619,062,891.38	35.70
8	其他	-	-
9	合计	53,331,541,997.85	64.27
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	7,969,433,974.77	9.60

#### 5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	220214	22 国开 14	61,100,000	6,112,024,948.74	7.37
2	230214	23 国开 14	53,400,000	5,369,852,605.07	6.47
3	092318004	23 农发清发 04	10,100,000	1,010,481,095.84	1.22
4	112404051	24 中国银行 CD051	10,000,000	992,006,474.43	1.20
5	112420214	24 广发银行 CD214	10,000,000	991,373,498.48	1.19
6	112487095	24 南京银行 CD223	10,000,000	990,829,690.82	1.19
7	112421317	24 渤海银行 CD317	10,000,000	985,496,381.94	1.19
8	240214	24 国开 14	9,100,000	920,298,392.95	1.11
9	112419104	24 恒丰银行 CD104	8,500,000	845,815,576.60	1.02
10	2128035	21 华夏银行 02	6,800,000	696,073,573.34	0.84

#### 5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0 次
报告期内偏离度的最高值	0.1544%
报告期内偏离度的最低值	0.0787%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1264%

#### 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。

#### 5.8 报告期末按摊余成本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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	261296	37 欲晓 A2	2,000,000.00	203,988,757.22	0.25
2	262415	39 欲晓 A2	2,000,000.00	201,113,600.00	0.24
3	262414	39 欲晓 A1	1,000,000.00	100,528,832.88	0.12
4	262543	中交 22A	900,000.00	90,420,401.10	0.11
5	262417	瑞远 03A1	500,000.00	50,178,827.40	0.06
6	262787	中建保 3A	300,000.00	30,094,717.81	0.04
7	144497	高发 1A1	100,000.00	10,028,931.51	0.01

#### 5.9 投资组合报告附注

##### 5.9.1 基金计价方法说明

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

本基金通过每日分红使基金份额资产净值维持在 1.00 元。

5.9.2 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“恒丰银行、华夏银行、国开行、南京银行、中国银行、农发行、渤海银行、广发银行”违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

华夏银行下属分支机构因违规推介基金产品；贷款资金回流做保证金循环发放贷款；贷前调查不到位，发放贸易背景不真实的贷款；转嫁经营成本，违规由客户承担抵押登记费；个人经营性贷款“三查”不审慎等原因，受到监管机构公开处罚。

恒丰银行及其下属分支机构因违规收取信贷资金受托支付划拨费；互联网贷款信息披露不规范，为企业指定增信机构；未严格审查票据业务贸易背景真实性；代销业务不合规；业务方案未经合规风控人员合规审查并出具合规审查意见；未取得基金从业资格的人员从事基金销售活动；负责基金销售业务的部门取得基金从业资格的人员低于该部门员工人数的 1/2，部门负责人未取得基金从业资格；信贷业务违规；部分从事基金销售信息管理平台运营维护人员和合规风控人员未取得基金从业资格等原因，受到监管机构公开处罚。

农业发展银行下属分支机构因流动资金贷款受托支付审核不尽职；政策性业务资金超范围支付，偏离服务“三农”主责主业；未严格按照公布的收费价目名录收取融资顾问费；办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查；贷款业务严重违反审慎经营规则等原因，受到监管机构公开处罚。

南京银行及下属分支机构因票据业务贸易背景真实性审查不严；贷后管理不到位，贷款资金未按约定用途使用；虚增存贷款规模；办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理性审查；未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料；违反外汇登记管理规定；通过信贷资金或票据贴现资金虚增存款；发放首付不合规的个人住房按揭贷款等原因，受到监管机构公开处罚。

渤海银行下属分支机构因信贷资金管控不到位、异地贷款管理不审慎；发放虚假商用房按揭贷款且形成风险；贷款“三查”不到位、票据业务未纳入集团客户统一授信、违规转嫁成本；贷款资金转存银票保证金；房地产开发贷款管理不到位；普惠型小微企业贷款数据不真实；个人贷款贷后管理不到位；基金销售业务部门负责人、部分分支行基金销售业务负责人未取得基金从业资格；未将基金销售保有规模、投资人长期收益纳入分支机构和基金销售人员考核评价指标体系；违反存款准备金管理规定；违反人民币反假有关规定等原因，受到监管机构公开处罚。

国家开发银行及下属分支机构因贷款“三查”履职不到位；固定资产贷款未落实“实贷实付”管理要求；流动资金贷款用于政府项目垫资；内控制度执行不到位；未严格执行

内控制度,瞒报案件风险信息;员工管理不到位;违规收取小微企业贷款承诺费;违规转嫁抵押登记费和押品评估费;向不合规的项目发放贷款;固定资产贷款受托支付未收集用途资料,信贷资金挪用等原因,受到监管机构公开处罚。

中国银行及下属分支机构因办理经常项目资金收付,未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查;信贷资金用途管控不到位,贷款资金回流至母公司;信用卡汽车分期业务管理不审慎;员工行为管理及贷款业务严重违反审慎经营规则;员工行为管理及贷款业务严重违反审慎经营规则;违规报送统计报表等原因,受到监管机构公开处罚。

广发银行及下属分支机构因基金销售业务负责人、部分合规人员以及个别支行基金销售业务负责人未取得基金从业资格;小微企业划型不准确;违规发放房地产贷款、土地储备贷款;员工行为管理严重违反审慎经营规则;未对集团客户授信实行统一管理;违反人民币反假有关规定;违反人民币管理规定;占压财政存款或者资金;违反国库管理其他规定;违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定;未按规定履行客户身份识别义务;未按规定保存客户身份资料和交易记录;未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告;信用卡营销不规范;与身份不明的客户进行交易等原因,受到监管机构公开处罚。

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

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	68,022.51
2	应收证券清算款	294,576,645.21
3	应收利息	-
4	应收申购款	131,001,170.17
5	其他应收款	269,683.80
6	待摊费用	-

7	其他	-
8	合计	425,915,521.69

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰货币A	国泰货币B
本报告期期初基金份额总额	1,657,995,610.07	78,617,622,347.67
报告期期间基金总申购份额	2,023,088,241.37	19,400,182,186.50
报告期期间基金总赎回份额	2,009,581,730.52	16,713,582,553.25
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	1,671,502,120.92	81,304,221,980.92

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	红利再投	2024-07-01	142,120.27	0.00	-
2	红利再投	2024-07-02	49,883.42	0.00	-
3	红利再投	2024-07-03	52,259.64	0.00	-
4	红利再投	2024-07-04	44,980.03	0.00	-
5	红利再投	2024-07-05	44,614.65	0.00	-
6	红利再投	2024-07-08	134,543.60	0.00	-
7	红利再投	2024-07-09	47,035.49	0.00	-
8	红利再投	2024-07-10	50,460.95	0.00	-
9	红利再投	2024-07-11	49,724.41	0.00	-
10	红利再投	2024-07-12	43,004.37	0.00	-
11	红利再投	2024-07-15	141,664.87	0.00	-
12	红利再投	2024-07-16	56,790.64	0.00	-
13	红利再投	2024-07-17	47,727.90	0.00	-
14	红利再投	2024-07-18	44,925.81	0.00	-
15	红利再投	2024-07-19	46,255.56	0.00	-
16	红利再投	2024-07-22	123,604.57	0.00	-
17	红利再投	2024-07-23	59,023.98	0.00	-
18	红利再投	2024-07-24	42,324.35	0.00	-
19	红利再投	2024-07-25	48,324.37	0.00	-
20	红利再投	2024-07-26	41,512.74	0.00	-
21	红利再投	2024-07-29	135,989.19	0.00	-
22	红利再投	2024-07-30	51,937.43	0.00	-



23	红利再投	2024-07-31	60,145.13	0.00	-
24	红利再投	2024-08-01	42,909.55	0.00	-
25	红利再投	2024-08-02	46,397.81	0.00	-
26	红利再投	2024-08-05	133,239.18	0.00	-
27	红利再投	2024-08-06	43,461.16	0.00	-
28	红利再投	2024-08-07	54,161.68	0.00	-
29	申购	2024-08-07	300,000,000.00	300,000,000.00	-
30	红利再投	2024-08-08	56,494.63	0.00	-
31	红利再投	2024-08-09	55,624.81	0.00	-
32	红利再投	2024-08-12	173,333.89	0.00	-
33	红利再投	2024-08-13	68,072.46	0.00	-
34	红利再投	2024-08-14	56,783.42	0.00	-
35	红利再投	2024-08-15	65,752.26	0.00	-
36	红利再投	2024-08-16	60,439.29	0.00	-
37	红利再投	2024-08-19	190,710.86	0.00	-
38	红利再投	2024-08-20	55,145.36	0.00	-
39	赎回	2024-08-20	150,000,000.00	-150,000,000.00	-
40	红利再投	2024-08-21	79,637.19	0.00	-
41	红利再投	2024-08-22	63,675.45	0.00	-
42	红利再投	2024-08-23	59,715.18	0.00	-
43	红利再投	2024-08-26	140,337.23	0.00	-
44	红利再投	2024-08-27	54,070.74	0.00	-
45	红利再投	2024-08-28	55,997.89	0.00	-
46	红利再投	2024-08-29	58,898.15	0.00	-
47	红利再投	2024-08-30	46,184.20	0.00	-
48	红利再投	2024-09-02	147,509.52	0.00	-
49	红利再投	2024-09-03	51,558.06	0.00	-
50	红利再投	2024-09-04	57,633.59	0.00	-
51	红利再投	2024-09-05	53,168.96	0.00	-
52	红利再投	2024-09-06	61,332.31	0.00	-
53	红利再投	2024-09-09	162,028.14	0.00	-
54	红利再投	2024-09-10	48,356.59	0.00	-
55	红利再投	2024-09-11	56,780.01	0.00	-
56	红利再投	2024-09-12	54,371.42	0.00	-
57	赎回	2024-09-12	100,000,000.00	-100,000,000.00	-
58	红利再投	2024-09-13	53,632.94	0.00	-
59	红利再投	2024-09-18	241,780.65	0.00	-
60	红利再投	2024-09-19	95,906.42	0.00	-
61	红利再投	2024-09-20	44,696.30	0.00	-
62	红利再投	2024-09-23	128,250.35	0.00	-
63	红利再投	2024-09-24	77,865.66	0.00	-
64	红利再投	2024-09-25	48,336.80	0.00	-
65	红利再投	2024-09-26	53,113.87	0.00	-
66	红利再投	2024-09-27	47,764.43	0.00	-
67	红利再投	2024-09-30	146,682.60	0.00	-
68	赎回	2024-09-30	100,000,000.00	-100,000,000.00	-

合计			654,850,664.38	-50,000,000.00	
----	--	--	----------------	----------------	--

注：本基金管理人于本报告期内红利再投本基金的适用费用为0.00元。本基金管理人于本报告期内申购本基金的适用费用为0.00元。本基金管理人于本报告期内赎回本基金的适用费用为0.00元。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、关于核准国泰货币市场证券投资基金募集的批复
- 2、国泰货币市场证券投资基金基金合同
- 3、国泰货币市场证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

### 8.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层。

基金托管人住所。

### 8.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：(021) 31089000, 400-888-8688

客户投诉电话：(021) 31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司  
二〇二四年十月二十五日