

# 国泰瞬利交易型货币市场基金

## 2023 年第 2 季度报告

### 2023 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年七月二十一日

## §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 年 7 月 19 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。

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》和本基金基金合同的有关规定，本基金管理人经与本基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2023 年 4 月 28 日起调整本基金 A 类基金份额的销售服务费率，并相应修改基金合同等法律文件的相关条款。本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率由 0.25% 调整为 0.01%。具体可查阅本基金管理人于 2023 年 4 月 28 日发布的《国泰基金管理有限公司关于国泰瞬利交易型货币市场基金调整 A 类基金份额的销售服务费率并修改基金合同等法律文件的公告》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	国泰瞬利货币
基金主代码	511620
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017 年 8 月 4 日
报告期末基金份额总额	28,461,369,767.80 份
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。 1、本基金具体投资策略：（1）滚动配置策略；（2）久期控制策略；（3）套利策略；（4）时机选择策略。 2、参与证券质押业务。 3、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场证券投资基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

下属两级基金的基金简称	国泰瞬利货币 A	国泰瞬利货币 D	国泰瞬利货币 E
下属两级基金的交易代码	511620	015379	015380
报告期末下属两级基金的份额总额	2,838,454.56 份	28,458,314,026.71 份	217,286.53 份

注：国泰瞬利货币A级的份额面值为人民币100元，国泰瞬利货币D级、国泰瞬利货币E级的份额面值为人民币1元。

### §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(2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)		
	国泰瞬利货币 A	国泰瞬利货币 D	国泰瞬利货币 E
1.本期已实现收益	591,068.66	134,687,480.97	1,118.11
2.本期利润	591,068.66	134,687,480.97	1,118.11
3.期末基金资产净值	283,845,455.62	28,458,314,026.71	217,286.53

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、国泰瞬利货币 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	0.5596%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.2230%	0.0005%
过去六个月	1.0800%	0.0006%	0.6695%	0.0000%	0.4105%	0.0006%
过去一年	1.9351%	0.0012%	1.3500%	0.0000%	0.5851%	0.0012%
过去三年	5.1150%	0.0015%	4.0481%	0.0000%	1.0669%	0.0015%
过去五年	6.6751%	0.0019%	6.7500%	0.0000%	-0.0749%	0.0019%
自基金合同 生效起至今	8.3542%	0.0022%	7.9742%	0.0000%	0.3800%	0.0022%

##### 2、国泰瞬利货币 D:

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	0.5774%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.2408%	0.0005%

过去六个月	1.1576%	0.0005%	0.6695%	0.0000%	0.4881%	0.0005%
过去一年	2.1369%	0.0011%	1.3500%	0.0000%	0.7869%	0.0011%
自新增 D 类份额起至今	2.3067%	0.0017%	1.4314%	0.0000%	0.8753%	0.0017%

### 3、国泰瞬利货币 E:

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	0.5172%	0.0005%	0.3366%	0.0000%	0.1806%	0.0005%
过去六个月	1.0372%	0.0005%	0.6695%	0.0000%	0.3677%	0.0005%
过去一年	1.8945%	0.0011%	1.3500%	0.0000%	0.5445%	0.0011%
自新增 E 类份额起至今	2.4035%	0.0016%	1.7642%	0.0000%	0.6393%	0.0016%

注：本基金收益分配按日结转份额。

### 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

国泰瞬利交易型货币市场基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 8 月 4 日至 2023 年 6 月 30 日)

#### 1、国泰瞬利货币 A



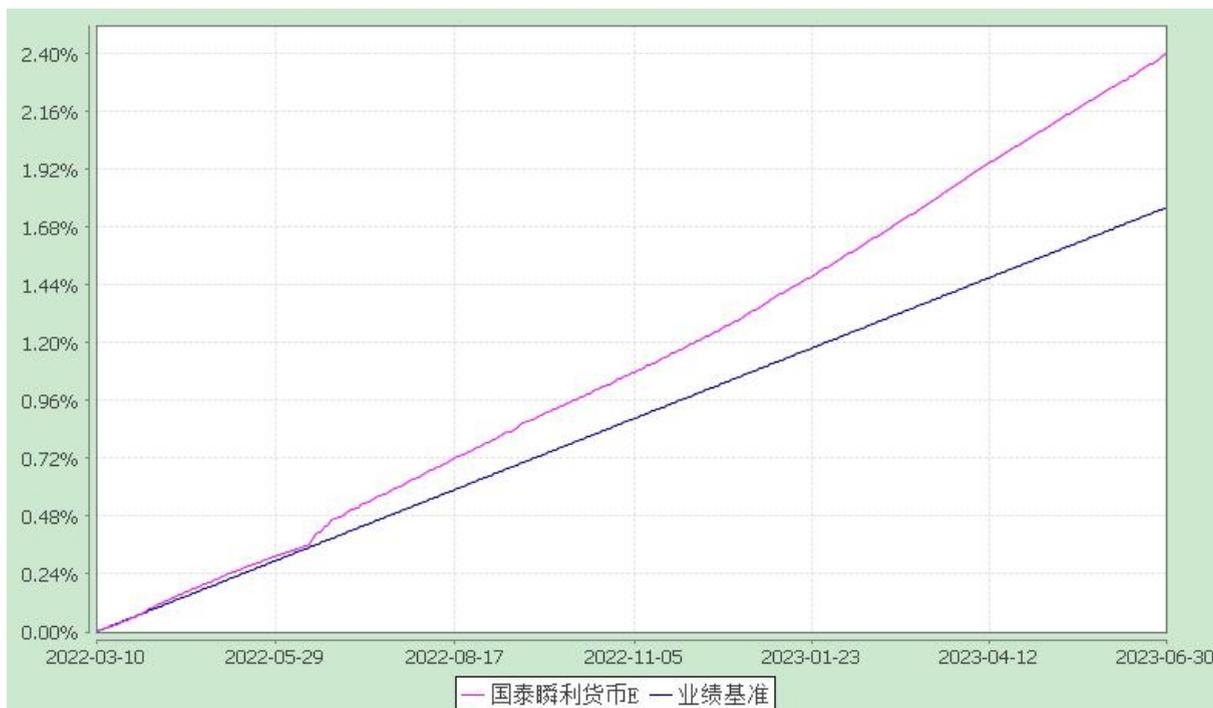
注：本基金的合同生效日为2017年8月4日。本基金在6个月建仓结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

#### 2、国泰瞬利货币 D



注：本基金自2017年8月4日合同生效。本基金在6个月建仓结束时，各项资产配置比例符合合同约定。自2022年3月10日起，本基金增加D类份额并分别设置对应的基金代码。自2022年6月9日起，D类开始有份额并计算净值。

### 3、国泰瞬利货币 E



注：本基金自2017年8月4日合同生效。本基金在6个月建仓结束时，各项资产配置比例符合合同

约定。自2022年3月10日起，本基金增加E类份额并分别设置对应的基金代码。自2022年3月11日起，E类开始有份额并计算净值。

## §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的基金经理	2020-05-15	-	9 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。
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的基金经理	2020-07-07	-	12 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

					<p>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。</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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《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所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所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 报告期内基金投资策略和运作分析

4月初公布的经济数据大幅低于市场预期，月末的政治局会议强调高质量发展不搞强刺激，各期限收益率下行。5月，银行陆续下调存款利率带动降息预期升温，信贷需求放缓，银行间流动性宽松，资金利率走低，短端收益率下行幅度较长端更大。6月中旬，OMO 利率超预期调降 10bp，带动各期限收益率快速下行。6月下半月，利率创新低后获利了结需求增加，跨季因素对流动性扰动增加，流动性分层加剧，多重利空因素作用下利率反弹。二季度流动性呈现出总量充裕，结构性短缺的特点，3M Shibor 利率窄幅波动，DR007 均值围绕公开市场操作利率小幅波动。

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，适当提升组合杠杆水平，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。

#### 4.5 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 0.5596%，同期业绩比较基准收益率为 0.3366%。

本基金 D 类本报告期内的净值增长率为 0.5774%，同期业绩比较基准收益率为 0.3366%。

本基金 E 类本报告期内的净值增长率为 0.5172%，同期业绩比较基准收益率为 0.3366%。

#### 4.6 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	16,634,906,333.02	52.89
	其中：债券	16,544,565,434.54	52.60
	资产支持证券	90,340,898.48	0.29
2	买入返售金融资产	9,385,396,160.86	29.84
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	5,321,888,488.38	16.92
4	其他资产	109,623,800.10	0.35
5	合计	31,451,814,782.36	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	4.09	
	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	2,700,341,570.09	9.39
	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个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	87
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	63

### 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	33.34	9.39
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	5.28	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	35.56	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	15.03	-
4	90天（含）—120天	3.51	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	31.39	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	109.08	9.39

### 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	6,065,075,494.12	21.10
	其中：政策性金融债	5,799,625,863.93	20.18
4	企业债券	164,089,870.63	0.57
5	企业短期融资券	4,620,562,445.17	16.08
6	中期票据	1,095,347,508.03	3.81
7	同业存单	4,599,490,116.59	16.00
8	其他	-	-
9	合计	16,544,565,434.54	57.56
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	4,325,142,466.09	15.05

**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	29,900,000	2,983,365,953.27	10.38
2	230214	23 国开 14	12,900,000	1,291,797,409.96	4.49
3	230201	23 国开 01	10,100,000	1,019,433,406.77	3.55
4	220411	22 农发 11	3,200,000	323,551,794.81	1.13
5	112393231	23 广州农村 商业银行 CD001	3,000,000	298,842,747.07	1.04
6	112321235	23 渤海银行 CD235	3,000,000	296,554,664.02	1.03
7	012283907	22 首钢 SCP006	2,500,000	252,350,048.74	0.88
8	112321115	23 渤海银行 CD115	2,500,000	246,775,355.13	0.86
9	112381422	23 台州银行 CD039	2,100,000	207,762,153.53	0.72
10	012380396	23 首钢 SCP001	2,000,000	201,394,014.73	0.70

**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	0.1508%
报告期内偏离度的最低值	0.0898%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1186%

**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	112706	恒信 03 优	900,000.00	90,340,898.48	0.31

### 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 A 类份额资产净值维持在 100.00 元，D 类和 E 类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“渤海银行、国开行、农发行、广州农商行”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。

渤海银行及下属分支机构因未执行统一授信；通过发放新授信业务掩盖资产质量，五级分类未准确反映信贷资产风险状况；贷后管理不到位；授信业务内部控制流程欠缺；接受未经董事会备案的财务公司股权质押；违规提供项目融资；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；合规风控人员未对基金新销售产品进行合规审查并出具合规审查意见；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；违反账户管理规定；违反清算管理规定；违反人民币反假有关规定；占压财政存款或者资金；违反国库科目设置和使用规定；违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；违反征信安全管理规定；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；与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户；小微企业贷款风险分类不准确；小微企业贷款资金被挪用于购买理财产品；将银行员工、公务员等个人商用房贷款计入普惠型个体工商户或小微企业主贷款统计口径；将非小微企业划归统计口径；违规发放商用房贷款等原因，受到监管机构公开处罚。

国家开发银行下属分支机构因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；流动资金贷款受托支付审查不尽职，对同一贸易背景进行重复融资；固定资产贷款受托支付未收集用途资料，信贷资金挪用；信贷资金被挪用于归还借款人本行前期贷款本金；银团贷款贷后管理不尽职；未严格执行受托支付；发放固定资产贷款未落实实贷实付要求；自营贷款承接本行理财融资等原因，受到监管机构公开处罚。

农业发展银行下属分支机构因未严格按照公布的收费价目名录收取融资顾问费；固定资产贷款贷后管理不到位，信贷资金未按约定用途使用；流动资金贷款贷后管理不到位，信贷资金实际用途与合同约定不符；未按规定进行贷款资金支付管理与控制；存贷挂钩，违规收取贷款保证金；未严格执行受托支付相关规定；未经任职资格审查任命高级管理人员；未落实“实贷实付”，以资金滞留方式

以贷转存；未按照合同约定条件，根据项目实际进度和资金需求发放贷款资金，贷款的管理严重违反审慎经营规则；项目资本金管理不到位、资本金被违规抽回；贷款管理不审慎、未严格对借款人还款来源和现金流进行监测分析；违规发放发放资本金比例不到位的项目贷款；贷款“三查”不到位；换领许可证未按规定进行公告；违规为不符合政府购买服务规定项目提供融资等原因，受到监管机构公开处罚。

广州农村商业银行股份有限公司因同业及理财业务严重违反审慎经营规则，配合现场检查不力等原因，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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,054.52
2	应收证券清算款	109,615,745.58
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	109,623,800.10

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰瞬利货币A	国泰瞬利货币D	国泰瞬利货币E
本报告期期初基金份额总额	233,884.63	17,560,045,537.29	216,167.34
本报告期基金总申购份额	4,183,668.16	14,208,584,760.25	1,119.19
本报告期基金总赎回份额	1,579,098.23	3,310,316,270.83	-
报告期期末基金份额总额	2,838,454.56	28,458,314,026.71	217,286.53

## §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-E类	2023-04-03	18.87	0.00	-
2	红利再投-A类	2023-04-03	20.00	0.00	-
3	红利再投-E类	2023-04-04	6.24	0.00	-
4	红利再投-A类	2023-04-04	6.00	0.00	-
5	红利再投-E类	2023-04-06	12.15	0.00	-
6	红利再投-A类	2023-04-06	13.00	0.00	-
7	红利再投-E类	2023-04-07	5.63	0.00	-
8	红利再投-A类	2023-04-07	6.00	0.00	-
9	红利再投-E类	2023-04-10	16.74	0.00	-

10	红利再投-A 类	2023-04-10	17.00	0.00	-
11	红利再投-E 类	2023-04-11	5.83	0.00	-
12	红利再投-A 类	2023-04-11	6.00	0.00	-
13	红利再投-E 类	2023-04-12	6.01	0.00	-
14	红利再投-A 类	2023-04-12	7.00	0.00	-
15	红利再投-A 类	2023-04-13	6.00	0.00	-
16	红利再投-E 类	2023-04-13	6.08	0.00	-
17	红利再投-A 类	2023-04-14	6.00	0.00	-
18	红利再投-E 类	2023-04-14	5.90	0.00	-
19	红利再投-A 类	2023-04-17	17.00	0.00	-
20	红利再投-E 类	2023-04-17	16.27	0.00	-
21	红利再投-A 类	2023-04-18	7.00	0.00	-
22	红利再投-E 类	2023-04-18	6.06	0.00	-
23	红利再投-A 类	2023-04-19	6.00	0.00	-
24	红利再投-E 类	2023-04-19	5.71	0.00	-
25	红利再投-A 类	2023-04-20	5.00	0.00	-
26	红利再投-E 类	2023-04-20	5.58	0.00	-
27	红利再投-E 类	2023-04-21	5.64	0.00	-
28	红利再投-A 类	2023-04-21	6.00	0.00	-
29	红利再投-E 类	2023-04-24	16.77	0.00	-
30	红利再投-A 类	2023-04-24	18.00	0.00	-
31	红利再投-E 类	2023-04-25	6.10	0.00	-
32	红利再投-A 类	2023-04-25	6.00	0.00	-
33	红利再投-E 类	2023-04-26	5.77	0.00	-
34	红利再投-A 类	2023-04-26	6.00	0.00	-
35	红利再投-E 类	2023-04-27	6.12	0.00	-
36	红利再投-A 类	2023-04-27	7.00	0.00	-
37	红利再投-A 类	2023-04-28	6.00	0.00	-
38	红利再投-E 类	2023-04-28	5.60	0.00	-
39	红利再投-A 类	2023-05-04	39.00	0.00	-
40	红利再投-E 类	2023-05-04	33.42	0.00	-
41	红利再投-E 类	2023-05-05	5.49	0.00	-
42	红利再投-A 类	2023-05-05	6.00	0.00	-
43	红利再投-E 类	2023-05-08	17.24	0.00	-
44	红利再投-A 类	2023-05-08	20.00	0.00	-
45	红利再投-A 类	2023-05-09	7.00	0.00	-
46	红利再投-E 类	2023-05-09	5.69	0.00	-
47	红利再投-A 类	2023-05-10	7.00	0.00	-
48	红利再投-E 类	2023-05-10	6.17	0.00	-
49	红利再投-A 类	2023-05-11	6.00	0.00	-
50	红利再投-E 类	2023-05-11	5.34	0.00	-
51	红利再投-E 类	2023-05-12	6.18	0.00	-
52	红利再投-A 类	2023-05-12	8.00	0.00	-
53	红利再投-A 类	2023-05-15	19.00	0.00	-
54	红利再投-E 类	2023-05-15	16.94	0.00	-
55	红利再投-A 类	2023-05-16	8.00	0.00	-

56	红利再投-E 类	2023-05-16	6.42	0.00	-
57	红利再投-E 类	2023-05-17	6.33	0.00	-
58	红利再投-A 类	2023-05-17	7.00	0.00	-
59	红利再投-A 类	2023-05-18	6.00	0.00	-
60	红利再投-E 类	2023-05-18	5.26	0.00	-
61	红利再投-A 类	2023-05-19	7.00	0.00	-
62	红利再投-E 类	2023-05-19	5.30	0.00	-
63	红利再投-E 类	2023-05-22	15.97	0.00	-
64	红利再投-A 类	2023-05-22	18.00	0.00	-
65	红利再投-A 类	2023-05-23	7.00	0.00	-
66	红利再投-E 类	2023-05-23	5.33	0.00	-
67	红利再投-E 类	2023-05-24	5.91	0.00	-
68	红利再投-A 类	2023-05-24	6.00	0.00	-
69	红利再投-E 类	2023-05-25	5.49	0.00	-
70	红利再投-A 类	2023-05-25	7.00	0.00	-
71	红利再投-E 类	2023-05-26	6.82	0.00	-
72	红利再投-A 类	2023-05-26	8.00	0.00	-
73	红利再投-E 类	2023-05-29	15.79	0.00	-
74	红利再投-A 类	2023-05-29	18.00	0.00	-
75	红利再投-E 类	2023-05-30	5.33	0.00	-
76	红利再投-A 类	2023-05-30	7.00	0.00	-
77	红利再投-A 类	2023-05-31	6.00	0.00	-
78	红利再投-E 类	2023-05-31	5.40	0.00	-
79	红利再投-A 类	2023-06-01	7.00	0.00	-
80	红利再投-E 类	2023-06-01	5.74	0.00	-
81	红利再投-E 类	2023-06-02	5.97	0.00	-
82	红利再投-A 类	2023-06-02	7.00	0.00	-
83	红利再投-E 类	2023-06-05	16.49	0.00	-
84	红利再投-A 类	2023-06-05	19.00	0.00	-
85	红利再投-A 类	2023-06-06	7.00	0.00	-
86	红利再投-E 类	2023-06-06	6.17	0.00	-
87	红利再投-A 类	2023-06-07	7.00	0.00	-
88	红利再投-E 类	2023-06-07	6.04	0.00	-
89	红利再投-A 类	2023-06-08	6.00	0.00	-
90	红利再投-E 类	2023-06-08	5.01	0.00	-
91	红利再投-E 类	2023-06-09	5.67	0.00	-
92	红利再投-A 类	2023-06-09	7.00	0.00	-
93	红利再投-A 类	2023-06-12	18.00	0.00	-
94	红利再投-E 类	2023-06-12	15.14	0.00	-
95	红利再投-A 类	2023-06-13	6.00	0.00	-
96	红利再投-E 类	2023-06-13	4.96	0.00	-
97	红利再投-E 类	2023-06-14	6.29	0.00	-
98	红利再投-A 类	2023-06-14	7.00	0.00	-
99	红利再投-A 类	2023-06-15	8.00	0.00	-
100	红利再投-E 类	2023-06-15	6.69	0.00	-
101	红利再投-A 类	2023-06-16	6.00	0.00	-

102	红利再投-E 类	2023-06-16	5.94	0.00	-
103	红利再投-E 类	2023-06-19	15.88	0.00	-
104	红利再投-A 类	2023-06-19	19.00	0.00	-
105	红利再投-A 类	2023-06-20	7.00	0.00	-
106	红利再投-E 类	2023-06-20	5.47	0.00	-
107	红利再投-E 类	2023-06-21	6.05	0.00	-
108	红利再投-A 类	2023-06-21	7.00	0.00	-
109	红利再投-E 类	2023-06-26	28.07	0.00	-
110	红利再投-A 类	2023-06-26	33.00	0.00	-
111	红利再投-E 类	2023-06-27	5.98	0.00	-
112	红利再投-A 类	2023-06-27	6.00	0.00	-
113	红利再投-E 类	2023-06-28	7.15	0.00	-
114	红利再投-A 类	2023-06-28	9.00	0.00	-
115	红利再投-E 类	2023-06-29	7.39	0.00	-
116	红利再投-A 类	2023-06-29	8.00	0.00	-
117	红利再投-A 类	2023-06-30	7.00	0.00	-
118	红利再投-E 类	2023-06-30	5.88	0.00	-
合计			1,109.87	0.00	

注：本基金管理人于本报告期内红利再投-A类本基金的适用费用为0.00元，份额面值为人民币100.00元。本基金管理人于本报告期内红利再投-E类本基金的适用费用为0.00元，份额面值为人民币1.00元。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 影响投资者决策的其他重要信息

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》和本基金基金合同的有关规定，本基金管理人经与本基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定自 2023 年 4 月 28 日起调整本基金 A 类基金份额的销售服务费率，并相应修改基金合同等法律文件的相关条款。本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率由 0.25% 调整为 0.01%。具体可查阅本基金管理人于 2023 年 4 月 28 日发布的《国泰基金管理有限公司关于国泰瞬利交易型货币市场基金调整 A 类基金份额的销售服务费率并修改基金合同等法律文件的公告》。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、国泰瞬利交易型货币市场基金基金合同
- 2、国泰瞬利交易型货币市场基金托管协议
- 3、关于准予国泰瞬利交易型货币市场基金注册的批复
- 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

## 9.2 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 16 层-19 层。

基金托管人住所。

## 9.3 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  
二〇二三年七月二十一日