

国泰货币市场证券投资基金

2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 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：二〇二二年一月二十四日

§ 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 2022 年 1 月 20 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 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 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	52,687,073,359.45 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	1,822,154,887.62 份	50,864,918,471.83 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(2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日)	
	国泰货币 A	国泰货币 B
1. 本期已实现收益	10,528,841.44	291,145,304.23
2. 本期利润	10,528,841.44	291,145,304.23
3. 期末基金资产净值	1,822,154,887.62	50,864,918,471.83

注：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。

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	①-③	②-④
----	------------	---------------	----------------	----------------	-----	-----

				准差④		
过去三个月	0.5820%	0.0009%	0.3403%	0.0000%	0.2417%	0.0009%
过去六个月	1.1588%	0.0008%	0.6805%	0.0000%	0.4783%	0.0008%
过去一年	2.3893%	0.0008%	1.3500%	0.0000%	1.0393%	0.0008%
过去三年	6.9510%	0.0013%	4.0500%	0.0000%	2.9010%	0.0013%
过去五年	14.4244%	0.0021%	6.7500%	0.0000%	7.6744%	0.0021%
自基金合同生效起至今	58.8996%	0.0056%	27.1073%	0.0019%	31.7923%	0.0037%

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	0.6429%	0.0009%	0.3403%	0.0000%	0.3026%	0.0009%
过去六个月	1.2813%	0.0008%	0.6805%	0.0000%	0.6008%	0.0008%
过去一年	2.6358%	0.0008%	1.3500%	0.0000%	1.2858%	0.0008%
自新增 B 类 份额起至今	4.0027%	0.0012%	2.1504%	0.0000%	1.8523%	0.0012%

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。

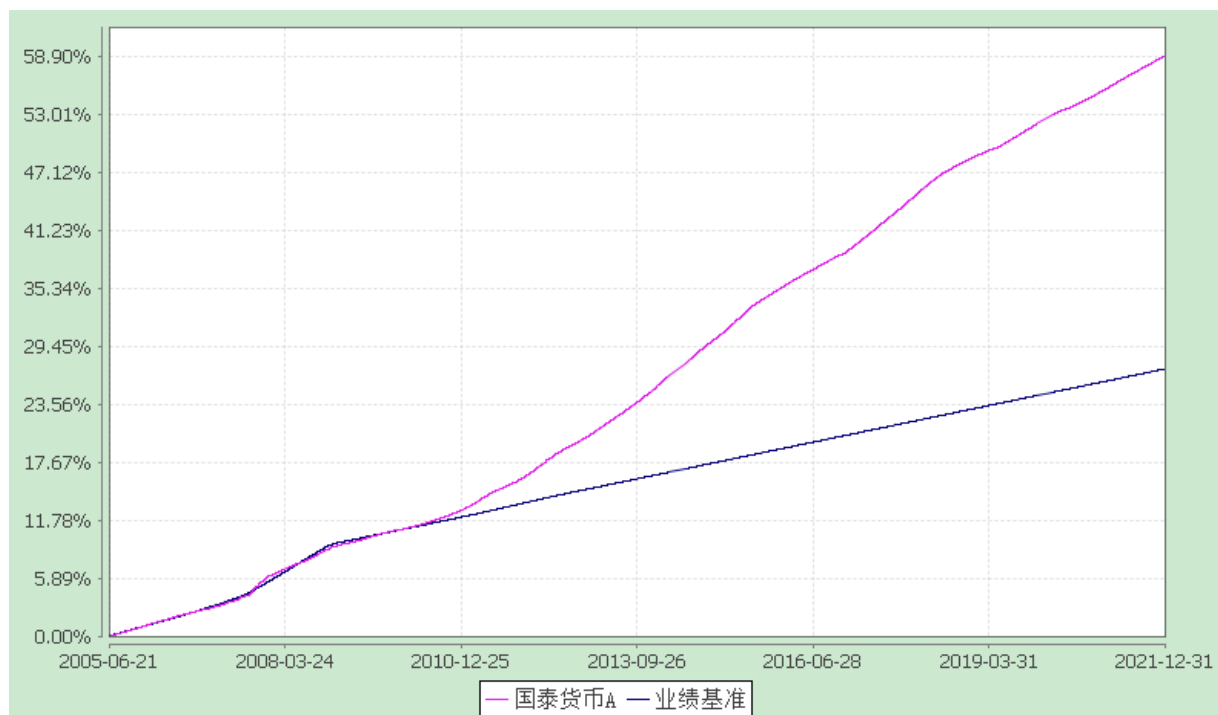
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰货币市场证券投资基金

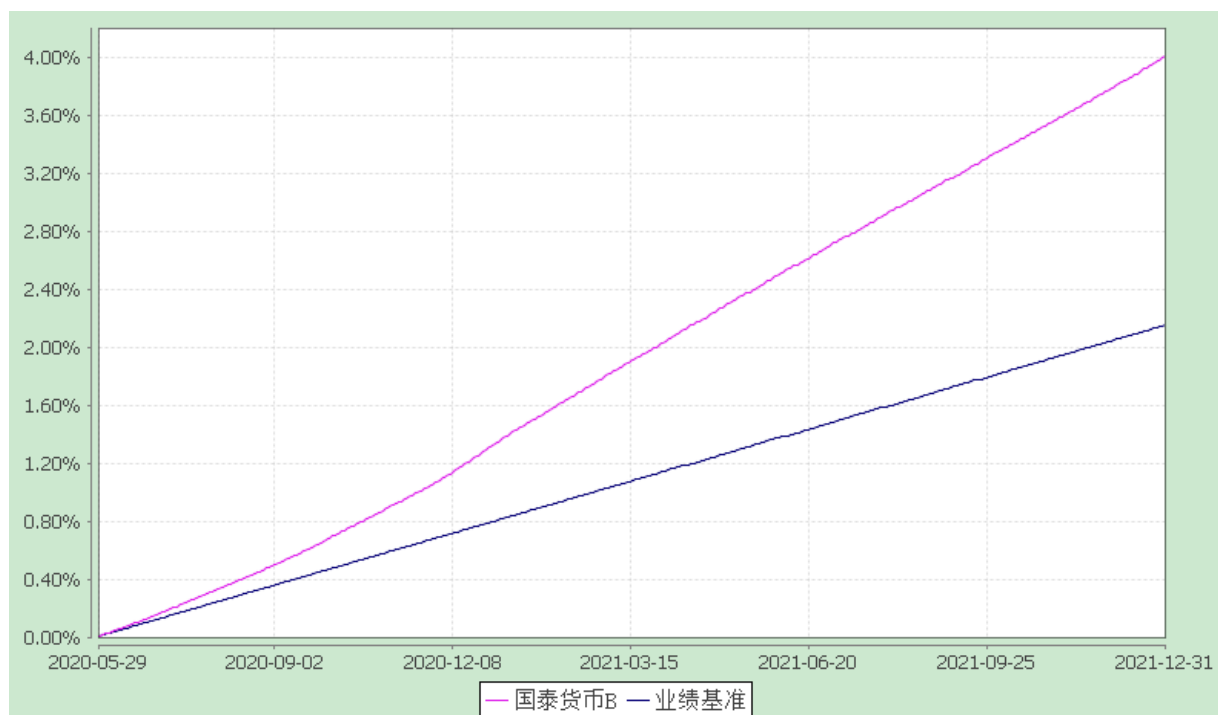
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2005 年 6 月 21 日至 2021 年 12 月 31 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的基金经理	2020-05-15	-	8 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。
陶然	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的基金经理	2020-07-07	-	11 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、汇添富基金管理有限公司。2020 年 3 月加入国泰基金，拟任基金经理。2020 年 7 月起任国泰惠鑫一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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。
--	--	--	--	--	--

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 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《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，基金管理小组保持独立运作，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

四季度国内经济进一步放缓。房地产信用风险加大的情况下，房企放慢了拿地、投资的节奏，

房地产销售面积亦明显回落，项目储备不足及财政支出进度滞后下基建仍未发力，消费受到局部散发疫情和疫情防控政策的压制，出口仍保持较强的韧性是四季度经济唯一的亮点。通胀方面，原材料、能源价格回落带动 PPI 见顶回落，猪肉、蔬菜价格带动 CPI 小幅回升。

市场方面，四季度资金面合理充裕，12 月央行实施全面降准 0.5 个百分点，释放流动性 1.2 万亿，资金价格整体处于较低水平，3M shibor 利率在低位窄幅波动，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，主动把握短期利率高位震荡的机会，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 类在 2021 年第四季度的净值增长率为 0.5820%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

本基金 B 类在 2021 年第四季度的净值增长率为 0.6429%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年 12 月中央经济工作会议和四季度央行货币政策委员会上均提到疫情演变、外部环境复杂不确定和我国国内经济面临的需求收缩、供给冲击和预期转弱三重压力。央行强调跨周期与逆周期结合，并加大跨周期力度。要求发挥货币政策的总量和结构双重功能，总量发力意图更强。预计后续在宽信用、降低企业融资成本等方面将继续发力。同时货币政策也将为财政政策的积极落实提供合理充裕的流动性大环境。债券市场将在由宽货币向宽信用的传导过程中重新定价利率中枢区间。

我们会在密切跟踪基本面、政策面和资金面的前提下，做好各类别资产配置以及比例的动态调整。同时，严防信用风险，规避高风险主体。组合将延续积极的投资策略，为持有人在管理好流动性的前提下获取持续稳定的投资回报。

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	34,537,459,650.63	56.33
	其中：债券	33,617,453,736.15	54.83
	资产支持证券	920,005,914.48	1.50
2	买入返售金融资产	16,499,638,708.91	26.91
	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	10,124,798,178.38	16.51
4	其他资产	148,295,673.19	0.24
5	合计	61,310,192,211.11	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	3.73	
	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	8,602,077,436.83	16.33
	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	39

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	35.14	16.33
	其中：剩余存续期超过 397天的浮动利率债	—	—
2	30天（含）—60天	8.79	—
	其中：剩余存续期超过 397天的浮动利率债	—	—
3	60天（含）—90天	33.69	—
	其中：剩余存续期超过 397天的浮动利率债	—	—
4	90天（含）—120天	3.47	—
	其中：剩余存续期超过 397天的浮动利率债	—	—
5	120天（含）—397天 （含）	35.00	—
	其中：剩余存续期超过	—	—

	397天的浮动利率债		
	合计	116.09	16.33

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	507,907,877.25	0.96
2	央行票据	—	—
3	金融债券	2,417,140,766.15	4.59
	其中：政策性金融债	2,196,801,093.09	4.17
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	5,760,804,063.76	10.93
6	中期票据	243,220,204.04	0.46
7	同业存单	24,688,380,824.95	46.86
8	其他	—	—
9	合计	33,617,453,736.15	63.81
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	—	—

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	112177681	21 宁波银行 CD358	21,000,000	2,086,972,805.39	3.96
2	112187068	21 上海农商银行 CD027	10,000,000	996,649,435.29	1.89

3	112119408	21 恒丰银行 CD408	10,000,000	993,556,949.50	1.89
4	112121482	21 渤海银行 CD482	10,000,000	986,602,439.75	1.87
5	112106059	21 交通银行 CD059	8,000,000	796,444,489.20	1.51
6	112177875	21 贵州银行 CD110	8,000,000	794,731,338.18	1.51
7	112119395	21 恒丰银行 CD395	6,000,000	596,323,612.16	1.13
8	112177877	21 中原银行 CD425	6,000,000	596,119,500.86	1.13
9	112118330	21 华夏银行 CD330	6,000,000	592,284,828.62	1.12
9	112120299	21 广发银行 CD299	6,000,000	592,284,828.62	1.12

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	0.0634%
报告期内偏离度的最低值	0.0091%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0381%

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	183092	欲晓 23A1	2,800,000.00	280,000,000.00	0.53
2	183067	长兴 05A1	2,700,000.00	270,000,000.00	0.51

3	136262	创享 02A1	2,000,000.00	200,000,000.00	0.38
4	136614	创享 03A1	1,000,000.00	100,000,000.00	0.19
5	137934	鹏程 10A1	400,000.00	40,005,914.48	0.08
6	136349	徐矿 25A	300,000.00	30,000,000.00	0.06

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“渤海银行、广发银行、贵州银行、恒丰银行、华夏银行、交通银行、宁波银行、上海农商银行、中原银行”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。

渤海银行及下属分支机构因政府购买服务项目贷款不合规；违规向资本金不足的房地产项目发放贷款；违规向四证不全的房地产项目发放贷款；违规通过同业投资或理财募集资金为四证不全的房地产项目提供融资；违规发放土地储备贷款；重大关联交易未经董事会批准；一般关联交易未按程序审批；内部审计严重不足；瞒报案件（风险）信息；发放流动资金贷款未测算营运资金需求；对个别客户环保政策执行情况调查不尽职；向房地产开发企业发放流动资金贷款；房地产开发贷款授信金额超过项目备案总投资；未落实授信审批条件发放贷款；未按规定执行受托支付；未有效监控贷款使用情况以致贷款被挪用；贷款风险分类不审慎；为代为推介的信托产品到期兑付提供流动性支持；未在官网公示代为推介的信托产品相关信息；银行承兑汇票保证金管理不规范；未严格审核银行承兑汇票贸易背景真实性；部分分行出具与事实不符的理财业务投资情况报告；部分转贴现票据风险加权资产计提不准确；自营业务与代客业务未有效分离；理财产品之间风险未完全隔离；非标准化债权资产占比超监管指标；理财信息登记不准确；理财资金为客户入股其他商业银行提供融资；理财产品信息披露不到位；风险揭示书存在问题；理财资金用于开立本行定期存单；投向权益类资产及集合资金信托计划的理财产品面向一般个人客户销售；单一信贷资产类理财产品期限与标的资产期限不一致及组

合信贷类理财产品高流动性资产低于监管要求；未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告等原因，多次受到监管机构处罚。

广发银行及下属分支机构因员工行为管理、处置不当；同业银行结算账户内控管理不到位；违规办理商业承兑汇票业务；违规办理同业理财业务；经营状况不真实；未对支付机构违反规定使用客户备付金的申请或指令予以拒绝；未按照规定处理异议；未按规定履行客户身份识别义务；未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；收单机构超范围使用外包服务；超过期限或未向中国人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料等原因，多次受到监管机构处罚。

贵州银行及下属分支机构因办理无真实贸易背景的承兑汇票业务；大额风险暴露管理整体缺位；股权管理混乱，未按规定进行股权质押；关联交易管理薄弱，向关系人（关联方）发放信用贷款；逆程序调整内部机构设置，理财产品相互调节收益、部分理财投资业务不审慎；同业授信流于形式、部分同业业务不审慎；违规借助通道发放委托贷款，资金用于限制性领域；因个人线上消费贷款业务内控机制不健全、资金监控不力；贷款“三查”不尽职，信贷资金被挪用等原因，多次受到监管机构处罚。

恒丰银行及下属分支机构因虚增存贷款；信贷资金流入限制性领域；违规发放流动资金贷款；资产质量反映不真实；项目融资“三查”严重不到位；借名贷款等案由；存单质押办理不合规等原因，多次受到监管机构处罚。

华夏银行及下属分支机构因以多种方式违规掩盖风险；贷款管理不到位，违规挪用信贷资金收购不良资产互联网贷款利率宣传不规范，侵害消费者知情权；违规向贷款客户转嫁成本；违规查询、存储、传输和使用个人客户信息，侵害消费者信息安全权；贷款“三查”不尽职；监控不力，贷款资金被挪用；违规向资本金不足的房地产开发贷款项目发放贷款；委托贷款资金违规流向房地产市场；内部控制不到位，发放借名贷款；银行承兑汇票贴现资金回流出票人，部分作为质押存单滚动开立银行承兑汇票；流动资金贷款用于固定资产项目垫资；个人出国金融贷款业务存在以贷转存；掩盖资产质量；转嫁成本或变相提高企业融资成本等原因，多次受到监管机构处罚。

交通银行及下属分支机构因理财业务和同业业务制度不健全；理财业务风险隔离不到位，利用本行表内自有资金为本行表外理财产品提供融资；部分理财业务发展与监管导向不符；理财业务数据与事实不符；理财资金违规投向土地储备项目；面向非机构投资

者发行的理财产品投资不良资产支持证券；理财资金违规投向交易所上市交易的股票；结构性存款产品衍生品交易无真实交易对手和交易行为；未严格审查委托贷款资金来源；违规向委托贷款借款人收取手续费；利用理财资金与他行互投不良资产收益权，实现不良资产虚假出表；违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定等原因，多次受到监管机构处罚。

宁波银行及下属分支机构因违规为存款人多头开立银行结算账户；超过期限或未向中国人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料；占压财政存款；未按照规定履行客户身份识别义务；未按照规定报送大额交易报告和可疑交易报告；与身份不明的客户进行交易或者为客；贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储；开发贷款支用审核不严；房地产贷款放款和支用环节审核不严；贷款资金违规流入房市；房地产贷款资金回流借款人；票据业务开展不审慎等原因，多次受到监管机构处罚。

上海农商银行及下属分支机构因未按照规定履行客户身份识别义务；未按照规定保存客户身份资料和交易记录；未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告等原因，受到监管机构处罚。

中原银行及下属分支机构因“内控先行”执行不到位；个贷业务流程调整不审慎；审批系统对风险审查评估不到位；迟报案件信息；未按规定办理抵押登记导致形成案件；未按规定报送财务会计报告、统计报表等资料未按规定进行国际收支统计申报；违反外汇账户管理规定；违反外汇登记管理规定；拒绝、阻碍外汇管理机关依法进行监督检查或者调查等原因，多次受到监管机构处罚。

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	6,245.20
2	应收证券清算款	1,271,925.86
3	应收利息	127,620,044.84

4	应收申购款	19,127,773.49
5	其他应收款	269,683.80
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	148,295,673.19

§ 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	1,859,557,758.09	41,328,565,945.39
报告期期间基金总申购份额	1,963,996,471.54	21,026,283,459.70
报告期期间基金总赎回份额	2,001,399,342.01	11,489,930,933.26
报告期期间基金拆分变动份额	—	—
报告期期末基金份额总额	1,822,154,887.62	50,864,918,471.83

§ 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	2021-10-08	409,191.66	0.00	—
2	赎回	2021-10-08	100,000,000.00	-100,000,000.00	—
3	红利再投	2021-10-11	137,921.08	0.00	—
4	赎回	2021-10-11	100,000,000.00	-100,000,000.00	—
5	红利再投	2021-10-12	39,959.46	0.00	—
6	红利再投	2021-10-13	37,620.52	0.00	—
7	红利再投	2021-10-14	43,050.56	0.00	—
8	红利再投	2021-10-15	40,717.00	0.00	—
9	红利再投	2021-10-18	108,232.25	0.00	—
10	红利再投	2021-10-19	39,684.75	0.00	—
11	红利再投	2021-10-20	39,729.86	0.00	—
12	红利再投	2021-10-21	39,076.99	0.00	—
13	红利再投	2021-10-22	38,057.70	0.00	—
14	红利再投	2021-10-25	116,429.95	0.00	—
15	申购	2021-10-25	25,000,000.00	25,000,000.00	—
16	红利再投	2021-10-26	37,556.82	0.00	—
17	红利再投	2021-10-27	39,697.00	0.00	—
18	红利再投	2021-10-28	38,600.30	0.00	—

19	红利再投	2021-10-29	38,972.73	0.00	-
20	红利再投	2021-11-01	123,264.53	0.00	-
21	红利再投	2021-11-02	44,213.57	0.00	-
22	红利再投	2021-11-03	37,067.36	0.00	-
23	红利再投	2021-11-04	34,010.95	0.00	-
24	红利再投	2021-11-05	38,510.43	0.00	-
25	红利再投	2021-11-08	119,183.52	0.00	-
26	红利再投	2021-11-09	47,950.44	0.00	-
27	红利再投	2021-11-10	40,324.52	0.00	-
28	红利再投	2021-11-11	35,909.53	0.00	-
29	红利再投	2021-11-12	39,223.85	0.00	-
30	红利再投	2021-11-15	113,206.22	0.00	-
31	红利再投	2021-11-16	50,814.90	0.00	-
32	红利再投	2021-11-17	41,886.81	0.00	-
33	红利再投	2021-11-18	42,706.64	0.00	-
34	红利再投	2021-11-19	35,963.41	0.00	-
35	红利再投	2021-11-22	114,616.87	0.00	-
36	红利再投	2021-11-23	50,106.01	0.00	-
37	红利再投	2021-11-24	46,536.71	0.00	-
38	红利再投	2021-11-25	37,241.70	0.00	-
39	红利再投	2021-11-26	41,808.86	0.00	-
40	红利再投	2021-11-29	124,787.06	0.00	-
41	红利再投	2021-11-30	46,463.67	0.00	-
42	红利再投	2021-12-01	40,266.29	0.00	-
43	红利再投	2021-12-02	43,635.79	0.00	-
44	红利再投	2021-12-03	39,926.74	0.00	-
45	红利再投	2021-12-06	113,070.73	0.00	-
46	红利再投	2021-12-07	67,346.60	0.00	-
47	红利再投	2021-12-08	38,890.06	0.00	-
48	红利再投	2021-12-09	36,773.42	0.00	-
49	红利再投	2021-12-10	36,437.12	0.00	-
50	红利再投	2021-12-13	109,444.07	0.00	-
51	红利再投	2021-12-14	49,449.43	0.00	-
52	红利再投	2021-12-15	50,823.26	0.00	-
53	红利再投	2021-12-16	37,257.24	0.00	-
54	红利再投	2021-12-17	36,741.51	0.00	-
55	红利再投	2021-12-20	129,150.32	0.00	-
56	红利再投	2021-12-21	55,422.63	0.00	-
57	红利再投	2021-12-22	36,892.42	0.00	-
58	红利再投	2021-12-23	44,391.17	0.00	-
59	红利再投	2021-12-24	40,959.89	0.00	-
60	赎回	2021-12-24	50,000,000.00	-50,000,000.00	-
61	红利再投	2021-12-27	114,002.44	0.00	-
62	红利再投	2021-12-28	52,789.58	0.00	-
63	红利再投	2021-12-29	43,255.99	0.00	-
64	红利再投	2021-12-30	38,322.20	0.00	-

65	红利再投	2021-12-31	39,391.42	0.00	-
合计			278,844,936.51	-225,000,000.00	

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16层-19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
二〇二二年一月二十四日