

国联现金添利货币型集合资产管理计划

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:国联证券资产管理有限公司

基金托管人:中国证券登记结算有限责任公司

报告送出日期:2024 年 08 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会、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。本中期报告由董事长签发。

集合计划托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本集合计划资产管理合同规定，于2024年08月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润情况、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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用计划资产，但不保证计划一定盈利。

集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本资产管理计划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01月01日起至2024年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
3.3 其他指标	6
§ 4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	9
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	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	10
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	13
6.4 报表附注	14
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 债券回购融资情况	34
7.3 基金投资组合平均剩余期限	34
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	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	35
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	35
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	36
7.8 期末按公允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	36
7.9 投资组合报告附注	36
§ 8 基金份额持有人信息	37
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	37

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	37
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	38
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	38
§ 9 开放式基金份额变动	38
§ 10 重大事件揭示	38
10.1 基金份额持有人大会决议	39
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	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	39
10.4 基金投资策略的改变	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	39
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	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	39
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	40
10.9 其他重大事件	40
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	42
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	42
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	42
§ 12 备查文件目录	43
12.1 备查文件目录	43
12.2 存放地点	43
12.3 查阅方式	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联现金添利货币型集合资产管理计划
基金简称	国联现金添利货币
基金主代码	970159
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 05 月 09 日
基金管理人	国联证券资产管理有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司
报告期末基金份额总额	3,407,071,056.28 份
基金合同存续期	本集合计划存续期限为自本合同生效日起三年。

注：本报告所述“基金”包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

2.2 基金产品说明

投资目标	安全性和流动性优先，在此基础上追求适度收益。
投资策略	本集合计划采用的主要投资策略包括资产配置策略、久期管理策略、个券选择策略、利用短期市场机会的灵活策略、现金流管理策略等。
业绩比较基准	本集合计划采用”同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）“作为业绩比较基准。
风险收益特征	本集合计划的类型为货币型集合资产管理计划，预期收益和预期风险低于债券型基金、债券型集合资产管理计划、股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金、混合型集合资产管理计划。

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		国联证券资产管理有限公司	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露负责人	姓名	贺巍	陈晨
	联系电话	010-64285807	010-50938723
	电子邮箱	hew@glsc.com.cn	zctg@chinaclear.com.cn
客户服务电话		95570	4008-058-058
传真		0532-80995606	-
注册地址		山东省青岛市胶州市上合示范区	北京市西城区太平桥大街 17 号
办公地址		山东省青岛市崂山区秦岭路 19 号协信中心 1 号楼 1506 室	北京市西城区锦什坊街 26 号

邮政编码	266061	100033
法定代表人	葛小波	于文强

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	https://www.glsc.com.cn（后续管理人网站地址将变更为： www.glzqzg.com，具体生效日以公告的资产管理产品管理人网站地址变更日为准）
基金中期报告备置地点	江苏省无锡市滨湖区太湖新城金融一街 8 号管理人办公楼层。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区锦什坊街 26 号

§ 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 01 月 01 日-2024 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	18,795,401.57
本期利润	18,795,401.57
本期净值收益率	0.5999%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）
期末基金资产净值	3,407,071,056.28
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2024 年 06 月 30 日）
累计净值收益率	2.5680%

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，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. 本集合计划利润分配是按季转份额。

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

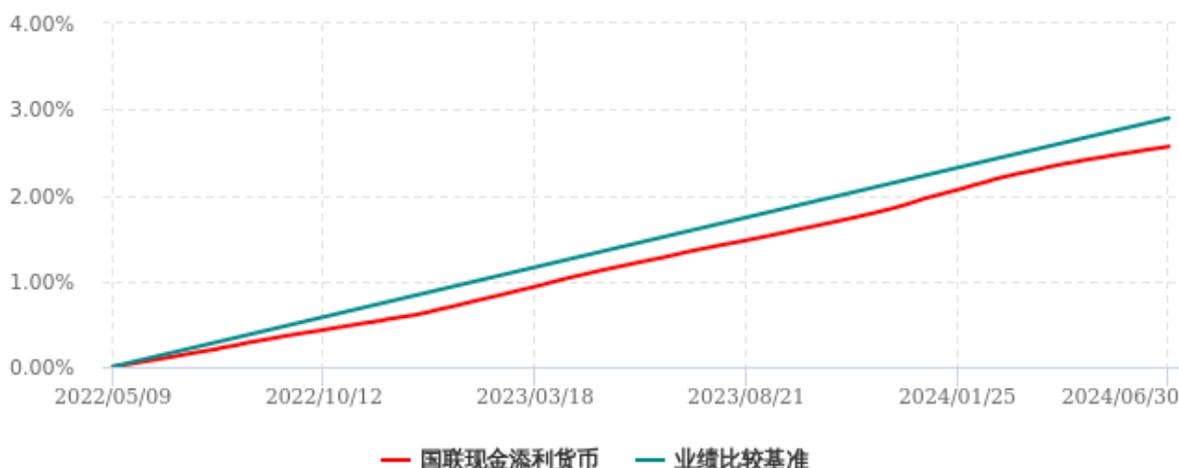
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④
----	--------------	--------------	--------------	--------------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差④		
过去一个月	0.0733%	0.0004%	0.1110%	0.0000%	-0.0377%	0.0004%
过去三个月	0.2408%	0.0006%	0.3366%	0.0000%	-0.0958%	0.0006%
过去六个月	0.5999%	0.0010%	0.6732%	0.0000%	-0.0733%	0.0010%
过去一年	1.2445%	0.0008%	1.3537%	0.0000%	-0.1092%	0.0008%
自基金合同生效起至今	2.5680%	0.0008%	2.8997%	0.0000%	-0.3317%	0.0008%

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

国联现金添利货币型集合资产管理计划累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年05月09日-2024年06月30日)



注：本集合计划合同生效日为 2022 年 5 月 9 日，按本集合计划合同规定，自合同生效起 6 个月内为建仓期，建仓结束时各项资产配置比例均符合计划合同约定。

3.3 其他指标

无。

§ 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

国联证券股份有限公司（以下简称“国联证券”）于 1992 年 11 月在无锡创立，前身为无锡市证券公司，2008 年 5 月通过改制更名为国联证券股份有限公司，注册资本 28.3 亿元人民币，2015

年 7 月 6 日在香港联合交易所上市（股票代码：01456），2020 年 7 月 31 日在上海证券交易所上市（股票代码：601456）。

国联证券资产管理有限公司（以下简称“国联证券资管”或“公司”）是经中国证监会许可[2023]2102 号文批准，由国联证券设立的全资证券资产管理子公司，公司注册资本 10 亿元。公司前身为国联证券资产管理部，于 2002 年获得受托投资管理业务（证监机构字[2002]215 号），自 2003 年开始推出首个个人受托理财计划产品，有 21 余年丰富的投资管理经验。

2024 年 5 月 27 日国联证券股份有限公司和国联证券资产管理有限公司联合发布了《关于国联证券股份有限公司的资产管理产品管理人主体变更的公告》，自 2024 年 5 月 27 日起，国联证券旗下的所有资产管理计划的管理人变更为“国联证券资产管理有限公司”，由其继承资产管理计划项下的权利和义务，并由其履行管理人的职责。

根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求，国联证券资管旗下全部大集合产品已完成公募化改造。截至 2024 年 6 月 30 日，存续运作的大集合产品包括“国联金如意 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划”、“国联汇富债券型集合资产管理计划”、“国联金如意双利一年持有期债券型集合资产管理计划”及“国联现金添利货币型集合资产管理计划”。

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		
华达	本集合计划投资经理	2022-05-09	2024-05-05	8 年	华达，CFA，约翰霍普金斯大学金融学硕士，具有证券从业资格、基金从业资格、期货从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。于 2015 年加入国联证券，负责债券投资工作，研究领域新能源、有色、TMT、城投等，负责整理一级市场发行人经营与财务数据，对每日新债发行及定价情况进行跟踪整理，分析发债企业的资信状况，构建固定收益组合，并根据市场变化和组合的定期评估，适时调整组合和投资品种。研究能力出众，每年调研企业数十家，对债券市场及各发行人均有深入了解，风险控制能力强。
哈默	本集合计划投资经理	2024-05-06	-	16 年	哈默女士，中国国籍，中国人民大学国民经济专业，硕士

				<p>学位，具有基金从业资格；2007 年 7 月至 2019 年 1 月历任银华基金管理股份有限公司交易管理部交易员、固定收益部债券研究员、基金经理助理、基金经理；2019 年 1 月至 2023 年 10 月在国联基金管理有限公司担任基金经理；2023 年 10 月加入国联证券股份有限公司资产管理部，现任国联证券资产管理有限公司公募投资管理部 B 角、投资经理。</p>
--	--	--	--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：1. 集合计划的首任基金经理，其“任职日期”为资产管理合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2. 非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3. 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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本集合计划投资经理在担任期间未同时兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》及其他有关法律法规以及集合计划合同、招募说明书的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在控制风险的基础上，为计划份额持有人谋求最大利益，没有发生损害计划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

本报告期内，本管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关规定，通过各项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，未发现本集合计划进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。报告期内，未出现涉及本集合计划的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

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

本集合计划配置主要以流动性较好、信用评级优质的资产为主。报告期内，货币政策依旧保持精准投放，流动性整体保持平稳。

本集合计划在这个过程中，始终保持合理久期杠杆控制，积极关注市场有配置机会的窗口期，通过多元化策略为组合增厚收益。

报告期内，资金面维持宽松，短端利率维持低位，本集合计划收益中枢亦保持低位运行。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国联现金添利货币份额净值为 1.0000 元，本报告期内，份额净值收益率为 0.5999%，同期业绩比较基准收益率为 0.6732%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，当前国内经济处于从高速发展切换至高质量发展的过程中，必然伴随利率中枢的下行，市场风险偏好修复仍需耐心，固收类资产受到追捧，叠加欠配效应下，债券型基金性价比仍在但收益中枢可能维持低位。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司成立估值委员会，并制定相关制度各项估值工作开展的规则进行约定。估值委员会成员包括公司总经理、公司风控、合规、投资、运营相关职能板块领导及负责人等，对公司依法受托管理资产的投资品种估值政策、估值方法和估值模型进行评估、研究、决策，确定估值业务的操作流程、风险控制及人员管理办法，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业经验。本公司的资管计划估值和会计核算由运营管理部负责实施，根据相关的法律法规规定、资管计划合同的约定，制定了内部控制措施，对资管计划的估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证资管计划估值和会计核算的准确性。运营管理部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本集合计划投资经理可参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本资管计划管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间、交易所各类上市流通或挂牌转让的固定收益品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本集合计划资产管理合同的规定，本集合计划收益“每日计提，按季支付”。本集合计划根据每日收益情况，以每万份集合计划暂估净收益为基准，为投资者计算当日暂估收益，并在季度分红日根据实际未付收益按季支付。本集合计划收益支付方式分两种：现金分红与红利再投资。本报告期内本集合计划已实现收益分配金额为 19,547,879.41 元，其中采用现金分红方式分配金额为

235,457.21 元，采用红利再投资方式分配金额为 19,312,422.20 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

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日计划份额持有人数量不满二百人或者集合计划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

本报告期内，本托管人在对本集合计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同和托管协议的有关规定，不存在损害计划份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了计划托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同和托管协议的有关规定，对本集合计划的投资运作、计划资产净值计算、计划费用开支等方面进行了监督和复核，未发现本计划管理人存在损害计划份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国联现金添利货币型集合资产管理计划

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,513,547,260.91	1,294,389,202.57
结算备付金		4,452,002.50	7,781,122.51
存出保证金		754,826.25	12,193.26
交易性金融资产	6.4.7.2	963,282,936.08	609,360,609.15

其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		963,282,936.08	609,360,609.15
资产支持证 券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	929,602,000.93	691,396,598.85
应收清算款		45,948.08	1,622,260.75
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		3,411,684,974.75	2,604,561,987.09
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 06 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,724,950.76	2,159,346.03
应付托管费		151,386.16	119,963.64
应付销售服务费		756,930.77	239,927.31
应付投资顾问费		-	-
应交税费		25,919.63	137,138.13
应付利润		625,446.56	1,377,924.40
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	329,284.59	226,963.74
负债合计		4,613,918.47	4,261,263.25
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	3,407,071,056.28	2,600,300,723.84
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		3,407,071,056.28	2,600,300,723.84
负债和净资产总计		3,411,684,974.75	2,604,561,987.09

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，份额净值 1.0000 元，集合计划份额总额 3,407,071,056.28 份。

6.2 利润表

会计主体：国联现金添利货币型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
一、营业总收入		38,273,977.72	31,146,506.00
1. 利息收入		28,391,659.93	21,828,655.89
其中：存款利息收入	6.4.7.13	21,151,240.04	11,719,311.26
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,240,419.89	10,109,344.63
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,882,317.79	9,317,850.11
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	9,882,317.79	9,317,850.11
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	-	-
减：二、营业总支出		19,478,576.15	14,495,706.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	14,457,153.79	11,372,506.14
2. 托管费	6.4.10.2.2	803,175.22	631,805.88
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,434,594.50	666,339.47
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		637,631.58	1,688,122.39
其中：卖出回购金融资产支出		637,631.58	1,688,122.39
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		16,315.42	12,759.96
8. 其他费用	6.4.7.24	129,705.64	124,172.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,795,401.57	16,650,799.41

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,795,401.57	16,650,799.41
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		18,795,401.57	16,650,799.41

6.3 净资产变动表

会计主体：国联现金添利货币型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,600,300,723.84	-	2,600,300,723.84
二、本期期初净资产	2,600,300,723.84	-	2,600,300,723.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	806,770,332.44	-	806,770,332.44
（一）、综合收益总额	-	18,795,401.57	18,795,401.57
（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）	806,770,332.44	-	806,770,332.44
其中：1. 基金申购款	45,189,501,529.97	-	45,189,501,529.97
2. 基金赎回款	-	-	-
	44,382,731,197.53		44,382,731,197.53
（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）	-	-18,795,401.57	-18,795,401.57
四、本期期末净资产	3,407,071,056.28	-	3,407,071,056.28
项目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,888,175,935.08	-	1,888,175,935.08
二、本期期初净资产	1,888,175,935.08	-	1,888,175,935.08
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	554,545,009.72	-	554,545,009.72
（一）、综合收益总额	-	16,650,799.41	16,650,799.41
（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）	554,545,009.72	-	554,545,009.72
其中：1. 基金申购款	36,504,865,980.11	-	36,504,865,980.11
2. 基金赎回款	-	-	-
	35,950,320,970.39		35,950,320,970.39
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动	-	-16,650,799.41	-16,650,799.41

(净资产减少以“-”号填列)			
四、本期期末净资产	2,442,720,944.80	-	2,442,720,944.80

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：

贺巍	尹磊	刘婷
-----	-----	-----
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

国联现金添利货币型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于 2022 年 3 月 21 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予国联现金添利 1 号集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2022]508 号）批准，《国联现金添利货币型集合资产管理计划资产管理合同》于 2022 年 5 月 9 日起正式变更生效。本集合计划为契约型开放式，存续期限为自资产管理合同生效日起三年。

本集合计划的原管理人为国联证券股份有限公司，托管人为中国证券登记结算有限责任公司。2024 年 5 月 27 日国联证券股份有限公司和国联证券资产管理有限公司联合发布了《关于国联证券股份有限公司的资产管理产品管理人主体变更的公告》，自 2024 年 5 月 27 日起，本集合计划管理人由“国联证券股份有限公司”变更为“国联证券资产管理有限公司”，本集合计划项下管理人的权利和义务将由国联证券资产管理有限公司承继，并由其履行管理人的职责。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联现金添利货币型集合资产管理计划产管理合同》的有关规定，本集合计划投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，具体如下：

- (1) 现金；
- (2) 期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、中央银行票据、同业存单；
- (3) 期限在 1 个月以内的债券回购；
- (4) 剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券；
- (5) 中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

本集合计划投资于前款第（四）项的，其中企业债、公司债、短期融资券、中期票据的主体信用评级和债项信用评级均应当为最高级；超短期融资券的主体信用评级应当为最高级。发行人同时有两家以上境内评级机构评级的，按照孰低原则确定评级。

如果法律法规或监管机构以后允许现金管理产品投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本集合计划的业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表的编制符合企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本集合计划 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和集合计划净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本集合计划报告期所采用的其他会计政策、其他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

本集合计划本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期内无需要说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《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《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《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《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,主要税项列示如下:

(1) 2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以资产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。

(2) 对集合计划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，暂不缴纳企业所得税。

(3) 本集合计划的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 06 月 30 日
活期存款	411,068,344.06
等于：本金	410,683,974.02
加：应计利息	384,370.04
减：坏账准备	-
定期存款	1,102,478,916.85
等于：本金	1,100,000,000.00
加：应计利息	2,478,916.85
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	200,096,833.34
存款期限 1-3 个月	400,715,472.57
存款期限 3 个月以上	501,666,610.94
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,513,547,260.91

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 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	101,692,543.00	101,735,884.39	43,341.39	0.0013
	银行间市场	861,590,393.08	862,111,057.98	520,664.90	0.0153
	合计	963,282,936.08	963,846,942.37	564,006.29	0.0166
资产支持证券	-	-	-	-	
合计	963,282,936.08	963,846,942.37	564,006.29	0.0166	

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

本集合计划本报告期末未持有衍生金融工具。

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 06 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	212,039,780.84	-
银行间市场	717,562,220.09	-
合计	929,602,000.93	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本集合计划本报告期末未持有债权资产。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他债权投资资产。

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

本集合计划本报告期末未持有其他权益工具投资资产。

6.4.7.8 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 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	235,449.23
其中：交易所市场	79,784.73
银行间市场	155,664.50
应付利息	-

预提费用	93,835.36
合计	329,284.59

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,600,300,723.84	2,600,300,723.84
本期申购	45,189,501,529.97	45,189,501,529.97
本期赎回（以“-”号填列）	-44,382,731,197.53	-44,382,731,197.53
本期末	3,407,071,056.28	3,407,071,056.28

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

6.4.7.11 其他综合收益

本集合计划本报告期内无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	18,795,401.57	-	18,795,401.57
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	-18,795,401.57	-	-18,795,401.57
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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	5,631,756.19
定期存款利息收入	15,474,612.02
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	41,540.96
其他	3,330.87
合计	21,151,240.04

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本集合计划本报告期内无股票投资收益——买卖股票差价收入。

6.4.7.14.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本集合计划本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 基金投资收益

本集合计划本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.16 债券投资收益**6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	8,326,737.01
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,555,580.78
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	9,882,317.79

6.4.7.16.2 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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,536,639,300.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,491,731,896.93
减：应计利息总额	43,351,635.66
减：交易费用	187.50
买卖债券差价收入	1,555,580.78

注：卖出债券成交总额中扣除了债券投资收益中增值税的影响。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益**6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 贵金属投资收益

本集合计划本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.19 衍生工具收益

本集合计划本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.20 股利收益

本集合计划本报告期内无股利收益。

6.4.7.21 公允价值变动收益

本集合计划本报告期内无公允价值变动收益。

6.4.7.22 其他收入

本集合计划本报告期内无其他收入。

6.4.7.23 信用减值损失

本集合计划本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	26,570.28
账户维护费	18,600.00
合计	129,705.64

6.4.7.25 分部报告

本集合计划本报告期内无分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本集合计划并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，本集合计划管理人自 2024 年 5 月 27 日起由国联证券股份有限公司变更为国联证券资产管理有限公司。国联证券资产管理有限公司是国联证券股份有限公司的全资子公司。

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
国联证券资产管理有限公司	集合计划管理人
中国证券登记结算有限责任公司	集合计划托管人、集合计划注册登记机构
国联证券股份有限公司	原管理人、管理人股东、集合计划销售机构

注：下述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

本集合计划本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本集合计划本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国联证券股	3,482,878,840.00	100.00%	90,301,500.00	100.00%

份有限公司				
-------	--	--	--	--

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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
国联证券股份有限公司	6,613,515,000.00	100.00%	22,816,709,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 基金交易

本集合计划本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国联证券股份有限公司	175,246.23	100.00%	79,784.73	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国联证券股份有限公司	4,638.17	100.00%	4,638.17	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,457,153.79	11,372,506.14
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,526,677.43	-
应支付基金管理人的净管理费	12,930,476.36	11,372,506.14

注：1、国联证券股份有限公司和国联证券资产管理有限公司联合发布了《关于国联证券股份有限公司的资产管理产品管理人主体变更的公告》，自 2024 年 5 月 27 日起，本集合计划管理人由“国联证券股份有限公司”变更为“国联证券资产管理有限公司”，本集合计划项下管理人的权利和义务将由国联证券资产管理有限公司承继，并由其履行管理人的职责。原管理人国联证券股份有限公司变更为本集合计划的销售机构，本期应支付销售机构的客户维护费中包含向国联证券股份有限公司支付的客户维护费。

2、本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.9% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

本集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

如果以 0.90% 的管理费计算的七日年化暂估收益率小于或等于 2 倍活期存款利率，管理人将调整管理费为 0.25%，以降低每万份集合计划暂估净收益为负并引发销售机构交收透支的风险，直至该类风险消除，管理人方可恢复计提 0.90% 的管理费。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	803,175.22	631,805.88

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

本集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
国联证券股份有限公司	3,434,594.50	
合计	3,434,594.50	
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
国联证券股份有限公司	666,339.47	

合计	666,339.47
----	------------

注：本集合计划销售服务费按前一日集合计划资产净值的 0.25% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划销售服务费

E 为前一日的集合计划资产净值

本集合计划销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。本集合计划管理人开展销售服务费优惠活动，2024 年 1 月 1 日至 2 月 29 日销售服务费按 0.15% 年费率收取，2024 年 3 月 1 日至 3 月 31 日销售服务费按 0.2% 年费率收取，自 2024 年 4 月 1 日起本集合计划暂停销售服务费优惠活动，销售服务费按照 0.25% 年费率收取。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本集合计划本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本集合计划本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2022 年 05 月 09 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	58,344,369.07	34,341,052.62
报告期间申购/买入总份额	3,992,053,529.39	4,414,407,307.24
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	4,050,397,898.46	4,405,455,653.00
报告期末持有的基金份额	-	43,292,706.86
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.77%

注：1、根据本集合计划管理人发布的《关于国联证券股份有限公司的资产管理产品管理人主体

变更的公告》，自 2024 年 5 月 27 日起，本集合计划管理人由“国联证券股份有限公司”变更为“国联证券资产管理有限公司”，原国联证券股份有限公司固有资金视为管理人股东固有资金，国联证券资产管理有限公司未运用固有资金投资本集合计划。

2、报告期间赎回/卖出总份额数据中，原管理人国联证券股份有限公司实际赎回投资份额数为 4,002,786,587.00，剩余份额数据 47,611,311.46 为因集合计划管理人发生变更而产生的，实际国联证券股份有限公司未赎回此部分投资份额。

6.4.10.5.2 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

关联方名称	本期末 2024 年 06 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
国联证券股份有限公司	63,977,053.01	1.8778%	58,344,369.07	2.2438%

注：报告期末本集合计划的管理人已由“国联证券股份有限公司”变更为“国联证券资产管理有限公司”，原国联证券股份有限公司在期末持有本集合计划的份额视为管理人股东投资本集合计划的情况。

6.4.10.6 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 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国证券登记结算有限责任公司	2,604,061.34	103,683.90	2,740,242.66	1,012,983.39

注：本集合计划的银行存款由托管人保管，按同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金

单位：人民币元

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
19,312,422.20	235,457.21	-752,477.84	18,795,401.57	-

6.4.12 期末（2024 年 06 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

本集合计划本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划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

本集合计划本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末未持有因从事交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本集合计划本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划资产管理人从事风险管理的目标是提升本集合计划风险调整后收益水平，保证本集合计划的资产安全，以维护集合计划委托人利益为最高准则。基于该风险管理目标，本集合计划资产管理人风险管理的基本策略是识别和分析本集合计划运作使本集合计划面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本集合计划目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。与本集合计划相关的市场风险主要包括利率风险和市场价格风险。

本公司建立了包括董事会、经营管理层及下设的风险管理委员会、风险管理部以及其他风险管理职能部门与业务部门/业务团队组成的全方位、多层次的风险管理体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划的银行存款存放于商业信誉良好的商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本集合计划在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

本集合计划主要投资于证券交易所及银行间市场交易的债券、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具。

对于与债券投资相关的信用风险，本集合计划的资产管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。

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 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	182,932,891.07	351,259,601.06
合计	182,932,891.07	351,259,601.06

注：未评级债券包括期限一年以内的国债、金融债及未有第三方机构评级的短期融资券、超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

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 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	697,742,931.34	-
合计	697,742,931.34	-

注：未评级债券包括期限一年以内的同业存单。

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 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	155,225,151.03
AAA 以下	-	-
未评级	82,607,113.67	102,875,857.06
合计	82,607,113.67	258,101,008.09

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券包括期限大于一年的金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合计划份额持有人可随时要求赎回其持有的集合计划份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本集合计划流动性风险来源于开放式集合计划每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本集合计划所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，本集合计划未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本集合计划的管理人在集合计划合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障集合计划持有人利益。日常流动性风险管理中，本集合计划的管理人每日监控和预测本集合计划的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制集合计划投资的流动性风险。同时，本集合计划通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理，审慎评估各类资产的流动性。

本集合计划的管理人采用监控组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本集合计划的申购赎回情况进行监控，保持投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本集合计划资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本集合计划的管理人在合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障持有人利益。

本集合计划所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在 6.4.12 中列示的部分集合计划资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。

本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过资产净值的 10%。此外，本集合计划可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过集合计划持有的债券资产的公允价值。

本集合计划本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本集合计划的管理人定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本集合计划投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年06 月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1- 5 年	5年以 上	不计息	合计
资产							
货币资金	812,479,927.43	701,067,333.48	-	-	-	-	1,513,547,260.91
结算备付金	4,452,002.50	-	-	-	-	-	4,452,002.50
存出保证金	754,826.25	-	-	-	-	-	754,826.25
交易性金融 资产	-	133,262,879.05	830,020,057.03	-	-	-	963,282,936.08
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融资 产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金 融资产	929,602,000.93	-	-	-	-	-	929,602,000.93
应收清算款	-	-	-	-	-	45,948.08	45,948.08
应收利息	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,747,288,757.11	834,330,212.53	830,020,057.03	-	-	45,948.08	3,411,684,974.75
负债							
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-	-	-

应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	2,724,950.76	2,724,950.76
应付托管费	-	-	-	-	-	151,386.16	151,386.16
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	756,930.77	756,930.77
应付投资顾 问费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费 用	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	25,919.63	25,919.63
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	625,446.56	625,446.56
其他负债	-	-	-	-	-	329,284.59	329,284.59
负债总计	-	-	-	-	-	4,613,918.47	4,613,918.47
利率敏感度 缺口	1,747,288,757.11	834,330,212.53	830,020,057.03	-	-	- 4,567,970.39	3,407,071,056.28
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1- 5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
货币资金	59,970,953.29	633,198,332.47	601,219,916.81	-	-	-	1,294,389,202.57
结算备付金	7,781,122.51	-	-	-	-	-	7,781,122.51
存出保证金	12,193.26	-	-	-	-	-	12,193.26
交易性金融 资产	295,979,497.90	236,286,741.17	77,094,370.08	-	-	-	609,360,609.15
衍生金融资 产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金 融资产	691,396,598.85	-	-	-	-	-	691,396,598.85
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	1,622,260.75	1,622,260.75
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,055,140,365.81	869,485,073.64	678,314,286.89	-	-	1,622,260.75	2,604,561,987.09
负债							
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人	-	-	-	-	-	2,159,346.03	2,159,346.03

报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	119,963.64	119,963.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-	239,927.31	239,927.31
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	137,138.13	137,138.13
应付利润	-	-	-	-	-	1,377,924.40	1,377,924.40
其他负债	-	-	-	-	-	226,963.74	226,963.74
负债总计	-	-	-	-	-	4,261,263.25	4,261,263.25
利率敏感度缺口	1,055,140,365.81	869,485,073.64	678,314,286.89	-	-	-	2,600,300,723.84
						2,639,002.50	

注：表中所示为本集合计划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进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	利率曲线平行移动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-1,757,838.08	-215,443.47
	市场利率下降 25 个基点	1,764,971.39	215,708.17

注：因 2024 年 6 月 30 日为非交易日，本报告期末采用 2024 年 6 月 28 日的数据进行计算。

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。本集合计划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

其他价格风险是指集合计划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。本集合计划主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	963,282,936.08	28.27	609,360,609.15	23.43
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	963,282,936.08	28.27	609,360,609.15	23.43

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本集合计划本报告期末未持有交易性权益类金融工具，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本集合计划资产净值无重大影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本集合计划本报告期末及上年度末无采用风险价值法管理风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本集合计划对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本集合计划主要金融工具的估值原则如下：

本集合计划采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值。在本集合计划存续期间，资产管理人定期计算本集合计划投资组合摊余成本与其他可参考公允价值指标之间的偏离程度，并定期测试其他可参考公允价值指标确定方法的有效性。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整。

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值，资产管理人将根据具体情况与集合计划托管人商定后采用估值技术确定最能反映公允价值的价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本集合计划特定相关的参数。

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 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	963,282,936.08	609,360,609.15
第三层次	-	-
合计	963,282,936.08	609,360,609.15

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

截至本报告期末及上期末，本集合计划无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至本报告期末及上期末，本集合计划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

截至本报告期末及上期末，不以公允价值计量的金融资产和金融负债主要包括：货币资金、买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

因四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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	963,282,936.08	28.23
	其中：债券	963,282,936.08	28.23
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	929,602,000.93	27.25
	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	1,517,999,263.41	44.49
4	其他各项资产	800,774.33	0.02
5	合计	3,411,684,974.75	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.76	
	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	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：上表中报告期内债券回购融资余额占集合计划资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占集合计划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

本报告期内本集合计划债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	93
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	104
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本集合计划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(天数)	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	51.22	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	10.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	14.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天	-	-

	天的浮动利率债		
5	120 天(含)—397 天(含)	24.33	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.92	-

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

本报告期内本集合计划投资组合平均剩余存续期未超过 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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	101,692,543.00	2.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	163,847,461.74	4.81
	其中：政策性金融债	163,847,461.74	4.81
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	697,742,931.34	20.48
8	其他	-	-
9	合计	963,282,936.08	28.27
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)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112405116	24 建设银行 CD116	1,000,000	98,364,755.82	2.89
2	112402042	24 工商银行 CD042	1,000,000	98,290,286.49	2.88
3	112498724	24 南京银行 CD124	1,000,000	98,276,566.87	2.88
4	112408158	24 中信银行 CD158	1,000,000	98,255,706.87	2.88
5	112414101	24 江苏银行 CD101	1,000,000	98,180,900.26	2.88
6	112403140	24 农业银行 CD140	1,000,000	98,136,135.87	2.88
7	230211	23 国开 11	800,000	81,240,348.07	2.38
8	112406148	24 交通银行 CD148	600,000	59,045,837.17	1.73
9	170208	17 国开 08	500,000	52,022,530.98	1.53
10	019740	24 国债 09	510,000	51,157,334.02	1.50

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	0.0185%
报告期内偏离度的最低值	-0.0034%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0042%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本集合计划报告期内不存在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

本集合计划报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本集合计划采用固定份额净值，计划份额账面净值始终保持为人民币 1.00 元。

本集合计划估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本报告期内集合计划投资的前十名证券中的发行主体包括中国农业银行股份有限公司、国家开发银行、江苏银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、交通银行股份有限公司。崇左银保监分局于 2023 年 7 月 13 日对中国农业银行股份有限公司作出了处罚决定，国家金融监督管理总局于 2023 年 8 月 15 日、2023 年 11 月 16 日对中国农业银行股份有限公司作出了处罚决定，国家外汇管理局北京市分局于 2023 年 11 月 17 日对中国农业银行股份有限公司作出了处罚决定。吉林银保监局于 2023 年 7 月 19 日对国家开发银行作出了处罚决定。国家金融监督管理总局江苏监管局于 2023 年 8 月 10 日对江苏银行股份有限公司作出了处罚决定。国家外汇管理局江苏省分局于 2023 年 8 月 25 日对南京银行股份有限公司作出了处罚决定。国家金融监督管理总局于 2023 年 11 月 22 日、2023 年 12 月 27 日对中国建设银行股份有限公司作出了处罚决定。国家金融监督管理总局于 2023 年 11 月 16 日、2023 年 12 月 29 日对中信银

行股份有限公司作出了处罚决定。国家金融监督管理总局于 2024 年 6 月 3 日对交通银行股份有限公司作出了处罚决定。在上述处罚公布后，本集合计划管理人对该公司进行了深入了解和分析，认为上述处罚不会对中国农业银行股份有限公司、国家开发银行、江苏银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、交通银行股份有限公司的投资价值构成实质性的负面影响，因此本集合计划管理人对该公司债券的投资判断未发生改变。

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	754,826.25
2	应收清算款	45,948.08
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	800,774.33

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入的原因，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

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
83,149	40,975.49	220,148,813.35	6.46%	3,186,922,242.93	93.54%

注：分级集合计划机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级集合计划份额，比例的分母采用各自级别的份额数；对合计数，比例的分母采用下属分级集合计划份额的合计数（即期末集合计划份额总额）。

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
----	-------	---------	--------

1	券商类机构	63,977,053.01	1.88%
2	其他机构	30,057,302.81	0.88%
3	个人	30,051,249.74	0.88%
4	个人	22,559,655.40	0.66%
5	个人	18,523,393.75	0.54%
6	其他机构	15,072,828.24	0.44%
7	个人	14,444,119.84	0.42%
8	个人	12,995,416.70	0.38%
9	个人	12,487,640.51	0.37%
10	个人	10,224,270.35	0.30%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	7,489.36	0.0002%

注：从业人员持有集合计划占集合计划总份额比例的计算中，对下属分级集合计划份额，比例的分母采用各自级别的份额数；对合计数，比例的分母采用下属分级集合计划份额的合计数（即期末集合计划份额总额）。

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022年05月09日）基金份额总额	450,850,383.91
本报告期期初基金份额总额	2,600,300,723.84
本报告期基金总申购份额	45,189,501,529.97
减：本报告期基金总赎回份额	44,382,731,197.53
本报告期期末基金份额总额	3,407,071,056.28

注：总申购份额含红利再投（如有）、转换入份额（如有）；总赎回份额含转换出份额（如有）。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本集合计划未召开持有人大会。

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

2024 年 5 月 27 日国联证券股份有限公司和国联证券资产管理有限公司联合发布了《关于国联证券股份有限公司的资产管理产品管理人主体变更的公告》，自 2024 年 5 月 27 日起，本集合计划管理人由“国联证券股份有限公司”变更为“国联证券资产管理有限公司”，本集合计划项下管理人的权利和义务将由国联证券资产管理有限公司承继，并由其履行管理人的职责。

报告期内因集合计划管理人变更发生变更，导致发生人事变动，变动情况详见管理人官网（www.glsc.com.cn，后续管理人网站地址将变更为：www.glzqzg.com，具体生效日以公告的资产管理产品管理人网站地址变更日为准）披露的《关于资产管理人基本信息的公告》。

本报告期内，本集合计划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

本集合计划本报告期内不涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本集合计划本报告期内未改变投资策略。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本集合计划未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，集合计划管理人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，集合计划托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

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	
国联证券	3	-	-	175,246.23	100.00%	-

注：1、本表“佣金”指本集合计划通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2、交易单元的选择标准和程序：

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

集合计划管理人根据以上标准进行考察后确定使用券商的交易单元。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国联证券	3,482,878,840.00	100.00%	6,613,515,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：债券交易成交金额包含资产支持证券成交金额。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本集合计划本报告期内不存在偏离度的绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	国联现金添利货币型集合资产管理计划 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定的媒介	2024-01-19
2	国联现金添利货币型集合资产管理计划 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024-01-20
3	关于国联现金添利货币型集合资产管理计划开展销售服务费优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2024-01-30
4	关于国联现金添利货币型集合资产管理计划开展销售服务费优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2024-02-29
5	国联现金添利货币型集合资产管理计划调整单个集合计划账户最高持仓金额的公告	中国证监会规定的媒介	2024-03-14
6	国联现金添利货币型集合资产管理计划调整单个集合计划账户最高持仓金额的公告	中国证监会规定的媒介	2024-03-19
7	国联现金添利货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定的媒介	2024-03-23
8	关于国联现金添利货币型集合资产管理计划暂停销售服务费优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2024-03-29
9	国联现金添利货币型集合资产管理计划 2023 年年度报告	中国证监会规定的媒介	2024-03-29
10	国联现金添利货币型集合资产管理计划 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024-03-30
11	国联现金添利货币型集合资产管理计划招募说明书（更新）	中国证监会规定的媒介	2024-04-12
12	国联现金添利货币型集合资产管理计划产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2024-04-12
13	国联现金添利货币型集合资产管理计划更新招募说明书和产品资料概要的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024-04-13
14	国联现金添利货币型集合资产管理计划 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定的媒介	2024-04-19
15	国联现金添利货币型集合资产管理计划 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024-04-20
16	国联现金添利货币型集合资产管理计划基金经理变更公告	中国证监会规定的媒介	2024-05-06
17	国联现金添利货币型集合资产管理计划招募说明书（更新）	中国证监会规定的媒介	2024-05-06
18	国联现金添利货币型集合资产管理计划产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2024-05-06
19	国联现金添利货币型集合资产管理计划更新招募说明书和产品资料概要的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024-05-06
20	关于国联证券股份有限公司的资产管理产品管理人主体变更的公告	中国证监会规定的媒介	2024-05-27
21	关于资产管理计划管理人基本信息的公告	中国证监会规定的媒介	2024-05-27

22	国联现金添利货币型集合资产管理计划招募说明书（更新）	中国证监会规定的媒介	2024-05-29
23	国联现金添利货币型集合资产管理计划产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2024-05-29
24	关于国联证券资产管理有限公司承接国联证券股份有限公司国联现金添利货币型集合资产管理计划资产管理合同和托管协议的补充协议	中国证监会规定的媒介	2024-05-29
25	国联现金添利货币型集合资产管理计划更新招募说明书和产品资料概要的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024-05-30
26	国联现金添利货币型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定的媒介	2024-06-25
27	国联现金添利货币型集合资产管理计划产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2024-06-27
28	国联现金添利货币型集合资产管理计划更新产品资料概要的提示性公告	中国证监会规定的媒介	2024-06-27

§ 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

本集合计划本报告期内未出现单一投资者持有集合计划份额达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据中国证监会《关于核准国联证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可[2023]2102号），国联证券资产管理有限公司已成立，并已于 2024 年 5 月取得经营证券期货业务许可证。2024 年 5 月 27 日国联证券股份有限公司和国联证券资产管理有限公司联合发布了《关于国联证券股份有限公司的资产管理产品管理人主体变更的公告》，自 2024 年 5 月 27 日起，本集合计划管理人由“国联证券股份有限公司”变更为“国联证券资产管理有限公司”，本集合计划项下管理人的权利和义务将由国联证券资产管理有限公司承继，并由其履行管理人的职责。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准国联现金添利 1 号集合资产管理计划合同变更的文件；
- (2) 国联现金添利货币型集合资产管理计划资产管理合同；
- (3) 国联现金添利货币型集合资产管理计划托管协议；
- (4) 国联现金添利货币型集合资产管理计划招募说明书及其更新；
- (5) 管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 托管人业务资格批件、营业执照；
- (7) 报告期内披露的各项公告；
- (8) 业务规则及中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

备查文件存放于本集合计划管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人网站（www.glsc.com.cn，后续管理人网站地址将变更为：www.glzqzg.com，具体生效日以公告的资产管理产品管理人网站地址变更日为准）查阅，或在营业时间内至本集合计划管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本集合计划管理人：国联证券资产管理有限公司
客户服务中心电话：95570

国联证券资产管理有限公司
二〇二四年八月二十八日