

# 上海证券现金添利货币型集合资产管理计划

## 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：上海证券有限责任公司

基金托管人：中国证券登记结算有限责任公司

送出日期：2024 年 8 月 30 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。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 20 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

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 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.....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7         |
| 3.3 其他指标.....                                | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 9         |
| 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.....             | 10        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 11        |
| 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.....       | 11        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>11</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 11        |
| 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..... | 11        |
| 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.....       | 11        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>11</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 11        |
| 6.2 利润表.....                                 | 13        |
| 6.3 净资产变动表.....                              | 14        |
| 6.4 报表附注.....                                | 16        |
| <b>§7 投资组合报告</b> .....                       | <b>34</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 34        |
| 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.....                        | 35        |
| 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 .....         | 36        |
| 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<br>明细 ..... | 37        |
| 7.9 投资组合报告附注 .....                                      | 37        |
| <b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>                               | <b>38</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                             | 38        |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....                            | 38        |
| 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        |
| <b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>                               | <b>38</b> |
| <b>§10 重大事件揭示 .....</b>                                 | <b>39</b> |
| 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        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>                         | <b>40</b> |
| 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 .....                | 40        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                               | 41        |
| <b>§12 备查文件目录 .....</b>                                 | <b>41</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                                       | 41        |
| 12.2 存放地点 .....   | 41        |
| 12.3 查阅方式 .....   | 41        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |   |
|------------|---|
| 基金名称       | 上海证券现金添利货币型集合资产管理计划   |
| 基金简称       | 上海证券现金添利货币  |
| 基金主代码      | 970181  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2022 年 12 月 19 日  |
| 基金管理人      | 上海证券有限责任公司  |
| 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 | 1,337,608,221.96 份  |
| 基金合同存续期    | 本集合计划自本集合计划合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本集合计划自集合计划合同变更生效日起 3 年后，按照中国证监会有关规定执行。 |

注：本报告所述的“基金”也包括按照《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 | 本集合计划根据上海证券客户交易结算资金余额规模及其波动特点，在严格控制风险的前提下，以高流动性金融资产投资为主，精选投资品种，构建低风险投资组合。在力求最大限度保证资产的安全性、流动性的同时，使委托人的闲置资金获得增值收益。  |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本集合计划将在深入分析宏观经济环境、宏观经济政策、流动性环境的基础上，综合考虑资产流动性特征、客户流动性偏好和公司流动性支持等多种因素，合理确定和调整不同类别资产的配置比例，并适时进行动态调整，在确保充足流动性的前提下提高组合收益水平。</p> <p>2、银行存款及同业存单投资策略</p> <p>本集合计划根据不同银行的银行存款和同业存单的收益情况，结合银行的信用等级、存款及存单期限等因素的分析，以及对整个利率市场环境及其变动趋势的研究，在严格控制风险的前提下，选择具有较高投资价值的银行存款和同业存单进行投资。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本集合计划将综合运用收益率曲线分析、流动性分析、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值，发掘出具备相对价值的债券。</p> <p>4、回购策略</p> <p>本集合计划基于对资金面走势的判断，选择回购品种和期限。若资产配置中有逆回购，则在判断资金面趋于宽松的情况下，优先进行相对较长期限逆回购配置；反之，则进行相对较短期限逆回购操作。在组合进行杠杆操作时，根据资金面的松紧，决定正回购的操作期限。</p> <p>5、久期策略</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | 本集合计划根据对宏观经济、货币政策及市场利率走势的判断，确定投资组合的平均剩余期限。具体而言，在预期短期市场利率上升时，适当缩短投资组合的平均剩余期限；在预期短期利率下降时，适当增大投资组合的平均剩余期限。<br>6、杠杆投资策略<br>本集合计划将对回购利率与短期债券收益率、存款利率进行比较，并在对资金面进行综合分析的基础上，判断利差套利空间，并确定杠杆操作策略。 |
| 业绩比较基准 | 人民币活期存款利率（税后）  |
| 风险收益特征 | 本集合计划为货币市场型集合资产管理计划，预期风险和预期收益与货币市场基金相同，低于债券型基金、混合型基金和股票型基金。  |

### 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          |      | 上海证券有限责任公司                 | 中国证券登记结算有限责任公司         |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 汪洋                         | 陈晨                     |
|             | 联系电话 | 021-53686650               | 010-50938723           |
|             | 电子邮箱 | wangyang03688@shzq.com     | zctg@chinaclear.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 4008-918-918               | 4008058058             |
| 传真          |      | 021-53686313               | -                      |
| 注册地址        |      | 上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼       | 北京市西城区太平桥大街 17 号       |
| 办公地址        |      | 上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼 | 北京市西城区锦什坊街 26 号        |
| 邮政编码        |      | 200002                     | 100033                 |
| 法定代表人       |      | 李海超                        | 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      | 中国证券报   |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="https://www.shzq.com/">https://www.shzq.com/</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼                                |

### 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 | 北京市西城区太平桥大街 17 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 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 9,915,776.91                        |
| 本期利润          | 9,915,776.91                        |

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 本期净值收益率       | 0.7299%          |
| 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      | 1,337,608,221.96 |
| 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6月30日) |
| 累计净值收益率       | 2.3800%          |

注：本集合计划收益“每日分配、按月支付”，收益支付方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可以选择现金红利或者将现金红利自动转为集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益支付方式是现金分红。

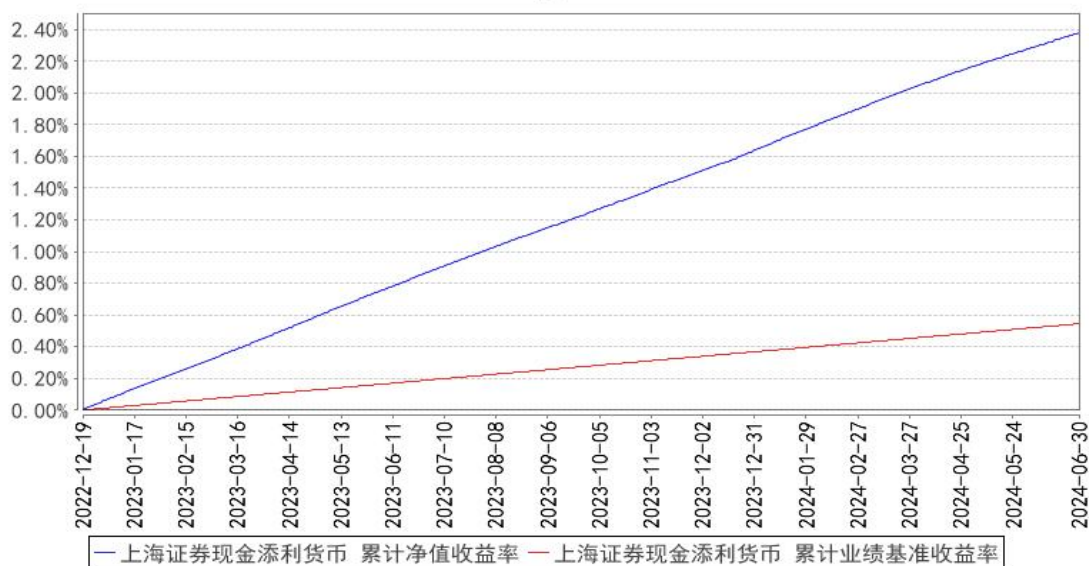
## 3.2 基金净值表现

### 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<br>收益率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③     | ②-④     |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|---------|---------|
| 过去一个月          | 0.1055%      | 0.0006%             | 0.0293%            | 0.0000%                   | 0.0762% | 0.0006% |
| 过去三个月          | 0.3316%      | 0.0004%             | 0.0889%            | 0.0000%                   | 0.2427% | 0.0004% |
| 过去六个月          | 0.7299%      | 0.0005%             | 0.1767%            | 0.0001%                   | 0.5532% | 0.0004% |
| 过去一年           | 1.5012%      | 0.0005%             | 0.3567%            | 0.0001%                   | 1.1445% | 0.0004% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 2.3800%      | 0.0005%             | 0.5447%            | 0.0001%                   | 1.8353% | 0.0004% |

### 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

上海证券现金添利货币 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



注：本基金基金合同生效日为 2022 年 12 月 19 日；图示日期为 2022 年 12 月 19 日至 2024 年 6 月 30 日。

### 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

上海证券有限责任公司成立于 2001 年 5 月，由原上海财政证券和原上海国际信托投资公司证券部以新设合并方式组建成立。2020 年 12 月 12 日，中国证监会核准百联集团成为公司主要股东、控股股东。目前公司股东包括：百联集团有限公司、国泰君安证券股份有限公司、上海国际集团有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海城投（集团）有限公司。公司注册资本 53.26532 亿元。

公司拥有期货子公司 1 家、分公司 9 家以及营业网点 72 家，形成以上海为中心，以长三角、珠三角、京津冀、长江中游、成渝经济圈为主体的经营网络，公司能为广大客户提供证券经纪、财富管理、投资银行、机构服务、证券研究、资产管理等全方位、系统性、多层次、专业化的综合金融服务。

截至 2024 年 6 月 30 日，本集合计划管理人共管理 2 只公募集合资产管理计划，为上海证券弘



利债券型集合资产管理计划、上海证券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 |        |   |
| 张乃禄 | 本基金的基金经理 | 2014年8月18日      | -    | 24年    | 清华大学汽车工程专业工学学士，复旦大学国际金融专业经济学硕士。曾任上海财政证券公司研究发展部、上海证券有限责任公司证券投资总部高级经理。2003年3月至2008年11月在上海证券有限责任公司证券投资总部任投资经理，2008年12月起在上海证券有限责任公司资产管理总部任高级经理，从事投资管理工作。2014年8月至2021年7月任上海证券心安增利债券分级集合资产管理计划投资经理，2022年7月1日起任上海证券弘利债券型集合资产管理计划投资经理，2014年8月至今任上海证券现金添利集合资产管理计划投资经理。 |
| 徐铭  | 本基金的基金经理 | 2023年1月16日      | -    | 7年     | 硕士研究生，2014年4月加入上海国利货币经纪有限公司担任货币市场部经纪人，2016年9月加入汇添富基金任债券交易员，2018年1月加入恒越基金固定收益部担任信用研究员。2022年10月加入上海证券资产管理总部，现任基金经理（大集合产品投资经理）。  |

注：1、集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为集合计划合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任投资经理，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《证券公司董事、监事、高级管理人员及从业人员管理规则》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

无。

#### 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，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本产品产品合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用产品资产，在严格控制风险的基础上，为产品份额持有人谋求利益。本报告期内，本产品运作整体合法合规，没有损

害产品份额持有人利益。产品的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及产品合同的规定。

### 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，管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》与《上海证券资产管理总部公平交易管理实施细则》的规定，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有大集合产品。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本集合计划存在异常交易行为。本报告期内管理人管理的所有大集合产品参与的交易所公开竞价，未出现同日反向交易的情况。

### 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

2024 年上半年国内经济延续复苏态势，运行总体平稳，但增长动能依然较弱；通胀水平略有上升，仍持续处于低位；央行执行稳健偏宽松货币政策，在 2 月份降低存款准备金率 50BP，并将 5 年期以上 LPR 下调 25BP。2024 年上半年债券市场整体呈现牛市走势，在金融和经济数据不及预期、央行降准降息和“资产荒”背景下机构配置压力较大等利好因素推动下，债券市场收益率振荡下行，10 年期国债收益率从去年底的 2.55% 振荡下行到 6 月底的 2.21%。2024 年上半年货币市场资金面维持较宽松格局，1 年期 AAA 同业存单收益率从去年底 2.4% 振荡下行到 6 月底的 1.96%。操作上，2024 年上半年本计划以同业存单为主要配置品种，积极做多，将产品运作久期维持在较高水平上。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本集合计划份额净值收益率为 0.7299%，同期业绩比较基准收益率为 0.1767%。

### 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 2024 年下半年，国内经济预计仍面临有效需求不足、增长动能较弱的局面，通胀水平预计略有抬升但将继续处于低位，央行预计将继续执行偏宽松货币政策，存在降息的可能。总体来看，2024 年下半年债券市场面临的环境依然较为积极，牛市基础依然存在，但在上半年上涨后债券市场的总体收益率水平已经处于历史低位且央行已多次警示长期国债收益率偏低风险，下半年债券市场也面临一定的调整压力，因此预计下半年债券市场为振荡略偏强走势的概率较大。2024 年下半年货币市场资金面预计将是中性略偏宽松格局。操作策略上，2024 年下半年本计划将稳健

投资，在确保流动性的基础上，灵活调整久期和杠杆水平来提高资产组合的收益率。

#### 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》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本集合计划本报告期已实现收益分配金额为 10086917.77 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份额持有人数量不满二百人或者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，本托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了监督和复核，未发现本基金管理人存在损害基金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：上海证券现金添利货币型集合资产管理计划

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<br>2024年6月30日         | 上年度末<br>2023年12月31日         |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                           |                             |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 282,729,833.83            | 281,136,860.12              |
| 结算备付金         |            | 1,465,875.68              | 159,171.60                  |
| 存出保证金         |            | 14,822.03                 | 5,560.45                    |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 1,065,209,232.01          | 871,390,648.03              |
| 其中：股票投资       |            | -                         | -                           |
| 基金投资          |            | -                         | -                           |
| 债券投资          |            | 1,065,209,232.01          | 871,390,648.03              |
| 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    | -                         | 50,070,220.12               |
| 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         |            | -                         | -                           |
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                         | -                           |
| 资产总计          |            | 1,349,419,763.55          | 1,202,762,460.32            |
| <b>负债和净资产</b> |            |                           |                             |
|               | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2023年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                           |                             |
| 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     |            | -                         | 21,504,026.33               |
| 应付清算款         |            | 9,911,429.51              | 9,894,884.10                |
| 应付赎回款         |            | -                         | -                           |
| 应付管理人报酬       |            | 652,445.63                | 605,092.61                  |
| 应付托管费         |            | 59,313.23                 | 55,008.45                   |
| 应付销售服务费       |            | 296,566.17                | 275,042.11                  |
| 应付投资顾问费       |            | -                         | -                           |
| 应交税费          |            | 6,123.00                  | 1,735.35                    |
| 应付利润          |            | 796,285.92                | 967,426.78                  |

|             |          |                  |                  |
|-------------|----------|------------------|------------------|
| 递延所得税负债     |          | -                | -                |
| 其他负债        | 6.4.7.9  | 89,378.13        | 52,299.92        |
| 负债合计        |          | 11,811,541.59    | 33,355,515.65    |
| <b>净资产：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金        | 6.4.7.10 | 1,337,608,221.96 | 1,169,406,944.67 |
| 其他综合收益      | 6.4.7.11 | -                | -                |
| 未分配利润       | 6.4.7.12 | -                | -                |
| 净资产合计       |          | 1,337,608,221.96 | 1,169,406,944.67 |
| 负债和净资产总计    |          | 1,349,419,763.55 | 1,202,762,460.32 |

注：1、报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,337,608,221.96 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上海证券现金添利货币型集合资产管理计划

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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>        |          | 16,033,121.49                            | 20,000,814.59                                 |
| 1. 利息收入               |          | 3,855,228.75                             | 7,384,869.41                                  |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.13 | 3,785,313.08                             | 7,226,373.90                                  |
| 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            |          | 69,915.67                                | 158,495.51                                    |
| 其他利息收入                |          | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）     |          | 12,177,892.74                            | 12,615,945.18                                 |
| 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 | 12,177,892.74                            | 12,615,945.18                                 |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.16 | -  | -   |
| 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   | -            | -             |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 6,117,344.58 | 7,347,388.86  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 3,745,079.13 | 4,288,015.76  |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -            | -             |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 340,461.70   | 389,819.52    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 1,702,308.69 | 1,949,098.07  |
| 4. 投资顾问费                   |            | -            | -             |
| 5. 利息支出                    |            | 199,405.84   | 572,778.18    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 199,405.84   | 572,778.18    |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.22   | -            | -             |
| 7. 税金及附加                   |            | 1,724.96     | 932.62        |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23   | 128,364.26   | 146,744.71    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 9,915,776.91 | 12,653,425.73 |
| 减：所得税费用                    |            | -            | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 9,915,776.91 | 12,653,425.73 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -            | -             |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 9,915,776.91 | 12,653,425.73 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：上海证券现金添利货币型集合资产管理计划

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<br>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 | 1,169,406,944.67                      | -      | -     | 1,169,406,944.67 |
| 加：会计政策变更  | -                                     | -      | -     | -                |
| 前期差错更正    | -                                     | -      | -     | -                |
| 其他        | -                                     | -      | -     | -                |
| 二、本期期初净   | 1,169,406,944.67                      | -      | -     | 1,169,406,944.67 |

|  |                      |        |               |                    |
|--|----------------------|--------|---------------|--------------------|
| 资产                                       | 67                   |        |               | 7                  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 168,201,277.29       | -      | -             | 168,201,277.29     |
| (一)、综合收益总额                               | -                    | -      | 9,915,776.91  | 9,915,776.91       |
| (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)      | 168,201,277.29       | -      | -             | 168,201,277.29     |
| 其中：1. 基金申购款                              | 16,138,313,612.91    | -      | -             | 16,138,313,612.91  |
| 2. 基金赎回款                                 | -15,970,112,335.62   | -      | -             | -15,970,112,335.62 |
| (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) | -                    | -      | -9,915,776.91 | -9,915,776.91      |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                    | -      | -             | -                  |
| 四、本期期末净资产                                | 1,337,608,221.96     | -      | -             | 1,337,608,221.96   |
| 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                                | 1,301,984,128.31     | -      | -             | 1,301,984,128.31   |
| 加：会计政策变更                                 | -                    | -      | -             | -                  |
| 前期差错更正                                   | -                    | -      | -             | -                  |
| 其他                                       | -                    | -      | -             | -                  |
| 二、本期期初净资产                                | 1,301,984,128.31     | -      | -             | 1,301,984,128.31   |

|  |                    |   |                |                    |
|--|--------------------|---|----------------|--------------------|
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 79,680,649.43      | - | -              | 79,680,649.43      |
| (一)、综合收益总额                               | -                  | - | 12,653,425.73  | 12,653,425.73      |
| (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)      | 79,680,649.43      | - | -              | 79,680,649.43      |
| 其中：1. 基金申购款                              | 17,865,625,266.81  | - | -              | 17,865,625,266.81  |
| 2. 基金赎回款                                 | -17,785,944,617.38 | - | -              | -17,785,944,617.38 |
| (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) | -                  | - | -12,653,425.73 | -12,653,425.73     |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                  | - | -              | -                  |
| 四、本期期末净资产                                | 1,381,664,777.74   | - | -              | 1,381,664,777.74   |

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：

罗国华

汪洋

贺国灵

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

自 2022 年 12 月 19 日起，“上海证券现金添利集合资产管理计划”正式更名为“上海证券现金添利货币型集合资产管理计划”，《上海证券现金添利货币型集合资产管理计划集合资产管理合同》、《上海证券现金添利货币型集合资产管理计划托管协议》和《上海证券现金添利货币型集合资产管理计划招募说明书》等法律文件正式生效，原《上海证券现金添利集合资产管理计



划资产管理合同》、《上海证券现金添利集合资产管理计划说明书》和《上海证券现金添利集合资产管理计划风险揭示书》等法律文件同时失效。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第5号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于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。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

本基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款,主要税项列示如:

##### 1、 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按

证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税, 受让方不再征收, 税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定, 股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让, 暂免征收印花税。

## 2、 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定, 经国务院批准, 自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点, 金融业纳入试点范围, 由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(主封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税; 国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税; 存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定, 金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定, 金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定, 本基金运营过程中发生的增值税应税行为, 以本基金的基金管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定, 证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]190 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

## 3、 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例(2011 年修订)》、《征收教育费附加的暂行规定(2011 年修订)》及相关地方教育附加的征收规定, 凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人, 都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加(除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外)及地方教育费附加。

#### 4、 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 5、 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 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<br>2024 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 182,202,694.75         |

|                |                |
|----------------|----------------|
| 等于：本金          | 182,075,759.96 |
| 加：应计利息         | 126,934.79     |
| 减：坏账准备         | -              |
| 定期存款           | 100,527,139.08 |
| 等于：本金          | 100,000,000.00 |
| 加：应计利息         | 527,139.08     |
| 减：坏账准备         | -              |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -              |
| 存款期限 1-3 个月    | -              |
| 存款期限 3 个月以上    | 100,527,139.08 |
| 其他存款           | -              |
| 等于：本金          | -              |
| 加：应计利息         | -              |
| 减：坏账准备         | -              |
| 合计             | 282,729,833.83 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |                  |            |            |
|--------|-------|------------------------|------------------|------------|------------|
|        |       | 按实际利率计算的<br>账面价值       | 影子定价             | 偏离金额       | 偏离度<br>(%) |
| 债券     | 交易所市场 | 61,387,902.05          | 61,359,561.11    | -28,340.94 | -0.0021    |
|        | 银行间市场 | 1,003,821,329.96       | 1,004,616,947.57 | 795,617.61 | 0.0595     |
|        | 合计    | 1,065,209,232.01       | 1,065,976,508.68 | 767,276.67 | 0.0574     |
| 资产支持证券 |       | -                      | -                | -          | -          |
| 合计     |       | 1,065,209,232.01       | 1,065,976,508.68 | 767,276.67 | 0.0574     |

#### 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

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 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

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 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

无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 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

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>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      | 5,487.25          |
| 其中：交易所市场    | -                 |
| 银行间市场       | 5,487.25          |
| 应付利息        | -                 |
| 预提费用        | 83,890.88         |
| 合计          | 89,378.13         |

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>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          | 1,169,406,944.67   | 1,169,406,944.67   |
| 本期申购          | 16,138,313,612.91  | 16,138,313,612.91  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -15,970,112,335.62 | -15,970,112,335.62 |
| 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           | 1,337,608,221.96   | 1,337,608,221.96   |

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 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           | -             | -     | -             |
| 加：会计政策变更       | -             | -     | -             |
| 前期差错更正         | -             | -     | -             |
| 其他             | -             | -     | -             |
| 本期期初           | -             | -     | -             |
| 本期利润           | 9,915,776.91  | -     | 9,915,776.91  |
| 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        | -9,915,776.91 | -     | -9,915,776.91 |
| 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  | 2,637,063.84         |
| 定期存款利息收入  | 1,141,272.57         |
| 其他存款利息收入  | -                    |
| 结算备付金利息收入 | 6,925.95             |
| 其他        | 50.72                |
| 合计        | 3,785,313.08         |

#### 6.4.7.14 股票投资收益

无。

## 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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 12,080,542.25              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 97,350.49                  |
| 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                           | 12,177,892.74              |

## 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<br>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   | 996,831,467.52             |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 995,919,653.59             |
| 减：应计利息总额               | 814,463.44                 |
| 减：交易费用                 | -                          |
| 买卖债券差价收入               | 97,350.49                  |

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 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

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 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

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

无。

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

无。

## 6.4.7.21 其他收入

无。

## 6.4.7.22 信用减值损失

无。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 审计费用     | 14,918.54                  |
| 信息披露费    | 59,672.34                  |
| 证券出借违约金  | -                          |
| 银行间账户维护费 | 18,600.00                  |
| 银行费用     | 33,173.38                  |
| 电子合同服务费  | 2,000.00                   |
| 合计       | 128,364.26                 |



#### 6.4.7.24 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露

#### 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

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 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

本报告期不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。

##### 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      |
|----------------|--------------|
| 上海证券有限责任公司     | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国证券登记结算有限责任公司 | 基金托管人        |

#### 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

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

## 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                              | 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 |
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 3,745,079.13                    | 4,288,015.76                    |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | -                               | -                               |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 3,745,079.13                    | 4,288,015.76                    |

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.55% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.55\% \div \text{当年天数}$$

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

当以 0.55% 的管理费计算的 7 日年化暂估收益率小于或等于 2 倍活期存款利率时，集合计划管理人将调整管理费为 0.3%，以降低集合计划每万份暂估净收益为负并引发证券交收透支的风险，直至该类风险消除，集合计划管理人方可恢复计提 0.55% 的管理费。集合计划管理人应在费率调整后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由集合计划管理人与集合计划托管人核对一致后，集合计划托管人按照与集合计划管理人协商一致的方式在月初五个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 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 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 340,461.70                      | 389,819.52                      |

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：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由集合计划管理人与集合计划

托管人核对一致后，集合计划托管人按照与集合计划管理人协商一致的方式在月初五个工作日内从集合计划财产中一次性收取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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<br>上海证券现金添利货币 |
| 上海证券有限责任公司     | 1,702,308.69                   |
| 合计             | 1,702,308.69                   |
| 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<br>上海证券现金添利货币 |
| 上海证券有限责任公司     | 321,618.47                     |
| 合计             | 321,618.47                     |

注：本集合计划份额的年销售服务费率为 0.25%。

本集合计划份额的销售服务费计提的计算公式具体如下：

$$H = E \times N \div \text{当年天数}$$

H 为集合计划份额每日应计提的销售服务费

E 为集合计划份额前一日集合计划资产净值

N 为集合计划份额的年销售服务费率

销售服务费每日计提，按月支付，由集合计划管理人与集合计划托管人核对一致后，集合计划托管人按照与集合计划管理人协商一致的方式在月初五个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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

无。

#### 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                   | 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 |
| 基金合同生效日（2022年12月19日）持有的基金份额 | -                    | 15,161,000.00        |

|                         |   |               |
|-------------------------|---|---------------|
| 报告期初持有的基金份额             | - | 15,161,000.00 |
| 报告期内申购/买入总份额            | - | -             |
| 报告期内因拆分变动份额             | - | -             |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额          | - | 15,161,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额             | - | 0.00          |
| 报告期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例 | - | 0.0000 %      |

#### 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

无。

#### 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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>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    |
| 中国证券登记结算有限责任公司 | 863,376.90                 | 43,948.33 | -                               | -         |
| 中国证券登记结算有限责任公司 | -                          | -         | 1,044,709.41                    | 70,768.82 |

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合计     | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 270.83           | 10,086,646.94     | -171,140.86  | 9,915,776.91 | -  |

#### 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

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

### 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

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 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

本产品在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本产品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，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本产品管理人建立了由董事会及风险控制委员会、经理层及风险管理委员会与首席风险官、风险管理总部及其他相关职能部门，业务部门及分支机构的四层级全面风险管理组织体系，明确了各层级在全面风险管理中的职责。其中，董事会是公司全面风险管理的最高决策机构，承担全面风险管理的最终责任，董事会下设风险控制委员会，协助董事会履行相应风险管理职责；公司经理层是公司风险管理策略的最终执行人，对全面风险管理承担主要责任，总经理下设风险管理委员会，协助履行相应风险管理职责；公司设首席风险官，首席风险官负责组织、落实经营层面的全面风险管理工作；风险管理总部在首席风险官的领导下推动全面风险管理工作，风险管理总部是公司市场风险、操作风险、信用风险、流动性风险的归口管理部门；公司各业务部门、分支机构及负责人承担风险管理的直接责任。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指产品在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者产品所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致产品资产损失和收益变化的风险。本产品均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本集合计划持有一家公司发行的证券，其市值不超过集合计划资产净值的 10%，且本集合计划管理人管理的全部大集合计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。

本产品在进行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；产品在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本产品本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本产品本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本产品本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

**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<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 132,081,534.31    | 37,593,796.36       |
| AAA 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | -                 | -                   |
| 合计     | 132,081,534.31    | 37,593,796.36       |

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级，无债项评级的债券取自第三方评级机构的主体评级。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本产品本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 933,127,697.70    | 833,796,851.67      |
| AAA 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | -                 | -                   |
| 合计     | 933,127,697.70    | 833,796,851.67      |

注：评级取自第三方评级机构的主体信用评级。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险，是指产品管理人未能以合理价格及时变现产品资产以支付投资者赎回款项的风险。本产品的流动性风险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，另一方面来自于产品份额持有人可依据产品合同约定要求赎回其持有的产品份额。

本产品管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本产品的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本产品组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

**6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

本产品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，除在附注 6.4.12 中列示的部分产品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。此外，

本产品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，其上限一般不超过产品持有的债券资产的公允价值。

于 2024 年 6 月 30 日，本产品所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。本产品管理人每日预测本产品的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本产品的产品管理人严格按照《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》等有关法规的要求建立健全开放式产品流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本产品组合资产的流动性风险进行管理。在日常运作中，本产品的流动性安排能够与产品合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。本产品的产品管理人在产品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模式带来的流动性风险，有效保障产品持有人利益。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指产品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，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

利率风险是指产品所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本产品所面临的利率风险主要来源于本产品所持有的生息资产。本产品的生息资产主要为银行存款、结算备付金、结算保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>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                   | 242,633,583.79   | 40,096,250.04  | -     | -          | 282,729,833.83   |
| 结算备付金                  | 1,465,875.68     | -              | -     | -          | 1,465,875.68     |
| 存出保证金                  | 14,822.03        | -              | -     | -          | 14,822.03        |
| 交易性金融资产                | 904,199,960.70   | 161,009,271.31 | -     | -          | 1,065,209,232.01 |
| 资产总计                   | 1,148,314,242.20 | 201,105,521.35 | -     | -          | 1,349,419,763.55 |
| 负债                     |                  |                |       |            |                  |
| 应付管理人报酬                | -                | -              | -     | 652,445.63 | 652,445.63       |

|                          |                  |                |       |                |                  |
|--------------------------|------------------|----------------|-------|----------------|------------------|
| 应付托管费                    | -                | -              | -     | 59,313.23      | 59,313.23        |
| 应付清算款                    | -                | -              | -     | 9,911,429.51   | 9,911,429.51     |
| 应付销售服务费                  | -                | -              | -     | 296,566.17     | 296,566.17       |
| 应付利润                     | -                | -              | -     | 796,285.92     | 796,285.92       |
| 应交税费                     | -                | -              | -     | 6,123.00       | 6,123.00         |
| 其他负债                     | -                | -              | -     | 89,378.13      | 89,378.13        |
| 负债总计                     | -                | -              | -     | 11,811,541.59  | 11,811,541.59    |
| 利率敏感度缺口                  | 1,148,314,242.20 | 201,105,521.35 | -     | -11,811,541.59 | 1,337,608,221.96 |
| 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 | 6 个月以内           | 6 个月<br>-1 年   | 1-5 年 | 不计息            | 合计               |
| 资产                       |                  |                |       |                |                  |
| 货币资金                     | 281,136,860.12   | -              | -     | -              | 281,136,860.12   |
| 结算备付金                    | 159,171.60       | -              | -     | -              | 159,171.60       |
| 存出保证金                    | 5,560.45         | -              | -     | -              | 5,560.45         |
| 交易性金融资产                  | 772,104,117.56   | 99,286,530.47  | -     | -              | 871,390,648.03   |
| 买入返售金融资产                 | 50,070,220.12    | -              | -     | -              | 50,070,220.12    |
| 资产总计                     | 1,103,475,929.85 | 99,286,530.47  | -     | -              | 1,202,762,460.32 |
| 负债                       |                  |                |       |                |                  |
| 应付管理人报酬                  | -                | -              | -     | 605,092.61     | 605,092.61       |
| 应付托管费                    | -                | -              | -     | 55,008.45      | 55,008.45        |
| 应付清算款                    | -                | -              | -     | 9,894,884.10   | 9,894,884.10     |
| 卖出回购金融资产款                | 21,504,026.33    | -              | -     | -              | 21,504,026.33    |
| 应付销售服务费                  | -                | -              | -     | 275,042.11     | 275,042.11       |
| 应付利润                     | -                | -              | -     | 967,426.78     | 967,426.78       |
| 应交税费                     | -                | -              | -     | 1,735.35       | 1,735.35         |
| 其他负债                     | -                | -              | -     | 52,299.92      | 52,299.92        |
| 负债总计                     | 21,504,026.33    | -              | -     | 11,851,489.32  | 33,355,515.65    |
| 利率敏感度缺口                  | 1,081,971,903.52 | 99,286,530.47  | -     | -11,851,489.32 | 1,169,406,944.67 |

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |              |                             |                        |
|----|--------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | -            |                             |                        |
| 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 6 月 30 日）        | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
|    | 市场利率下降 25 基点 | 887,391.00                  | 526,772.15             |



|  |              |             |             |
|--|--------------|-------------|-------------|
|  | 市场利率上升 25 基点 | -885,373.12 | -525,616.92 |
|--|--------------|-------------|-------------|

#### 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。本产品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

其他价格风险是指产品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。本产品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

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2024 年 6 月 30 日，本产品无重大价格风险。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

### 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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：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<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                      | -                        |
| 第二层次          | 1,065,209,232.01       | 871,390,648.03           |
| 第三层次          | -                      | -                        |

|    |                  |                |
|----|------------------|----------------|
| 合计 | 1,065,209,232.01 | 871,390,648.03 |
|----|------------------|----------------|

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

|    |
|----|
| 无。 |
|----|

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

|    |
|----|
| 无。 |
|----|

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

|    |
|----|
| 无。 |
|----|

#### 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                | 1,065,209,232.01 | 78.94         |
|    | 其中：债券                 | 1,065,209,232.01 | 78.94         |
|    | 资产支持证<br>券            | -                | -             |
| 2  | 买入返售金融资产              | -                | -             |
|    | 其中：买断式回购的<br>买入返售金融资产 | -                | -             |
| 3  | 银行存款和结算备<br>付金合计      | 284,195,709.51   | 21.06         |
| 4  | 其他各项资产                | 14,822.03        | 0.00          |
| 5  | 合计                    | 1,349,419,763.55 | 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 | 1.40           |                    |
|    | 其中：买断式回购融资   | -              |                    |
| 序号 | 项目           | 金额             | 占基金资产净值的<br>比例 (%) |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | -              | -                  |
|    | 其中：买断式回购融资   | -              | -                  |

#### 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    | 106 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 108 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 72  |

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

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                 | 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                 | 26.57               | 0.74                |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 9.70                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 11.18               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天（含）—120 天          | 2.98                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）      | 50.27               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
|    | 合计                     | 100.70              | 0.74                |

#### 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

报告期内本集合计划投资组合平均剩余期限未超过 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      | -             | -             |
| 2  | 央行票据      | -             | -             |
| 3  | 金融债券      | -             | -             |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -             |
| 4  | 企业债券      | 61,387,902.05 | 4.59          |
| 5  | 企业短期融资券   | 70,693,632.26 | 5.29          |

|    |                    |                  |       |
|----|--------------------|------------------|-------|
| 6  | 中期票据               | -                | -     |
| 7  | 同业存单               | 933,127,697.70   | 69.76 |
| 8  | 其他                 | -                | -     |
| 9  | 合计                 | 1,065,209,232.01 | 79.64 |
| 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  | 112387412 | 23 四川银行 CD137    | 300,000 | 29,841,618.47   | 2.23         |
| 2  | 112491585 | 24 长沙银行 CD026    | 300,000 | 29,800,148.21   | 2.23         |
| 3  | 112493611 | 24 湖北银行 CD031    | 300,000 | 29,709,035.13   | 2.22         |
| 4  | 012384338 | 23 供销 SCP001     | 200,000 | 20,305,920.00   | 1.52         |
| 5  | 112490251 | 24 珠海华润银行 CD003  | 200,000 | 19,989,097.84   | 1.49         |
| 6  | 112313133 | 23 浙商银行 CD133    | 200,000 | 19,988,321.55   | 1.49         |
| 7  | 112309127 | 23 浦发银行 CD127    | 200,000 | 19,981,124.95   | 1.49         |
| 8  | 112491837 | 24 湖北银行 CD018    | 200,000 | 19,958,792.03   | 1.49         |
| 9  | 112492572 | 24 青岛农商行 CD021   | 200,000 | 19,936,094.66   | 1.49         |
| 10 | 112492873 | 24 广西北部湾银行 CD050 | 200,000 | 19,933,161.26   | 1.49         |

### 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                      | 0.0764% |
| 报告期内偏离度的最低值                      | 0.0083% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值           | 0.0411% |

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明

报告期内本集合计划未出现负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况。

## 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况说明

报告期内本集合计划未出现正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况。

## 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

无。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 基金计价方法说明

1、本集合计划估值采用“摊余成本法”，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，在剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益。本集合计划不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算集合计划资产净值。

2、集合计划的暂估净收益为集合计划预提收入的基础上，扣除集合计划运作过程中发生的各项费用。

3、管理人采用计算暂估收益率的方法每日对集合计划进行估值，本集合计划按照下列方法确认以下各类金融工具的暂估收益：

(1) 银行存款以成本列示，每日按照约定利率预提收益，直至分红期末按累计收益除以累计份额确定实际分配的收益率；分红期内遇银行存款提前解付的，按调整后利率预提收益，同时冲减前期已经预提的收益；

(2) 回购交易以成本列示，按约定利率在实际持有期间内逐日预提收益。

### 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，四川银行、长沙银行、湖北银行、珠海华润银行、浙商银行、浦发银行、青岛农商行、广西北部湾银行出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

### 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 | 14,822.03 |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 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    | 14,822.03 |

## § 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>例 (%) | 持有份额             | 占总份额比<br>例 (%) |
| 20,422       | 65,498.39     | 23,580,621.13 | 1.76           | 1,314,027,600.83 | 98.24          |

### 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 | 13,066,000.00 | 0.98       |
| 2  | 个人    | 9,747,481.45  | 0.73       |
| 3  | 个人    | 8,562,272.72  | 0.64       |
| 4  | 个人    | 8,385,466.87  | 0.63       |
| 5  | 个人    | 7,832,702.01  | 0.59       |
| 6  | 个人    | 7,832,682.43  | 0.59       |
| 7  | 个人    | 7,383,807.32  | 0.55       |
| 8  | 个人    | 7,169,703.25  | 0.54       |
| 9  | 个人    | 6,855,123.81  | 0.51       |
| 10 | 个人    | 6,799,523.30  | 0.51       |

### 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 | 15,016,570.35 | 1.1226       |

### 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

无。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                      |                   |
|--------------------------------------|-------------------|
| 基金合同生效日 (2022 年 12 月 19 日)<br>基金份额总额 | 1,503,872,000.00  |
| 本报告期期初基金份额总额                         | 1,169,406,944.67  |
| 本报告期基金总申购份额                          | 16,138,313,612.91 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                        | 15,970,112,335.62 |
| 本报告期基金拆分变动份额                         | -                 |

|             |                  |
|-------------|------------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 1,337,608,221.96 |
|-------------|------------------|

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开份额持有人大会。

### 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、报告期内基金管理人的重大人事变动

本集合计划管理人于 2024 年 5 月 21 日及 2024 年 5 月 29 日发布《上海证券有限责任公司基金行业高级管理人员变更公告》，原公司副总经理张艳红女士因个人原因离职，自 2024 年 5 月 17 日起不再分管资产管理业务，汪洋先生自 2024 年 5 月 27 日起分管资产管理业务。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期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

本报告期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，管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

#### 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，托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 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 (%) |    |
| 上海证券有限责任公司 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |

## 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(%) |
| 上海证券有限责任公司 | 100,817,740.00 | 100.00          | 1,071,110,000.00 | 100.00            | -    | -               |

## 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内本集合计划未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%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  | 上海证券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 年 1 月 16 日 |
| 2  | 上海证券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 年 1 月 22 日 |
| 3  | 上海证券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 年 2 月 20 日 |
| 4  | 上海证券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 年 3 月 18 日 |
| 5  | 上海证券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 年 3 月 29 日 |
| 6  | 上海证券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 年 4 月 16 日 |
| 7  | 上海证券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 年 4 月 22 日 |
| 8  | 上海证券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 年 5 月 16 日 |
| 9  | 上海证券有限责任公司基金行业高级管理人员变更公告           | 中国证监会规定的媒介 | 2024 年 5 月 21 日 |
| 10 | 上海证券有限责任公司基金行业高级管理人员变更公告           | 中国证监会规定的媒介 | 2024 年 5 月 29 日 |
| 11 | 上海证券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 年 6 月 18 日 |

## § 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

无。



## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意变更的文件
- 2、《上海证券现金添利货币型集合资产管理计划集合资产管理合同》
- 3、《上海证券现金添利货币型集合资产管理计划托管协议》
- 4、《上海证券现金添利货币型集合资产管理计划招募说明书》
- 5、法律意见书
- 6、集合计划管理人业务资格批件和营业执照
- 7、集合计划托管人业务资格批件和营业执照
- 8、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

### 12.3 查阅方式

投资者可通过管理人网站（<https://www.shzq.com/>）或致电 4008-918-918 查询，或在营业时间内至集合计划管理人、托管人的办公场所免费查阅。

上海证券有限责任公司

2024 年 8 月 30 日