

国信现金增利货币型集合资产管理计划

2022年第3季度报告

2022年09月30日

基金管理人:国信证券股份有限公司

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:2022年10月26日

§ 1 重要提示

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

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合同规定，于2022年10月17日复核了本报告中的主要财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年07月01日起至2022年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国信现金增利
基金主代码	931204
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年04月25日
报告期末基金份额总额	13,520,435,304.60份
投资目标	在力求资产安全性、流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本集合计划主要投资策略包括资产配置策略、个券选择策略、久期管理策略、流动性管理策略、套利策略、滚动配置策略。未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，本集合计划还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富集合计划投资策略。
业绩比较基准	本集合计划的业绩比较基准为：人民币活期存款利率（税后）。
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。
基金管理人	国信证券股份有限公司

基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司
-------	----------------

注：本报告中所述的“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。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022年07月01日 - 2022年09月30日）
1. 本期已实现收益	57,068,774.60
2. 本期利润	57,068,774.60
3. 期末基金资产净值	13,520,435,304.60

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。由于本集合计划采用实际利率计算账面价值核算，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. 本集合计划无持有人认购或交易基金的各项费用；

3. 本集合计划收益分配按月结转，收益支付方式为红利再投资（即红利转集合计划份额）；

4. 本集合计划变更后合同生效日为2022年04月25日，集合计划合同生效日至本报告期末，本集合计划运作时间未满半年。

3.2 基金净值表现

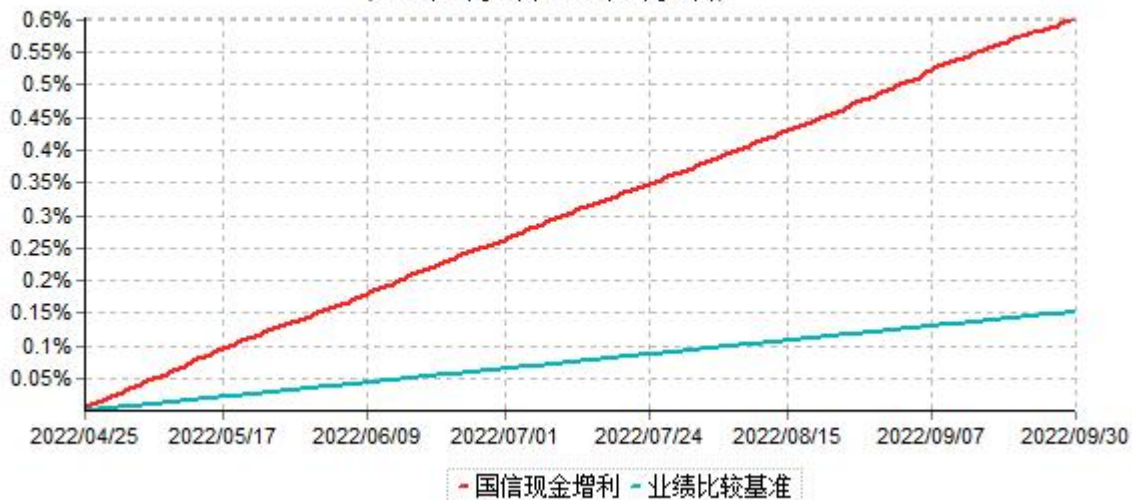
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.3417%	0.0009%	0.0883%	0.0000%	0.2534%	0.0009%
自基金合同生效起至今	0.6019%	0.0008%	0.1526%	0.0000%	0.4493%	0.0008%

注：本集合计划收益分配按月结转，收益支付方式为红利再投资（即红利转集合计划份额）。

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

国信现金增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04月25日-2022年09月30日)



- 注：1. 本集合计划变更后合同生效日为2022年04月25日，截至本报告期末本集合计划成立未满一年；
2. 按集合计划合同和招募说明书的约定，本集合计划建仓期为合同生效后6个月，报告期末已完成建仓，各项资产配置比例符合合同有关规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁策	投资经理	2022-04-25	-	11	梁策，中国国籍，管理学硕士，经济师，具有基金从业资格、证券从业资格，4年证券研究经验、6年证券投资经验。2011年加入国信证券资产管理总部，历任资产管理总部投资助理、投资经理，现任国信证券资产管理总部投资经理。

注：(1)集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为基金合同生效日，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的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

在本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本集合计划的合同等法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在严格控制风险的前提下，为集合计划持有人谋求最大利益。本报告期内，集合计划运作整体合法合规，没有发现损害持有人利益的行为。集合计划的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及本集合计划合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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》，完善相应制度及流程，并重视交易执行环节的公平交易措施，通过投资交易系统内的公平交易模块，公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本报告期内，未发现本集合计划管理人管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本集合计划与本管理人管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期内，未发现本集合计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

1、市场回顾及运作分析

三季度经济弱复苏，较二季度有一定改善，但仍面临就业压力偏大、消费和有效投资不足、出口韧性渐退等挑战，疫情持续局部爆发拖累国内经济修复，海外方面通胀居高不下，加息进程不止，汇率承压。2022年7-9月，PMI指数分别为49、49.4和50.1，9月份再度至荣枯线以上；8月社融增速10.5%，总量弱而结构有所改善，增速同比趋降。三季度货币政策整体稳健偏宽松，8月央行对MLF、OMO超预期降息10BP，带动1年、5年LPR分别下调5、15BP，释放宽货币信号。资金利率中枢先降后升，9月中下旬在缴税、季末等因素冲击下出现边际收敛，央行重启14天跨季逆回购投放近万亿资金，呵护流动性意图明显，三季度资金中枢仍大幅低于政策利率，流动性总体维持充裕状态。三季度，短端利率总体下行，走势上跟随资金利率先下后上，1年期AAA存单整体下行29BP。

三季度本产品组合投资操作灵活积极，整体维持适当的久期，通过波段交易增加资本利得收益实现，并维持高杠杆套利策略实施力度。组合配置方面，以银行存款、同业

存单和高等级短期债券为主，通过资产比价策略选择性价比较高期限及品种。在管理现金流分布、保障组合充足流动性的同时，采取积极应对措施，调整组合结构，应对市场的变化。

2、投资展望

展望四季度，经济基本面仍然承压，制造业和基建构成一定支撑，但出口下行压力、疫情反复消费低迷，地产政策频出但力度不足仍难以扭转当前下行趋势。中美周期分化，临近11月美联储加息对汇率有所压制，短期对债券市场形成制约。流动性方面，当前经济复苏趋势仍不稳固，稳增长仍是央行核心目标，央行或无意主动收紧货币政策，流动性大概率仍保持在适度宽松的区间，但随着经济企稳、超储消耗，资金面预期波动加大，并存在资金利率边际收敛的可能，后续密切关注防疫及地产政策变化及各类宏观稳增长政策落地对信贷的提振效果。

四季度，本集合计划操作上仍以流动性为先，把握市场时机，动态优化组合期限结构，灵活调整仓位和久期，力争给客户带来持续、安全、稳健的回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，国信现金增利基金份额净值收益率为0.3417%，同期业绩比较基准收益率为0.0883%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或集合计划资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	8,850,211,855.98	56.59
	其中：债券	8,850,211,855.98	56.59
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	594,211,309.24	3.80
	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	6,194,607,501.04	39.61
4	其他资产	127,725.05	0.00
5	合计	15,639,158,391.31	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	18.08
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	2,100,177,328.13	15.53
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占集合资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本集合计划债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	71

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。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	42.61	15.53
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	10.14	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	12.54	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

4	90天(含)—120天	0.37	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	50.00	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		115.67	15.53

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本集合计划本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	844,686,446.39	6.25
5	企业短期融资券	2,274,860,855.72	16.83
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,730,664,553.87	42.39
8	其他	-	-
9	合计	8,850,211,855.98	65.46
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112280186	22绍兴银行CD055	2,500,000	245,767,147.96	1.82
2	072210022	22东财证券CP002	2,000,000	203,110,442.63	1.50
3	072210075	22渤海证券CP005	2,000,000	201,579,178.08	1.49
4	072210087	22渤海证券CP006	2,000,000	201,298,082.19	1.49
5	072210132	22申万宏源CP005	2,000,000	200,455,671.23	1.48

6	112286265	22重庆农村商行CD174	2,000,000	198,459,831.20	1.47
7	112208111	22中信银行CD111	2,000,000	198,376,638.56	1.47
8	112287191	22东莞银行CD229	2,000,000	198,341,856.66	1.47
9	112287717	22中原银行CD287	2,000,000	198,225,611.28	1.47
10	112206149	22交通银行CD149	2,000,000	197,484,124.73	1.46

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1072%
报告期内偏离度的最低值	0.0108%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0615%

注：以上数据按交易日统计

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本集合计划本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

本集合计划本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本集合计划按照实际利率法计算金融资产的账面价值，并使用影子定价和偏离度加以控制。

5.9.2 本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，中信银行股份有限公司、绍兴银行股份有限公司、申万宏源证券有限公司、重庆农村商业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到监管部门的处罚，处罚力度和性质对该公司长期经营未产生重大负面影响。本集合计划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合同的要求。除上述主体外，本集合计划投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	127,725.05
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	127,725.05

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和和合计可能有尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	13,995,520,508.98
报告期期间基金总申购份额	108,111,905,993.68
报告期期间基金总赎回份额	108,586,991,198.06
报告期期末基金份额总额	13,520,435,304.60

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	非交易过户入	2022-07-01	169,391,226.00	169,391,226.00	-
2	赎回	2022-07-01	215,133,748.00	215,133,748.00	-
3	非交易过户入	2022-07-04	183,296,427.00	183,296,427.00	-
4	赎回	2022-07-04	169,391,226.00	169,391,226.00	-
5	非交易过户入	2022-07-05	133,862,343.00	133,862,343.00	-
6	赎回	2022-07-05	183,296,427.00	183,296,427.00	-
7	非交易过户入	2022-07-06	140,561,431.00	140,561,431.00	-
8	赎回	2022-07-06	133,862,343.00	133,862,343.00	-
9	非交易过户入	2022-07-07	132,099,765.00	132,099,765.00	-
10	赎回	2022-07-07	140,561,431.00	140,561,431.00	-
11	非交易过户入	2022-07-08	153,418,642.00	153,418,642.00	-
12	赎回	2022-07-08	132,099,765.00	132,099,765.00	-

13	非交易过户入	2022-07-11	136,287,029.00	136,287,029.00	-
14	赎回	2022-07-11	153,418,642.00	153,418,642.00	-
15	非交易过户入	2022-07-12	149,276,710.00	149,276,710.00	-
16	赎回	2022-07-12	136,287,029.00	136,287,029.00	-
17	非交易过户入	2022-07-13	142,182,640.00	142,182,640.00	-
18	赎回	2022-07-13	149,276,710.00	149,276,710.00	-
19	非交易过户入	2022-07-14	128,627,506.00	128,627,506.00	-
20	赎回	2022-07-14	142,182,640.00	142,182,640.00	-
21	非交易过户入	2022-07-15	150,435,220.00	150,435,220.00	-
22	赎回	2022-07-15	128,627,506.00	128,627,506.00	-
23	非交易过户入	2022-07-18	166,437,314.00	166,437,314.00	-
24	赎回	2022-07-18	150,435,220.00	150,435,220.00	-
25	非交易过户入	2022-07-19	156,944,692.00	156,944,692.00	-
26	赎回	2022-07-19	166,437,314.00	166,437,314.00	-
27	非交易过户入	2022-07-20	112,692,393.00	112,692,393.00	-
28	赎回	2022-07-20	156,944,692.00	156,944,692.00	-
29	非交易过户入	2022-07-21	111,822,970.00	111,822,970.00	-
30	赎回	2022-07-21	112,692,393.00	112,692,393.00	-
31	非交易过户入	2022-07-22	130,917,431.00	130,917,431.00	-
32	赎回	2022-07-22	111,822,970.00	111,822,970.00	-
33	非交易过户入	2022-07-25	138,849,168.00	138,849,168.00	-
34	赎回	2022-07-25	130,917,431.00	130,917,431.00	-
35	非交易过户入	2022-07-26	114,297,364.00	114,297,364.00	-
36	赎回	2022-07-26	138,849,168.00	138,849,168.00	-
37	非交易过户入	2022-07-27	122,162,611.00	122,162,611.00	-
38	赎回	2022-07-27	114,455,169.08	114,455,169.08	-
39	非交易过户入	2022-07-28	128,662,246.00	128,662,246.00	-
40	赎回	2022-07-28	122,162,611.00	122,162,611.00	-
41	非交易过户入	2022-07-29	182,028,746.00	182,028,746.00	-
42	赎回	2022-07-29	128,662,246.00	128,662,246.00	-
43	非交易过户入	2022-08-01	190,557,450.00	190,557,450.00	-
44	赎回	2022-08-01	182,028,746.00	182,028,746.00	-
45	非交易过户入	2022-08-02	207,278,001.00	207,278,001.00	-

46	赎回	2022-08-02	190,557,450.00	190,557,450.00	-
47	非交易过户入	2022-08-03	181,281,229.00	181,281,229.00	-
48	赎回	2022-08-03	207,278,001.00	207,278,001.00	-
49	非交易过户入	2022-08-04	195,591,749.00	195,591,749.00	-
50	赎回	2022-08-04	181,281,229.00	181,281,229.00	-
51	非交易过户入	2022-08-05	210,128,516.00	210,128,516.00	-
52	赎回	2022-08-05	195,591,749.00	195,591,749.00	-
53	非交易过户入	2022-08-08	185,934,442.00	185,934,442.00	-
54	赎回	2022-08-08	210,128,516.00	210,128,516.00	-
55	非交易过户入	2022-08-09	174,923,691.00	174,923,691.00	-
56	赎回	2022-08-09	185,934,442.00	185,934,442.00	-
57	非交易过户入	2022-08-10	169,793,017.00	169,793,017.00	-
58	赎回	2022-08-10	174,923,691.00	174,923,691.00	-
59	非交易过户入	2022-08-11	136,609,404.00	136,609,404.00	-
60	赎回	2022-08-11	169,793,017.00	169,793,017.00	-
61	非交易过户入	2022-08-12	198,329,046.00	198,329,046.00	-
62	赎回	2022-08-12	136,609,404.00	136,609,404.00	-
63	非交易过户入	2022-08-15	209,801,132.00	209,801,132.00	-
64	赎回	2022-08-15	198,329,046.00	198,329,046.00	-
65	非交易过户入	2022-08-16	183,167,857.00	183,167,857.00	-
66	赎回	2022-08-16	209,801,132.00	209,801,132.00	-
67	非交易过户入	2022-08-17	165,484,899.00	165,484,899.00	-
68	赎回	2022-08-17	183,167,857.00	183,167,857.00	-
69	非交易过户入	2022-08-18	167,194,608.00	167,194,608.00	-
70	赎回	2022-08-18	165,484,899.00	165,484,899.00	-
71	非交易过户入	2022-08-19	211,495,821.00	211,495,821.00	-
72	赎回	2022-08-19	167,194,608.00	167,194,608.00	-
73	非交易过户入	2022-08-22	200,019,893.00	200,019,893.00	-
74	赎回	2022-08-22	211,495,821.00	211,495,821.00	-
75	非交易过户入	2022-08-23	212,062,317.00	212,062,317.00	-
76	赎回	2022-08-23	200,019,893.00	200,019,893.00	-
77	非交易过户入	2022-08-24	157,411,280.00	157,411,280.00	-
78	赎回	2022-08-24	212,062,317.00	212,062,317.00	-

79	非交易过户入	2022-08-25	187,113,730.00	187,113,730.00	-
80	赎回	2022-08-25	157,411,280.00	157,411,280.00	-
81	非交易过户入	2022-08-26	232,582,455.00	232,582,455.00	-
82	赎回	2022-08-26	187,113,730.00	187,113,730.00	-
83	非交易过户入	2022-08-29	230,154,414.00	230,154,414.00	-
84	赎回	2022-08-29	232,787,562.88	232,787,562.88	-
85	非交易过户入	2022-08-30	198,397,099.00	198,397,099.00	-
86	赎回	2022-08-30	230,154,414.00	230,154,414.00	-
87	非交易过户入	2022-08-31	234,611,176.00	234,611,176.00	-
88	赎回	2022-08-31	198,397,099.00	198,397,099.00	-
89	非交易过户入	2022-09-01	184,412,471.00	184,412,471.00	-
90	赎回	2022-09-01	234,611,176.00	234,611,176.00	-
91	非交易过户入	2022-09-02	208,148,144.00	208,148,144.00	-
92	赎回	2022-09-02	184,412,471.00	184,412,471.00	-
93	非交易过户入	2022-09-05	219,140,039.00	219,140,039.00	-
94	赎回	2022-09-05	208,148,144.00	208,148,144.00	-
95	非交易过户入	2022-09-06	179,229,625.00	179,229,625.00	-
96	赎回	2022-09-06	219,140,039.00	219,140,039.00	-
97	非交易过户入	2022-09-07	195,869,577.00	195,869,577.00	-
98	赎回	2022-09-07	179,229,625.00	179,229,625.00	-
99	非交易过户入	2022-09-08	201,481,048.00	201,481,048.00	-
100	赎回	2022-09-08	195,869,577.00	195,869,577.00	-
101	非交易过户入	2022-09-09	225,747,483.00	225,747,483.00	-
102	赎回	2022-09-09	201,481,048.00	201,481,048.00	-
103	非交易过户入	2022-09-13	232,287,771.00	232,287,771.00	-
104	赎回	2022-09-13	225,747,483.00	225,747,483.00	-
105	非交易过户入	2022-09-14	211,068,781.00	211,068,781.00	-
106	赎回	2022-09-14	232,287,771.00	232,287,771.00	-
107	非交易过户入	2022-09-15	170,790,780.00	170,790,780.00	-
108	赎回	2022-09-15	211,068,781.00	211,068,781.00	-
109	非交易过户入	2022-09-16	224,520,016.00	224,520,016.00	-
110	赎回	2022-09-16	170,790,780.00	170,790,780.00	-
111	非交易过户入	2022-09-19	186,368,574.00	186,368,574.00	-

112	赎回	2022-09-19	224,520,016.00	224,520,016.00	-
113	非交易过户入	2022-09-20	179,146,907.00	179,146,907.00	-
114	赎回	2022-09-20	186,368,574.00	186,368,574.00	-
115	非交易过户入	2022-09-21	183,082,736.00	183,082,736.00	-
116	赎回	2022-09-21	179,146,907.00	179,146,907.00	-
117	非交易过户入	2022-09-22	155,789,590.00	155,789,590.00	-
118	赎回	2022-09-22	183,082,736.00	183,082,736.00	-
119	非交易过户入	2022-09-23	233,460,270.00	233,460,270.00	-
120	赎回	2022-09-23	155,789,590.00	155,789,590.00	-
121	非交易过户入	2022-09-26	229,346,687.00	229,346,687.00	-
122	赎回	2022-09-26	233,460,270.00	233,460,270.00	-
123	非交易过户入	2022-09-27	224,667,485.00	224,667,485.00	-
124	赎回	2022-09-27	229,346,687.00	229,346,687.00	-
125	非交易过户入	2022-09-28	264,739,963.00	264,739,963.00	-
126	赎回	2022-09-28	224,924,724.19	224,924,724.19	-
127	非交易过户入	2022-09-29	300,000,000.00	300,000,000.00	-
128	赎回	2022-09-29	264,739,963.00	264,739,963.00	-
129	非交易过户入	2022-09-30	353,400,535.00	353,400,535.00	-
130	赎回	2022-09-30	300,000,000.00	300,000,000.00	-
合 计			23,836,104,529.15	23,836,104,529.15	

注：“非交易过户入”为管理人提供快取功能产生的份额，“赎回”为赎回非交易过户转入份额。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于准予国信现金增利1号集合资产管理计划合同变更的回函；
- 2、《国信现金增利货币型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《国信现金增利货币型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《国信现金增利货币型集合资产管理计划招募说明书（更新）》
- 5、关于申请《国信现金增利1号集合资产管理合同》变更的法律意见；
- 6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、国信现金增利货币型集合资产管理计划报告期内披露的各项公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人的办公场所，并登载于集合计划管理人网站 www.guosen.com.cn。

9.3 查阅方式

投资者可于本集合计划管理人办公时间预约查阅，或登录集合计划管理人网站 www.guosen.com.cn 查阅，还可拨打本公司客服电话（95536）查询相关信息。

国信证券股份有限公司
2022年10月26日