

# 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

2023 年 12 月 31 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 3 月 29 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。本年度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 3 月 29 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。

本报告中财务资料已经审计。上会会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.9 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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>13</b>
6.1 审计报告基本信息.....	13
6.2 审计报告的基本内容.....	13
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>15</b>
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 净资产变动表.....	18
7.4 报表附注.....	20
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	44

8.2 债券回购融资情况 .....	45
8.3 基金投资组合平均剩余期限 .....	45
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 .....	46
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	46
8.6 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 .....	46
8.7 “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 .....	47
8.8 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资产支持证券投资明 细 .....	47
8.9 投资组合报告附注 .....	47
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	48
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
9.4 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 .....	49
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
11.2 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 .....	49
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
11.4 基金投资策略的改变 .....	49
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	50
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	50
11.9 其他重大事件 .....	50
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</b>
12.1 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 .....	51
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
13.1 备查文件目录 .....	52
13.2 存放地点 .....	52
13.3 查阅方式 .....	52

## § 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	1,169,406,944.67 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。 6、杠杆投资策略 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 负责人	姓名	张艳红	陈晨
	联系电话	021-53686888	010-50938723
	电子邮箱	zhangyanhong@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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="https://www.shzq.com/">https://www.shzq.com/</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	上会会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023 年	2022 年 12 月 19 日（基金合同生效日） -2022 年 12 月 31 日
---------------	--------	--

本期已实现收益	23,712,799.66	832,226.19
本期利润	23,712,799.66	832,226.19
本期净值收益率	1.5794%	0.0579%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末
期末基金资产净值	1,169,406,944.67	1,301,984,128.31
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末
累计净值收益率	1.6382%	0.0579%

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。

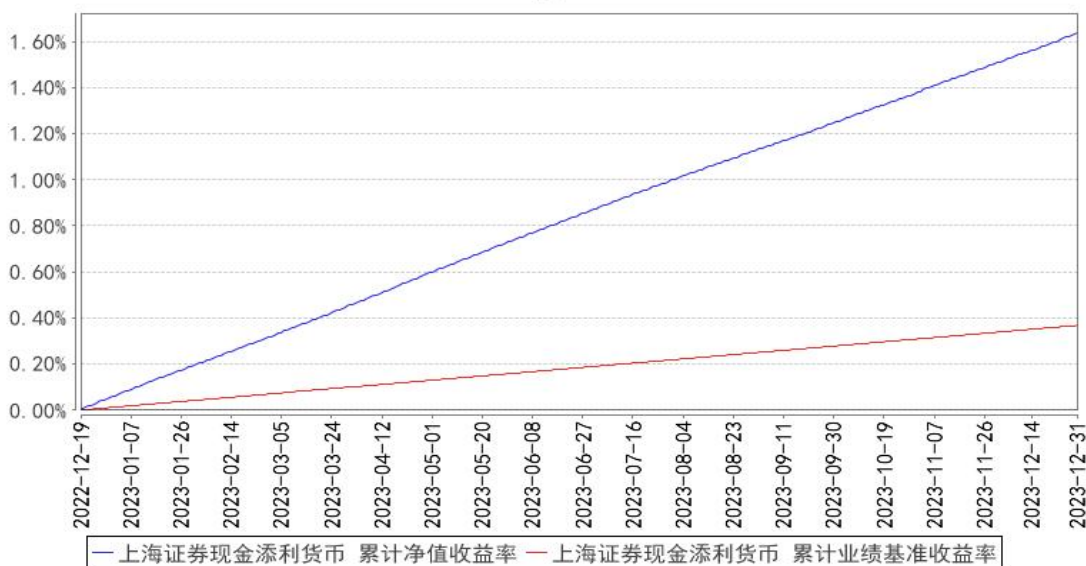
## 3.2 基金净值表现

### 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	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.3860%	0.0006%	0.0920%	0.0002%	0.2940%	0.0004%
过去六个月	0.7657%	0.0005%	0.1800%	0.0002%	0.5857%	0.0003%
过去一年	1.5794%	0.0004%	0.3562%	0.0001%	1.2232%	0.0003%
自基金合同生效起至今	1.6382%	0.0004%	0.3680%	0.0001%	1.2702%	0.0003%

### 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

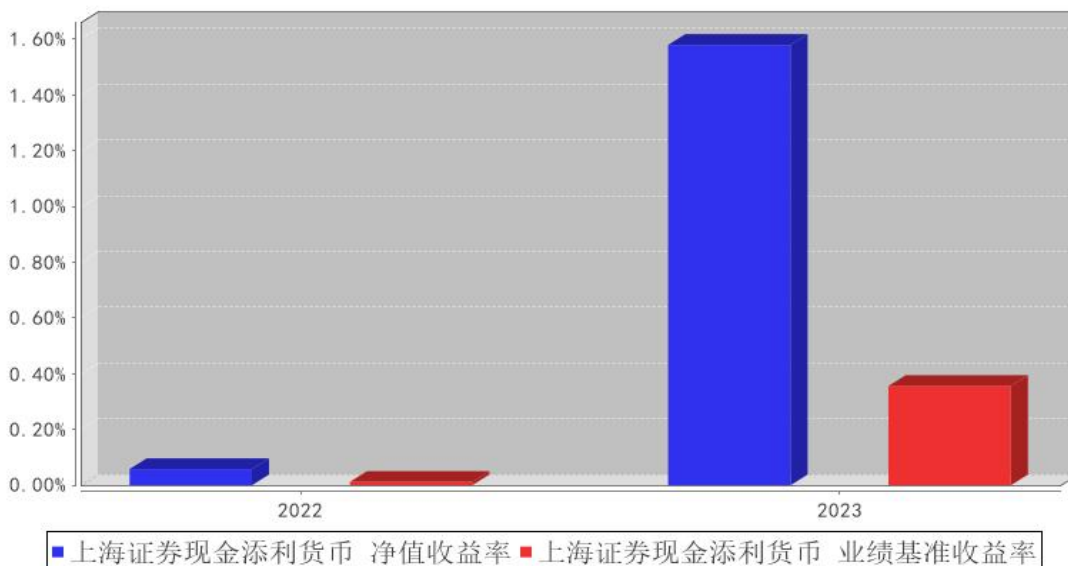
上海证券现金添利货币 累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 2023 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

上海证券现金添利货币 基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元



年度	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	年度利润 分配合计	备注
2023 年	23,954,693.02	-	-241,893.36	23,712,799.66	-
2022 年	4,068,140.11	-	-3,235,913.92	832,226.19	-
合计	28,022,833.13	-	-3,477,807.28	24,545,025.85	-

## § 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 8 家以及营业网点 73 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 2023 年 12 月 31 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	-	23 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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了一级市场和二级市场的所有投资交易管理活动以及公司内部的证券分配，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

##### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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

2023 年是疫情防控放开后的第一年，国内经济增长呈现弱复苏态势，通胀水平持续处于低位，央行执行偏宽松货币政策。2023 年债券市场呈现四阶段的“M”型振荡牛市走势，具体而言，年初至 2 月末，市场对疫后经济复苏具有较强预期，信贷数据也出现强劲改善，债市收益率快速上行并维持高位震荡；3 月初至 8 月中旬，在经济基本面弱现实和降息降准等宽货币举措催化下，债市收益率大幅下行；8 月下旬至 11 月末，“防资金空转”和财政发力加大政府债供给，资金面也在收紧，债市收益率上行；12 月份在稳增长政策力度被市场预期逐步消化，货币政策宽松预期增强，叠加资金面转松，债市收益率下行。操作方面，2023 年本计划采取稳健的投资策略，以同业存单、同业存款为主要配置资产，全年本计划运作久期整体控制较好，为持有人取得了稳健的投资回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末上海证券现金添利货币 基金份额净值为 1.0000 元，本报告期份额净值增长率为 1.5794%，同期业绩比较基准为 0.3562%。

## 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，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，流动性会保持合理充裕态势。总体来看，2024 年债券市场为振荡偏强走势的概率较大，货币市场资金面预计会保持较宽松格局，但也会出现较大波动。操作策略上，2024 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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，管理人依照法律法规和公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的完善，积极推动主动合规管理，全面加强风险控制，不断提高风险控制水平。管理人根据监管要求组织开展内部检查、审计审查，排查风险隐患，主动发现管理中的不足，推动公司内控体系和制度措施的落实，完善公司内控机制，促进公司业务合规开展。

本报告期内，管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展情况，坚持从保障产

品持有人利益出发，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。

本产品管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护产品份额持有人的利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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 23954693.02 元。

#### 4.9 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

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 托管人对本年度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 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	上会师报字（2024）第 1555 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	上海证券现金添利货币型集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	<p>我们审计了上海证券现金添利货币型集合资产管理计划(以下简称“上海证券现金添利货币型集合计划”)财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附上海证券现金添利货币型集合计划的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《上海证券现金添利货币型集合资产管理计划资产管理合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了上海证券现金添利货币型集合计划 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于上海证券现金添利货币型集合计划,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	<p>我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系上海证券现金添利货币型集合计划管理人(以下简称“管理人”)根据《上海证券现金添利货币型集合资产管理计划资产管理合同》的规定为其集合计</p>

	<p>划份额持有人编制的，因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人提供上海证券现金添利货币型集合计划份额持有人和向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用，不得用于其他目的。</p>
其他信息	<p>管理人对其他信息负责。其他信息包括上海证券现金添利货币型集合计划 2023 年度资产管理报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《上海证券现金添利货币型集合资产管理计划资产管理合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理人负责评估上海证券现金添利货币型集合计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</li> <li>2、了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</li> <li>3、评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关</li> </ol>

	披露的合理性。 4、对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对上海证券现金添利货币型集合计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致上海证券现金添利货币型集合计划不能持续经营。 5、评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与管理人就上海证券现金添利货币型集合计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈大愚	江嘉炜
会计师事务所的地址	上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 楼	
审计报告日期	2024 年 3 月 18 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	281,136,860.12	539,741,223.52
结算备付金		159,171.60	773,110.68
存出保证金		5,560.45	25,314.17
交易性金融资产	7.4.7.2	871,390,648.03	753,178,380.46
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		871,390,648.03	753,178,380.46
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	50,070,220.12	10,003,893.48
债权投资	7.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
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	7.4.7.8	-	-
资产总计		1,202,762,460.32	1,303,721,922.31
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		21,504,026.33	-
应付清算款		9,894,884.10	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		605,092.61	285,414.49
应付托管费		55,008.45	63,957.70
应付销售服务费		275,042.11	129,733.85
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,735.35	228.54
应付利润		967,426.78	1,209,320.14
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	52,299.92	49,139.28
负债合计		33,355,515.65	1,737,794.00
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	1,169,406,944.67	1,301,984,128.31
未分配利润	7.4.7.12	-	-
净资产合计		1,169,406,944.67	1,301,984,128.31
负债和净资产总计		1,202,762,460.32	1,303,721,922.31

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,169,406,944.67 份。

## 7.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------



		2023年1月1日至2023年 12月31日	2022年12月19日（基金 合同生效日）至2022年 12月31日
<b>一、营业总收入</b>		37,684,998.43	1,273,735.51
1. 利息收入		11,724,824.32	662,930.01
其中：存款利息收入	7.4.7.13	11,051,412.36	655,718.68
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		673,411.96	7,211.33
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		25,960,174.11	610,805.50
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	25,960,174.11	610,805.50
资产支持证券投 资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.20	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		13,972,198.77	441,509.32
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	8,315,633.83	285,414.49
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	755,966.67	25,946.79
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	3,779,833.64	129,733.85
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		830,742.85	639.59
其中：卖出回购金融资产 支出		830,742.85	639.59
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		2,082.53	23.00
8. 其他费用	7.4.7.23	287,939.25	-248.40
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		23,712,799.66	832,226.19
减：所得税费用		-	-

四、净利润(净亏损以“-”号填列)		23,712,799.66	832,226.19
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		23,712,799.66	832,226.19

### 7.3 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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
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)	-132,577,183.64	-	-	-132,577,183.64
(一)、综合收益总额	-	-	23,712,799.66	23,712,799.66
(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)	-132,577,183.64	-	-	-132,577,183.64
其中：1. 基金申购款	33,898,704,310.90	-	-	33,898,704,310.90
2. 基金赎回款	-34,031,281,494.54	-	-	-34,031,281,494.54
(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)	-	-	-23,712,799.66	-23,712,799.66
四、本期期末净资产	1,169,406,944.67	-	-	1,169,406,944.67

项目	上年度可比期间			
	2022 年 12 月 19 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,503,872,000.00	-	-	1,503,872,000.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-201,887,871.69	-	-	-201,887,871.69
（一）、综合收益总额	-	-	832,226.19	832,226.19
（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）	-201,887,871.69	-	-	-201,887,871.69
其中：1. 基金申购款	1,002,259,736.74	-	-	1,002,259,736.74
2. 基金赎回款	-1,204,147,608.43	-	-	-1,204,147,608.43
（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）	-	-	-832,226.19	-832,226.19
四、本期期末净资产	1,301,984,128.31	-	-	1,301,984,128.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

罗国华

张艳红

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

上海证券现金添利货币型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划或“集合计划”)由上海证券现金添利集合资产管理计划变更而来。上海证券现金添利集合资产管理计划于 2013 年 3 月 1 日正式成立。根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《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》(证监会公告(2018)39 号)的规定,上海证券现金添利集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。经中国证监会批准,自 2022 年 12 月 19 日起,《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》(以下简称“集合计划合同”)生效,原《上海证券现金添利集合资产管理计划合同》自同日起失效。

本集合计划为契约型开放式,自集合计划合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本集合计划管理人为上海证券有限责任公司,本集合计划托管人为中国证券登记结算有限责任公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》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,包括现金;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;期限在 1 个月以内的债券回购;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、超短期融资券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。其中集合计划投资于企业债、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本集合计划投资其他品种,集合计划管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

因资信评级机构调整信用评级等集合计划管理人之外的因素致使集合计划投资范围不符合上述规定的,集合计划管理人应当在该笔资产可出售、可转让或者恢复交易的 10 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。

本集合计划业绩比较基准:人民币活期存款利率(税后)

### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本集合计划记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

###### (2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，在初始确认时以公允价值计量；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资

产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债)，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，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，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，相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值，即按实际利率法计算金融资产的账面价值，同时为了避免按实际利率法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当按实际利率法计算确定的基金资产净值与影子定价确定的基金资产净值产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基

金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1、存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

2、交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

3、股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

4、处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

5、买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

6、公允价值变动收益系本计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

7、转融通证券出借业务中，计划保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生



的差价收入确认为投资收益；

8、其他收入在经济利益很可能流入从而导致本计划资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

1、本计划的管理人报酬、托管费、销售服务费等按资产管理合同约定的方法进行计提。

2、卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

3、其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

4、其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期计划费用。如果影响计划份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本集合计划每份份额享有同等分配权；

2、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、本集合计划采用 1.00 元固定份额净值列示，自集合计划合同生效日起，本集合计划根据每日集合计划收益情况，以每万份集合计划暂估净收益为基准，为投资人每日计算当日暂估收益，并在月度分红日根据实际净收益按月支付；

4、本集合计划根据每日暂估收益情况，将当日暂估收益计入投资人账户，若当日暂估净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日暂估净收益小于零时，为投资人记负收益；若当日暂估净收益等于零时，当日投资人不记收益；

5、收益月度支付时，如投资者的累计实际未结转收益为正，则根据集合计划份额持有人选择的收益支付方式，为集合计划份额持有人增加相应的基金份额或支付相应的现金收益；如投资者的累计实际未结转收益等于零时，集合计划份额持有人的集合计划份额保持不变且不支付现金收益；如投资者的累计实际未结转收益为负，则为集合计划份额持有人缩减相应的集合计划份额，遇投资者剩余集合计划份额不足以扣减的情形，管理人将根据内部应急机制保障集合计划平稳运行；

6、投资者赎回集合计划份额时，按本金支付，赎回份额当期对应的收益，于当期月度分红日支付；

7、投资者解约情形下，按照当期收益分配期间收益率与解约日中国人民银行公布的活期存款利率孰低的原则计付收益；

8、当日申购的集合计划份额自下一个工作日起，享有集合计划的收益分配权益；当日赎回的集合计划份额自下一个工作日起，不享有集合计划的收益分配权益；

9、在不违反法律法规、本合同的约定以及对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，管理人可调整集合计划收益的分配原则和支付方式，不需召开份额持有人大会；

10、如需召开份额持有人大会，集合计划份额持有人的表决权以登记机构在权益登记日登记的份额体现其持有的权益；

11、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 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

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日

活期存款	180,704,449.17	539,741,223.52
等于：本金	180,515,075.43	539,183,677.35
加：应计利息	189,373.74	557,546.17
减：坏账准备	-	-
定期存款	100,432,410.95	-
等于：本金	100,000,000.00	-
加：应计利息	432,410.95	-
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	100,432,410.95	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	281,136,860.12	539,741,223.52

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 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	25,462,487.54	25,446,536.17	-15,951.37	-0.0014
	银行间市场	845,928,160.49	846,366,853.20	438,692.71	0.0375
	合计	871,390,648.03	871,813,389.37	422,741.34	0.0362
资产支持证券		-	-	-	-
合计		871,390,648.03	871,813,389.37	422,741.34	0.0362
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 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	10,170,428.36	10,145,568.22	-24,860.14	-0.0019
	银行间市场	743,007,952.10	743,315,905.48	307,953.38	0.0236
	合计	753,178,380.46	753,461,473.70	283,093.24	0.0217
资产支持证券		-	-	-	-
合计		753,178,380.46	753,461,473.70	283,093.24	0.0217

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

## 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

## 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 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 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	50,070,220.12	-
合计	50,070,220.12	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	10,003,893.48	-
合计	10,003,893.48	-

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.6 其他债权投资

## 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

无。

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31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	12,999.92	13,636.64
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	12,999.92	13,636.64
应付利息	-	-
预提费用	39,300.00	35,502.64
合计	52,299.92	49,139.28

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,301,984,128.31	1,301,984,128.31
本期申购	33,898,704,310.90	33,898,704,310.90
本期赎回（以“-”号填列）	-34,031,281,494.54	-34,031,281,494.54
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	1,169,406,944.67	1,169,406,944.67

## 7.4.7.11 其他综合收益

无。

## 7.4.7.12 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	23,712,799.66	-	23,712,799.66
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	-23,712,799.66	-	-23,712,799.66
本期末	-	-	-

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年12月19日（基金合同生效日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	9,909,267.09	655,252.23
定期存款利息收入	1,128,938.72	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	13,036.27	451.78
其他	170.28	14.67
合计	11,051,412.36	655,718.68

## 7.4.7.14 股票投资收益

无。

## 7.4.7.15 债券投资收益

## 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年12月19日（基金合同生效日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	26,015,751.65	610,805.50
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到	-55,577.54	-



期兑付) 差价收入		
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	25,960,174.11	610,805.50

#### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年12月19日（基金合同生 效日）至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券 到期兑付）成交总额	2,237,709,337.82	10,000,000.00
减：卖出债券（债转股及 债券到期兑付）成本总额	2,237,000,000.00	10,000,000.00
减：应计利息总额	764,915.36	-
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-55,577.54	-

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

**7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

无。

**7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

**7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

**7.4.7.18 衍生工具收益****7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**7.4.7.19 股利收益**

无。

**7.4.7.20 公允价值变动收益**

无。

**7.4.7.21 其他收入**

无。

**7.4.7.22 信用减值损失**

无。

**7.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年12月19日(基金合同生效日)至2022年12月31日
审计费用	30,000.00	-8,219.84
信息披露费	154,497.36	5,502.64
证券出借违约金	-	-
银行间账户维护费	46,200.00	-
银行费用	56,941.89	2,468.80
其他	300.00	-
合计	287,939.25	-248.40

**7.4.7.24 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

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本集合计划无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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
百联集团有限公司	基金管理人的股东
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东
上海上国投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海国际集团有限公司	基金管理人的股东
上海城投（集团）有限公司	基金管理人的股东
海证期货有限公司	基金管理人的全资子公司

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年12月19日(基金合同生效日)至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,315,633.83	285,414.49
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	-	-

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。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年12月19日(基金合同生效日)至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	755,966.67	25,946.79

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。

#### 7.4.10.2.3 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 2023年1月1日至2023年12月31日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
	上海证券现金添利货币	
上海证券有限责任公司	3,779,833.64	
合计	3,779,833.64	
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年12月19日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
	上海证券现金添利货币	
上海证券有限责任公司	129,733.85	
合计	129,733.85	

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年12月19日（基金合同生效日）至2022年12月31日
	基金合同生效日（2022年12月	15,161,000.00

19 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	15,161,000.00	15,161,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	15,161,000.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	15,161,000.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	1.1600 %

#### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 12 月 19 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 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	957,756.83	123,880.23	1,779,918.04	4,253.82

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

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
23,954,693.02	-	-241,893.36	23,712,799.66	-

#### 7.4.12 期末 (2023 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
112313094	23 浙商银行 CD094	2024 年 1 月 2 日	99.20	239,000	23,709,535.93
合计				239,000	23,709,535.93

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.2.1 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。

**7.4.13.2.2 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。

**7.4.13.2.3 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。

**7.4.13.2.4 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	37,593,796.36	30,175,509.29
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	37,593,796.36	30,175,509.29

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。

**7.4.13.2.5 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。

**7.4.13.2.6 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	833,796,851.67	723,002,871.17
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	833,796,851.67	723,002,871.17

注：评级取自第三方评级机构的主体信用评级。

**7.4.13.3 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。

**7.4.13.3.1 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7.4.12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 2023 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 21,504,026.33 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，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。

#### 7.4.13.3.2 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 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	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

	85				
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
上年度末 2022 年 12 月 31 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	539,741,223.52	-	-	-	539,741,223.52
结算备付金	773,110.68	-	-	-	773,110.68
存出保证金	25,314.17	-	-	-	25,314.17
交易性金融资产	546,629,490.17	206,548,890.29	-	-	753,178,380.46
买入返售金融资产	10,003,893.48	-	-	-	10,003,893.48
资产总计	1,097,173,032.02	206,548,890.29	-	-	1,303,721,922.31
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	285,414.49	285,414.49
应付托管费	-	-	-	63,957.70	63,957.70
应付销售服务费	-	-	-	129,733.85	129,733.85
应付利润	-	-	-	1,209,320.14	1,209,320.14
应交税费	-	-	-	228.54	228.54
其他负债	-	-	-	49,139.28	49,139.28
负债总计	-	-	-	1,737,794.00	1,737,794.00
利率敏感度缺口	1,097,173,032.02	206,548,890.29	-	-1,737,794.00	1,301,984,128.31

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-		
	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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	市场利率上升 25 基	-525,616.92	-690,242.98

	点		
	市场利率下降 25 基点	526,772.15	692,036.68

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

##### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

### 7.4.14 公允价值

#### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
---------------	-------------------------	--------------------------

第一层次	-	-
第二层次	871,390,648.03	753,178,380.46
第三层次	-	-
合计	871,390,648.03	753,178,380.46

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

##### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

无。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	871,390,648.03	72.45
	其中：债券	871,390,648.03	72.45
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	50,070,220.12	4.16
	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	281,296,031.72	23.39

	付金合计		
4	其他各项资产	5,560.45	0.00
5	合计	1,202,762,460.32	100.00

## 8.2 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	2.67	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	21,504,026.33	1.84
	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%。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 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	88
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	67

### 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。

### 8.3.2 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	23.14	2.68
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	12.11	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	19.17	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	14.43	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	33.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

合计	102.75	2.68
----	--------	------

#### 8.4 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。

#### 8.5 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	25,462,487.54	2.18
5	企业短期融资券	12,131,308.82	1.04
6	中期票据	-	-
7	同业存单	833,796,851.67	71.30
8	其他	-	-
9	合计	871,390,648.03	74.52
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 8.6 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	112317169	23 光大银行 CD169	500,000	49,343,037.76	4.22
2	112309082	23 浦发银行 CD082	400,000	39,713,767.46	3.40
3	112310223	23 兴业银行 CD223	300,000	29,793,284.93	2.55
4	112313094	23 浙商银行 CD094	300,000	29,760,923.76	2.54
5	112305027	23 建设银行 CD027	200,000	19,935,526.69	1.70
6	112399524	23 宁波银行 CD104	200,000	19,927,981.54	1.70
7	112399786	23 杭州银行 CD145	200,000	19,927,344.84	1.70

8	112313113	23 浙商银行 CD113	200,000	19,922,331.16	1.70
9	112313106	23 浙商银行 CD106	200,000	19,913,949.63	1.70
10	112313119	23 浙商银行 CD119	200,000	19,905,750.47	1.70

### 8.7 “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	0.0944%
报告期内偏离度的最低值	-0.0611%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0369%

#### 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。

### 8.8 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资产支持证券投资明细

无。

### 8.9 投资组合报告附注

#### 8.9.1 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。

### 8.9.2 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，光大银行、浦发银行、兴业银行、浙商银行、建设银行、宁波银行、杭州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。

### 8.9.3 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	5,560.45
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	5,560.45

### 8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 (%)
20,361	57,433.67	24,063,445.64	2.06	1,145,343,499.00	97.94

### 9.2 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	15,593,000.00	1.33
2	个人	10,968,385.94	0.94
3	个人	8,794,945.08	0.75
4	个人	7,729,362.58	0.66
5	个人	7,644,315.79	0.65
6	个人	7,099,715.40	0.61
7	个人	5,678,368.92	0.49
8	个人	5,514,453.18	0.47
9	个人	4,982,464.65	0.43
10	个人	4,918,550.30	0.42



**9.3 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	8,833,353.86	0.7600

**9.4 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。

**§ 10 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） 基金份额总额	1,503,872,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,301,984,128.31
本报告期基金总申购份额	33,898,704,310.90
减：本报告期基金总赎回份额	34,031,281,494.54
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,169,406,944.67

**§ 11 重大事件揭示****11.1 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。

**11.2 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2023年10月18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》，自2023年10月16日起，李海超先生担任公司董事长。

**2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

无。

**11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

无。

**11.4 基金投资策略的改变**

本报告期投资策略未发生改变。

**11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期末改聘会计师事务所。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 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。

### 11.6.2 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	-	-	-	-	-

### 11.7.2 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	35,227,850.00	100.00	1,851,500,000.00	100.00	-	-

## 11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

无。

## 11.9 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基金经理变更公告	中国证监会规定的媒介	2023 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收益支付公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 1 月 17 日
3	上海证券现金添利货币型集合资产管理计划 2022 年第 4 季度资产管理报告	中国证监会规定的媒介	2023 年 1 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	2023 年 2 月 16 日

5	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	2023 年 3 月 16 日
6	关于上海证券现金添利货币型集合资产管理计划“快速取现”服务新增主存管行建设银行的公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 3 月 21 日
7	上海证券现金添利货币型集合资产管理计划 2022 年度资产管理报告	中国证监会规定的媒介	2023 年 3 月 31 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	2023 年 4 月 18 日
9	上海证券现金添利货币型集合资产管理计划 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定的媒介	2023 年 4 月 21 日
10	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	2023 年 5 月 16 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	2023 年 6 月 16 日
12	关于上海证券现金添利货币型集合资产管理计划快速取现业务单日总额度调整的公告	中国证监会规定的媒介	2023 年 7 月 17 日
13	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	2023 年 7 月 18 日
14	上海证券现金添利货币型集合资产管理计划 2023 年第 2 季度报告	中国证监会规定的媒介	2023 年 7 月 21 日
15	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	2023 年 8 月 16 日
16	上海证券现金添利货币型集合资产管理计划 2023 年中期报告	中国证监会规定的媒介	2023 年 8 月 31 日
17	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	2023 年 9 月 18 日
18	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	2023 年 10 月 17 日
19	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	2023 年 10 月 18 日
20	上海证券现金添利货币型集合资产管理计划 2023 年第 3 季度报告	中国证监会规定的媒介	2023 年 10 月 25 日
21	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	2023 年 11 月 16 日
22	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	2023 年 12 月 18 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 存放地点

上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

### 13.3 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 3 月 29 日