

国联现金增利货币市场基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:国联基金管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 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。本中期报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月23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01月01日起至2024年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 债券回购融资情况	41
7.3 基金投资组合平均剩余期限	41
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	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	43
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	43
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	44
7.9 投资组合报告附注	44
§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§9 开放式基金份额变动	47
§10 重大事件揭示	47

10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	49
10.9 其他重大事件	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	51

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联现金增利货币市场基金	
基金简称	国联现金增利货币	
基金主代码	003678	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年11月22日	
基金管理人	国联基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	18,386,781,531.37份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国联现金增利货币A	国联现金增利货币C
下属分级基金的交易代码	003678	003679
报告期末下属分级基金的份额总额	81,236,047.42份	18,305,545,483.95份

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金将根据宏观经济走势、货币政策、短期资金市场状况等因素对利率走势进行综合判断，并根据利率预期动态调整基金投资组合的平均剩余期限，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。</p> <ol style="list-style-type: none"> 1.久期控制策略 2.资产类属配置策略 3.时机选择策略 4.套利策略
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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		国联基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	曹健	张立学
	联系电话	010-56517000	010-68858113
	电子邮箱	caojian@gfund.com	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		400-160-6000; 010-56517299	95580
传真		010-56517001	-
注册地址		深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3086号大百汇广场31层02-04单元	北京市西城区金融大街3号
办公地址		北京市东城区安定门外大街208号玖安广场A座11层	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		100011	100808
法定代表人		王瑶	刘建军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国联基金管理有限公司	北京市东城区安定门外大街208号玖安广场A座11层
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	国联现金增利货币 A	国联现金增利货币 C
本期已实现收益	852,962.91	215,346,629.94
本期利润	852,962.91	215,346,629.94
本期净值收益率	0.9430%	1.0637%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末基金资产净值	81,236,047.42	18,305,545,483.95
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
累计净值收益率	22.4913%	24.7431%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

2、本基金利润分配是按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国联现金增利货币A

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
过去一个月	0.1350%	0.0002%	0.1110%	0.0000%	0.0240%	0.0002%
过去三个月	0.4241%	0.0002%	0.3366%	0.0000%	0.0875%	0.0002%

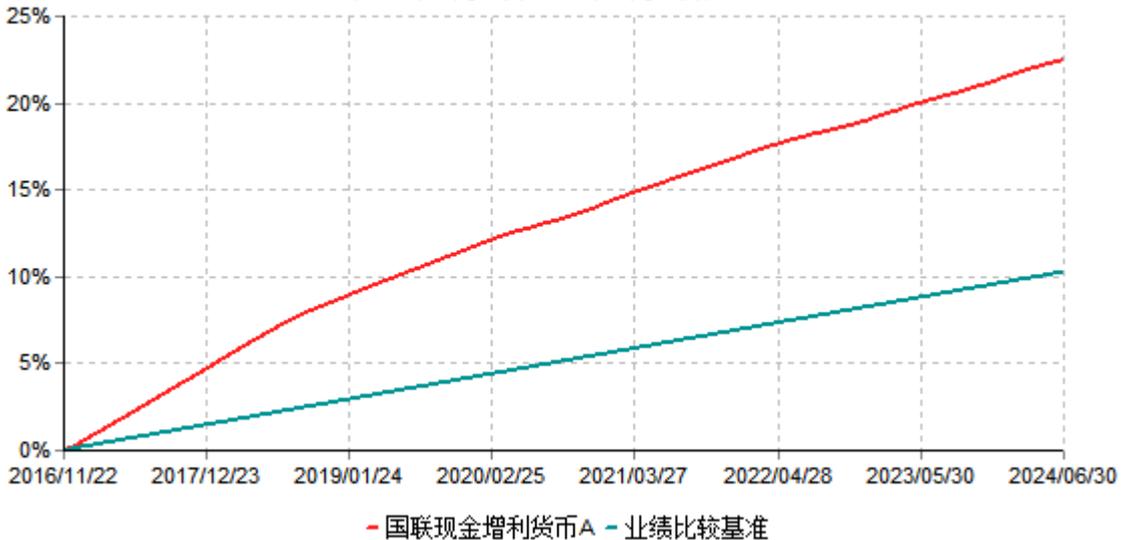
过去六个月	0.9430%	0.0006%	0.6732%	0.0000%	0.2698%	0.0006%
过去一年	1.9025%	0.0006%	1.3537%	0.0000%	0.5488%	0.0006%
过去三年	6.0131%	0.0007%	4.0537%	0.0000%	1.9594%	0.0007%
自基金合同生效起至今	22.4913%	0.0026%	10.2748%	0.0000%	12.2165%	0.0026%

国联现金增利货币C

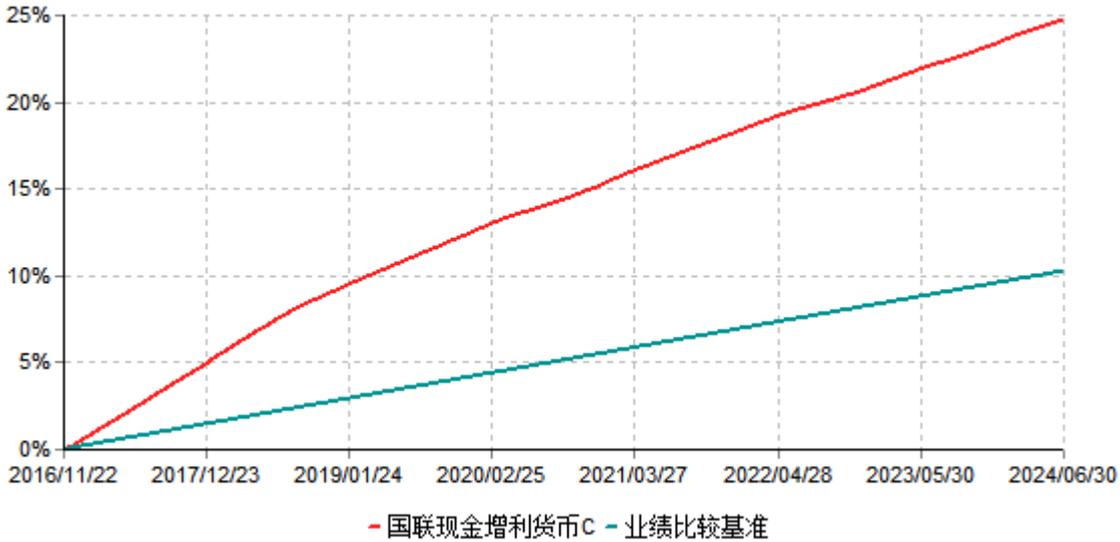
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1547%	0.0002%	0.1110%	0.0000%	0.0437%	0.0002%
过去三个月	0.4841%	0.0002%	0.3366%	0.0000%	0.1475%	0.0002%
过去六个月	1.0637%	0.0006%	0.6732%	0.0000%	0.3905%	0.0006%
过去一年	2.1484%	0.0006%	1.3537%	0.0000%	0.7947%	0.0006%
过去三年	6.7805%	0.0007%	4.0537%	0.0000%	2.7268%	0.0007%
自基金合同生效起至今	24.7431%	0.0026%	10.2748%	0.0000%	14.4683%	0.0026%

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

国联现金增利货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年11月22日-2024年06月30日)



国联现金增利货币C累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年11月22日-2024年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§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

本基金管理人为国联基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由国联证券股份有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金7.5亿元人民币。截至2024年6月30日，国联基金管理有限公司共管理87只基金，包括国联货币市场基金、国联国企改革灵活配置混合型证券投资基金、国联新机遇灵活配置混合型证券投资基金、国联鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、国联国证钢铁行业指数型证券投资基金、国联中证煤炭指数型证券投资基金、国联新经济灵活配置混合型证券投资基金、国联日日盈交易型货币市场基金、国联产业升级灵活配置混合型证券投资基金、国联竞争优势股票型证券投资基金、国联现金增利货币市场基金、国联上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、国联恒泰纯债债券型证券投资基金、国联鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、国联物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、国联盈泽中短债债券型证券投资基金、国联恒信纯债债券型证券投资基金、国联睿祥纯债债券型证券投资基金、国联核心成长灵活配置混合型证券投资基金、国联沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、国联鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、国联聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联季季红定期开放债券型证券投资基金、国联智选红

利股票型证券投资基金、国联聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联医疗健康精选混合型证券投资基金、国联聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒裕纯债债券型证券投资基金、国联聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒惠纯债债券型证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联策略优选混合型证券投资基金、国联聚汇3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒鑫纯债债券型证券投资基金、国联高股息精选混合型证券投资基金、国联睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金、国联聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联恒安纯债债券型证券投资基金、国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、国联品牌优选混合型证券投资基金、国联中债1-5年国开行债券指数证券投资基金、国联聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国联融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、国联价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、国联创业板两年定期开放混合型证券投资基金、国联成长优选混合型证券投资基金、国联景瑞一年持有期混合型证券投资基金、国联景颐6个月持有期混合型证券投资基金、国联行业先锋6个月持有期混合型证券投资基金、国联鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金、国联景盛一年持有期混合型证券投资基金、国联恒益纯债债券型证券投资基金、国联恒阳纯债债券型证券投资基金、国联低碳经济3个月持有期混合型证券投资基金、国联景泓一年持有期混合型证券投资基金、国联金融鑫选3个月持有期混合型证券投资基金、国联匠心优选混合型证券投资基金、国联添益进取3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、国联恒利纯债债券型证券投资基金、国联高质量成长混合型证券投资基金、国联景惠混合型证券投资基金、国联聚优一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒泽纯债债券型证券投资基金、国联研发创新混合型证券投资基金、国联优势产业混合型证券投资基金、国联医药消费混合型证券投资基金、国联成长先锋一年持有期混合型证券投资基金、国联益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金、国联益泓90天滚动持有债券型证券投资基金、国联兴鸿优选混合型证券投资基金、国联恒通纯债债券型证券投资基金、国联融盛双盈债券型证券投资基金、国联养老目标日期2045三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、国联中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、国联恒润纯债债券型证券投资基金、国联添安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、国联消费精选混合型证券投资基金、国联融誉双华6个月持有期债券型证券投资基金、国联泓安3个月定期开放债券型证券投资基金、国联中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金、国联智选先锋股票型证券投资基金、国联益诚30天持有期债券型发起式证券投资基金、国联利率债债券型证券投资基金。

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		
李倩	国联货币市场基金、国联恒泰纯债债券型证券投资基金、国联现金增利货币市场基金、国联聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。	2017-08-25	-	17	李倩女士，中国国籍，毕业于对外经济贸易大学金融学专业，硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限17年。2007年7月至2014年7月曾任银华基金管理有限公司交易管理部交易员，固定收益部基金经理助理。2014年7月加入公司，现任固收投资一部基金经理。

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）证券基金从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行，公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节

的内部控制，在研究、决策、交易执行各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年，地产投资拖累基本面，新的增长亮点暂时还难以见成效，出口韧性托底经济维持弱势复苏格局。货币政策基调宽松，化债大背景下信用债供给减少，政府债发行持续偏慢，债市资产荒现象明显。监管整顿手工补息促使存款搬家，非银配置需求旺盛。在多重有利因素的带动下，债券市场上半年走出了顺畅的下行态势。

一季度央行超预期降准和降低LPR利率，叠加年初配置需求旺盛，先是中长债快速下行，曲线牛平，三月两会前后市场担忧供给扰动，长债趋于震荡，中短端补涨，曲线陡峭化。二季度监管整顿手工补息，资金涌向非银，5年等中段品种表现最好，长债、超长债在央行的指导下震荡下行。最终1年国债下行60bp至1.52%，5年国债下行45bp至1.98%，10年国债下行36bp至2.2%，30年国债下行41bp至2.43%。AAA的中短期票据，1年期下行50bp至2.02%，3年期下行57bp至2.15%，5年期下行66bp至2.28%。1年期AAA存单下行49bp至1.96%。

本基金坚持货币市场基金作为流动性管理工具的定位，合理安排现金流，严控信用风险和杠杆风险，灵活调整各类资产配置，积极应对市场变化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国联现金增利货币A基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.9430%，同期业绩比较基准收益率为0.6732%；截至报告期末国联现金增利货币C基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为1.0637%，同期业绩比较基准收益率为0.6732%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，基本面预计延续复苏态势，需关注稳增长压力下增量政策的变化；流动性方面，预计央行将继续保持宽松环境；非银方面，增量可能弱于上半年，杠杆维持

低位；供需方面，实体融资需求持续偏弱，地方债发行进度慢于预期，关注发债提速带来的扰动。债市行情预计以震荡偏强为主，积极把握波段机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；设立估值委员会，估值委员会成员由具有专业胜任能力和相关工作经历的高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，负责研究、指导基金估值业务，基金经理根据公司制度参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则及具体估值程序；估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，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。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的利润分配方式为按日结转份额。本基金的各级基金份额均采用人民币1.00元的固定份额净值交易方式，每日将各级基金份额实现的基金净收益分配给该级基金份额持有人。

本基金本报告期内向A类份额持有人分配利润：852,962.91元，向C类份额持有人分配利润：215,346,629.94元。

§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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国联现金增利货币市场基金（以下称“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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计

算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，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。

本报告期内，本基金共进行利润分配216,199,592.85元。

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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国联现金增利货币市场基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	7,211,296,201.45	3,456,150,691.85
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	7,488,476,175.58	6,502,584,877.93
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		7,488,476,175.58	6,502,584,877.93
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	4,200,228,679.14	3,256,384,842.26
应收清算款		-	-
应收股利		-	-

应收申购款		45,320.00	30,306,800.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		18,900,046,376.17	13,245,427,212.04
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		508,690,503.97	1,513,264,673.29
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,915,436.63	1,901,430.95
应付托管费		971,812.22	633,810.31
应付销售服务费		210,495.79	148,414.92
应付投资顾问费		-	-
应交税费		10,761.80	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	465,834.39	442,527.30
负债合计		513,264,844.80	1,516,390,856.77
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	18,386,781,531.37	11,729,036,355.27
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		18,386,781,531.37	11,729,036,355.27
负债和净资产总计		18,900,046,376.17	13,245,427,212.04

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额总额18,386,781,531.37份，其中A类基金份额的份额总额为81,236,047.42份，份额净值1.0000元；C类基金份额的份额总额为18,305,545,483.95份，份额净值1.0000元。

6.2 利润表

会计主体：国联现金增利货币市场基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		243,993,571.22	380,732,060.88
1.利息收入		157,311,454.00	241,131,520.54
其中：存款利息收入	6.4.7.9	81,665,700.60	129,610,382.85
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		75,645,753.40	111,521,137.69
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		86,682,117.22	139,600,540.34
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	86,682,117.22	139,600,540.34
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”	6.4.7.18	-	-

号填列)			
减：二、营业总支出		27,793,978.37	40,206,627.24
1.管理人报酬		15,456,906.51	22,607,136.61
2.托管费		5,152,302.21	7,535,712.19
3.销售服务费		1,138,113.67	1,754,201.85
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		5,935,276.63	8,198,736.80
其中：卖出回购金融资产支出		5,935,276.63	8,198,736.80
6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		3,351.75	2,979.64
8.其他费用	6.4.7.20	108,027.60	107,860.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		216,199,592.85	340,525,433.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		216,199,592.85	340,525,433.64
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		216,199,592.85	340,525,433.64

6.3 净资产变动表

会计主体：国联现金增利货币市场基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	11,729,036,355.27	-	11,729,036,355.27
二、本期期初净资产	11,729,036,355.27	-	11,729,036,355.27

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,657,745,176.10	-	6,657,745,176.10
（一）、综合收益总额	-	216,199,592.85	216,199,592.85
（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）	6,657,745,176.10	-	6,657,745,176.10
其中：1.基金申购款	32,469,692,165.86	-	32,469,692,165.86
2.基金赎回款	-25,811,946,989.76	-	-25,811,946,989.76
（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）	-	-216,199,592.85	-216,199,592.85
四、本期期末净资产	18,386,781,531.37	-	18,386,781,531.37
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	24,275,151,335.39	-	24,275,151,335.39
二、本期期初净资产	24,275,151,335.39	-	24,275,151,335.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,085,088,580.62	-	-3,085,088,580.62
（一）、综合收益总额	-	340,525,433.64	340,525,433.64
（二）、本期基金	-3,085,088,580.62	-	-3,085,088,580.62

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	20,272,364,429.04	-	20,272,364,429.04
2.基金赎回款	-23,357,453,009.66	-	-23,357,453,009.66
（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）	-	-340,525,433.64	-340,525,433.64
四、本期期末净资产	21,190,062,754.77	-	21,190,062,754.77

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：

王瑶

周妹云

李克

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国联现金增利货币市场基金(原名为中融现金增利货币市场基金,以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2016]2418号文《关于准予中融现金增利货币市场基金注册的批复》批准,由国联基金管理有限公司(原中融基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《中融现金增利货币市场基金基金合同》("基金合同")公开募集,基金合同于2016年11月22日正式生效。本基金的基金管理人为国联基金管理有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人2023年9月6日发布的《国联基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》本基金自2023年9月8日起更名为国联现金增利货币市场基金。

本基金募集期为2016年11月14日至2016年11月17日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次募集(无认购费)的有效认购金额为人民币2,000,148,772.03元,折合2,000,148,772.03份基金份额(其中:A类基金份额为148,772.03份;C类基金份额为

2,000,000,000.00份)。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币233,355.55元,折合233,355.55份基金份额(其中:A类基金份额为22.22份;C类基金份额为233,333.33份),以上收到的实收基金共计人民币2,000,382,127.58元,折合2,000,382,127.58份国联现金增利货币基金份额(其中:A类基金份额为148,794.25份;C类基金份额为2,000,233,333.33份),有效认购户数为389户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定,本基金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、债券回购、中央银行票据和同业存单,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券,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。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金业绩比较基准:七天通知存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《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、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》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06月30日的财务状况以及2024年上半年度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

本基金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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、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》、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》、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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90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》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、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，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人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,暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

5、基金卖出股票缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7、本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	446,076.67
等于: 本金	445,397.64
加: 应计利息	679.03
减: 坏账准备	-
定期存款	7,210,850,124.78
等于: 本金	7,195,000,000.00
加: 应计利息	15,850,124.78
减: 坏账准备	-
其中: 存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	972,605,986.56
存款期限3个月以上	6,238,244,138.22
其他存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-
合计	7,211,296,201.45

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年06月30日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	7,488,476,175.58	7,489,126,915.49	650,739.91	0.0035
	合计	7,488,476,175.58	7,489,126,915.49	650,739.91	0.0035
资产支持证券		-	-	-	-
合计		7,488,476,175.58	7,489,126,915.49	650,739.91	0.0035

注：偏离金额=影子定价-按实际利率计算的账面价值；偏离度=偏离金额/通过按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	4,200,228,679.14	-
合计	4,200,228,679.14	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 其他资产

注：无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	367,026.79
其中：交易所市场	-
银行间市场	367,026.79
应付利息	-
预提费用	98,807.60
合计	465,834.39

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 国联现金增利货币A

金额单位：人民币元

项目 (国联现金增利货币A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	100,636,973.03	100,636,973.03
本期申购	222,970,226.71	222,970,226.71
本期赎回（以“-”号填列）	-242,371,152.32	-242,371,152.32
本期末	81,236,047.42	81,236,047.42

6.4.7.7.2 国联现金增利货币C

金额单位：人民币元

项目 (国联现金增利货币C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
-------------------	-------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,628,399,382.24	11,628,399,382.24
本期申购	32,246,721,939.15	32,246,721,939.15
本期赎回（以“-”号填列）	-25,569,575,837.44	-25,569,575,837.44
本期末	18,305,545,483.95	18,305,545,483.95

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 国联现金增利货币A

单位：人民币元

项目 (国联现金增利货币A)	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	852,962.91	-	852,962.91
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	-852,962.91	-	-852,962.91
本期末	-	-	-

6.4.7.8.2 国联现金增利货币C

单位：人民币元

项目 (国联现金增利货币C)	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	215,346,629.94	-	215,346,629.94
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	-215,346,629.94	-	-215,346,629.94
本期末	-	-	-

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
活期存款利息收入	45,441.40	
定期存款利息收入	81,620,259.20	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	-	
其他	-	
合计	81,665,700.60	

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：无。

6.4.7.11 基金投资收益

注：无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
债券投资收益——利息收入	86,379,954.17	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	302,163.05	
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	86,682,117.22	

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	17,570,169,275.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,506,286,027.44
减：应计利息总额	63,581,084.79
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	302,163.05

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

注：无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

注：无。

6.4.7.18 其他收入

注：无。

6.4.7.19 信用减值损失

注：无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他	520.00
合计	108,027.60

6.4.7.21 分部报告

无。

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

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
国联基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国联证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
上海融晟投资有限公司	基金管理人股东

国联（北京）资产管理有限公司	基金管理人子公司
----------------	----------

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 权证交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券交易

注：无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：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 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	15,456,906.51	22,607,136.61
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,402,183.22	509,345.17
应支付基金管理人的净管理费	14,054,723.29	22,097,791.44

注：①支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

②客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服

务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,152,302.21	7,535,712.19

注：①支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联现金增利货币A	国联现金增利货币C	合计
国联基金 管理有限 公司	31,940.48	707,079.37	739,019.85
中国邮政 储蓄银行 股份有限 公司	0.00	113,440.71	113,440.71
合计	31,940.48	820,520.08	852,460.56
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联现金增利货币A	国联现金增利货币C	合计
国联基金 管理有限	156,566.36	1,383,485.04	1,540,051.40

公司			
中国邮政 储蓄银行 股份有限 公司	0.00	4,670.79	4,670.79
合计	156,566.36	1,388,155.83	1,544,722.19

注：①本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.25%，对于由C类基金份额降级为A类基金份额的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后下一个工作日起适用A类基金份额的费率；

②C类基金份额的年销售服务费率为0.01%，对于由A类基金份额升级为C类基金份额的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受C类基金份额的费率；

③两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$H = E \times \text{年销售服务费率} / \text{当年天数}$

H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

注：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

国联现金增利货币C

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
基金合同生效日（2016年11月22日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	65,891,434.34	281,882,717.61
报告期间申购/买入总份额	258,923,850.56	164,995,778.30
报告期间因拆分变动份额	-	-

减：报告期间赎回/卖出总份额	259,700,000.00	213,500,000.00
报告期末持有的基金份额	65,115,284.90	233,378,495.91
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.36%	1.11%

注：（1）基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付；
（2）期间申购/买入总份额：含红利再投、转换入份额；期间赎回/卖出总份额：含转换出份额；
（3）对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

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

国联现金增利货币C

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国邮政储蓄银行股份有限公司	2,033,876,858.91	11.11%	1,015,867,522.97	8.74%
国联（北京）资产管理有限公司	44,230,360.65	0.24%	43,764,847.38	0.38%

注：1、除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。
2、本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末未持有本基金A类及E类基金份额。
3、对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	446,076.67	45,441.40	3,962,267.89	66,224.24

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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——固定净值型货币市场基金

国联现金增利货币A

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
852,962.91	-	-	852,962.91	-

国联现金增利货币C

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
215,346,629.94	-	-	215,346,629.94	-

6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：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

截至本报告期末2024年06月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额是508,690,503.97元，是以如下债券作为质押：

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
2102002	21国开绿债02	2024-07-01	100.47	1,000,000	100,470,000.00
210214	21国开14	2024-07-01	100.38	800,000	80,304,000.00
210406	21农发06	2024-07-01	102.69	1,800,000	184,842,000.00
2404108	24农发贴现08	2024-07-01	99.73	1,000,000	99,730,000.00
249928	24贴现国债28	2024-07-01	99.81	1,000,000	99,810,000.00
249934	24贴现国债34	2024-07-01	99.72	74,000	7,379,280.00
合计				5,674,000	572,535,280.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金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。

本基金的基金管理人实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节，构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系。本基金管理人的各个业务部门为第一道防线，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部为第二道防线，负责对公司业务的法律合规风险、投资管理风险和运作风险进行监控管理；公司经营管理层和公司内控及风险

管理委员会为第三道防线，负责对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；董事会下属的风险与合规委员会为第四道防线，负责审查公司对公司内外部风险识别、评估和分析等情况，及公司内部控制、风险管理政策、风险管理制度的执行情况等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的信用评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本报告期末及上年度末未持有除国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	164,954,650.92	40,103,032.17

合计	164,954,650.92	40,103,032.17
----	----------------	---------------

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中包含超短期融资券等，不包含国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	6,003,638,263.79	5,624,970,156.25
合计	6,003,638,263.79	5,624,970,156.25

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》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基金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，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金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，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、具有良好流动性的债券和货币市场工具，除在证券交易所的债券回购及返售交易，其余均在银行间同业市场交易，因此，除在6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），均能够及时变现。本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金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。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本计量的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年06 月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	452,608,160.23	3,515,048,512.67	3,243,639,528.55	-	-	-	7,211,296,201.45
交易性金	2,266,966,181.26	5,037,297,540.36	184,212,453.96	-	-	-	7,488,476,175.58

融资产							
买入返售金融资产	4,200,228,679.14	-	-	-	-	-	4,200,228,679.14
应收申购款	-	-	-	-	-	45,320.00	45,320.00
资产总计	6,919,803,020.63	8,552,346,053.03	3,427,851,982.51	-	-	45,320.00	18,900,046,376.17
负债							
卖出回购金融资产款	508,690,503.97	-	-	-	-	-	508,690,503.97
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,915,436.63	2,915,436.63
应付托管费	-	-	-	-	-	971,812.22	971,812.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-	210,495.79	210,495.79
应交税费	-	-	-	-	-	10,761.80	10,761.80
其他负债	-	-	-	-	-	465,834.39	465,834.39
负债总计	508,690,503.97	-	-	-	-	4,574,340.83	513,264,844.80
利率敏感度缺口	6,411,112,516.66	8,552,346,053.03	3,427,851,982.51	-	-	-4,529,020.83	18,386,781,531.37
上年度末2023年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	305,941,267.98	2,849,732,840.41	300,476,583.46	-	-	-	3,456,150,691.85
交易性金融资产	99,819,755.34	6,283,486,370.76	119,278,751.83	-	-	-	6,502,584,877.93
买入返售金融资产	3,055,899,071.91	200,485,770.35	-	-	-	-	3,256,384,842.26
应收申购款	-	-	-	-	-	30,306,800.00	30,306,800.00
资产总计	3,461,660,095.23	9,333,704,981.52	419,755,335.29	-	-	30,306,800.00	13,245,427,212.04
负债							
卖出回购金融资产款	1,513,264,673.29	-	-	-	-	-	1,513,264,673.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,901,430.95	1,901,430.95
应付托管费	-	-	-	-	-	633,810.31	633,810.31
应付销售服务费	-	-	-	-	-	148,414.92	148,414.92
其他负债	-	-	-	-	-	442,527.30	442,527.30
负债总计	1,513,264,673.29	-	-	-	-	3,126,183.48	1,516,390,856.77
利率敏感度缺口	1,948,395,421.94	9,333,704,981.52	419,755,335.29	-	-	27,180,616.52	11,729,036,355.27

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。本基金于本报告期末及上年度末，在“影子定价”机制有效的前提下，若市场利率上升或下降25个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值不会发生重大变动。

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金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。本基金主要投资于定期存款和银行间市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	7,488,476,175.58	6,502,584,877.93

第三层次	-	-
合计	7,488,476,175.58	6,502,584,877.93

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	7,488,476,175.58	39.62
	其中：债券	7,488,476,175.58	39.62
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,200,228,679.14	22.22
	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	7,211,296,201.45	38.15
4	其他各项资产	45,320.00	0.00
5	合计	18,900,046,376.17	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.17	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	508,690,503.97	2.77
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值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

注：本基金本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

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	69
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	71
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	23

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注：本基金本报告期内投资组合平均剩余期限无超过120天的情况。

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	37.08	2.77
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	17.49	-
	其中：剩余存续期超过397天	-	-

	的浮动利率债		
3	60天(含)–90天	29.58	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)–120天	4.42	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)–397天(含)	14.23	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	102.79	2.77

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

注：本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期无超过240天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	319,334,828.71	1.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,000,548,432.16	5.44
	其中：政策性金融债	1,000,548,432.16	5.44
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	164,954,650.92	0.90
6	中期票据	-	-
7	同业存单	6,003,638,263.79	32.65
8	其他	-	-
9	合计	7,488,476,175.58	40.73
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112420063	24广发银行CD063	7,000,000	697,899,974.86	3.80
2	190208	19国开08	3,300,000	341,271,101.40	1.86
3	112498581	24宁波银行CD039	3,000,000	299,299,697.85	1.63
4	112499354	24北京农商银行CD126	3,000,000	299,108,755.36	1.63
5	112492853	24武汉农商行CD015	3,000,000	298,964,172.83	1.63
6	112481129	24天津银行CD210	2,800,000	278,806,242.26	1.52
7	112493087	24昆仑银行CD011	2,700,000	269,201,777.14	1.46
8	112415235	24民生银行CD235	2,700,000	268,978,863.32	1.46
9	112480022	24九江银行CD081	2,500,000	249,120,545.78	1.35
10	112416109	24上海银行CD109	2,000,000	199,821,325.63	1.09

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	0.0503%
报告期内偏离度的最低值	0.0034%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0130%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注：本基金本报告期内无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

注：本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到0.50%的情况。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金所持有的债券采用摊余成本法进行估值，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价或折价，在其剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

7.9.2 报告期内基金投资的前十名证券除广发银行股份有限公司,宁波银行股份有限公司,北京农村商业银行股份有限公司,武汉农村商业银行股份有限公司,天津银行股份有限公司,中国民生银行股份有限公司,九江银行股份有限公司,上海银行股份有限公司外其他证券的发行主体本期未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。国家金融监督管理总局2023年08月03日发布对广发银行股份有限公司的处罚(金罚决字[2023]5号),国家外汇管理局宁波市分局2023年09月08日发布对宁波银行股份有限公司的处罚(甬外管罚[2023]8号),国家金融监督管理总局宁波监管局2023年11月27日发布对宁波银行股份有限公司的处罚(甬金罚决字[2023]24号),国家金融监督管理总局宁波监管局2023年11月27日发布对宁波银行股份有限公司的处罚(甬金罚决字[2023]26号),国家金融监督管理总局宁波监管局2024年06月14日发布对宁波银行股份有限公司的处罚(甬金罚决字[2024]56号),国家金融监督管理总局北京监管局2023年09月21日发布对北京农村商业银行股份有限公司的处罚(京金罚决字[2023]12号),国家金融监督管理总局湖北监管局2024年06月04日发布对武汉农村商业银行股份有限公司的处罚(鄂金监罚决字[2024]55号),央行天津市分行2023年12月05日发布对天津银行股份有限公司的处罚(津银罚决字[2023]8号),国家金融监督管理总局2023年08月02日发布对中国民生银行股份有限公司的处罚(金罚决字[2023]7号),中国银行间市场交易商协会2023年08月16日发布对中国民生银行股份有限公司的处罚,国家金融监督管理总局九江监管分局2024年03月15日发布对九江银行股份有限公司的处罚(浔金监罚决字[2024]17号),国家金融监督管理总局上海监管局2023年11月15日发布对上海银行股份有限公司的处罚(沪金罚决字[2023]52号),国家金融监督管理总局上海监管局2023年11月15日发布对上海银行股份有限公司的处罚(沪金罚决字[2023]51号),国家外汇管理局上海市分局2023年11月27日发布对上海银行股份有限公司的处罚(上海汇管罚字[2023]3111220301号),国家金融监督管理总局上海监管局2023年12月28日发布对上海银行股份有限公司的处罚(沪金罚决

字[2023]81号),国家金融监督管理总局上海监管局2024年05月30日发布对上海银行股份有限公司的处罚(沪金罚决字[2024]43号)。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作,上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	45,320.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	45,320.00

§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

份额级别	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
国联现金增利货币A	37,955	2,140.33	17,323,433.90	21.32%	63,912,613.52	78.68%
国联现金增利	78	234,686,480.56	18,298,429,894.42	99.96%	7,115,589.53	0.04%

货币C						
合计	38,033	483,442.84	18,315,753,328.32	99.61%	71,028,203.05	0.39%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	银行类机构	3,424,611,205.09	18.63%
2	银行类机构	2,033,876,858.91	11.06%
3	银行类机构	1,421,799,776.90	7.73%
4	券商类机构	602,417,958.07	3.28%
5	银行类机构	512,590,644.34	2.79%
6	银行类机构	503,760,625.04	2.74%
7	券商类机构	502,725,513.48	2.73%
8	银行类机构	501,397,422.93	2.73%
9	券商类机构	501,397,422.93	2.73%
10	银行类机构	431,791,599.19	2.35%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	国联现金增利货币A	214,989.82	0.26%
	国联现金增利货币C	-	-
	合计	214,989.82	0.00%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国联现金增利货币A	0~10
	国联现金增利货币C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国联现金增利货币A	-
	国联现金增利货币C	-
	合计	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	国联现金增利货币A	国联现金增利货币C
基金合同生效日(2016年11月22日)基金份额总额	148,794.25	2,000,233,333.33
本报告期期初基金份额总额	100,636,973.03	11,628,399,382.24
本报告期基金总申购份额	222,970,226.71	32,246,721,939.15
减：本报告期基金总赎回份额	242,371,152.32	25,569,575,837.44
本报告期期末基金份额总额	81,236,047.42	18,305,545,483.95

注：总申购份额含分级调整、转换入、红利再投的基金份额，本期总赎回份额含分级调整、转换出的基金份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

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) 基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于2024年4月10日发布公告，国联基金管理有限公司副总裁曹健先生转任公司督察长、公司督察长周妹云女士转任公司副总裁、刘鲁旦先生担任公司副总裁、马荣荣女士担任公司副总裁。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未变更为其提供审计服务的会计师事务所。

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

注：本报告期内管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
渤海证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
广发	2	-	-	-	-	-

证券						
银河证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

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

注：本基金本报告期租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

注：本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国联基金管理有限公司关于办公地址名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-01-12
2	国联基金管理有限公司高级	中国证监会指定报刊及网站	2024-04-10

	管理人员变更公告		
3	国联基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-04-10

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240101-20240131	3,388,568,048.38	36,043,156.71	0.00	3,424,611,205.09	18.63%
产品特有风险							
<p>本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。</p> <p>当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予中融现金增利货币市场基金注册的文件
- (2) 《国联现金增利货币市场基金基金合同》
- (3) 《国联现金增利货币市场基金托管协议》
- (4) 关于申请募集注册中融现金增利货币市场基金之法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (7) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：国联基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000, (010) 56517299。

网址：<http://www.glfund.com/>

国联基金管理有限公司
二〇二四年八月三十日