

# 华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:华安证券股份有限公司

基金托管人:中国证券登记结算有限责任公司

送出日期:2024 年 08 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本基金合同规定，于2024年08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。

本中期报告摘要摘自中期报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读中期报告正文。

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 .....	5
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 .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
§4 管理人报告 .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.7 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	11
§5 托管人报告 .....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	12
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	14
6.3 净资产变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	17
§7 投资组合报告 .....	47
7.1 期末基金资产组合情况 .....	47
7.2 债券回购融资情况 .....	48
7.3 基金投资组合平均剩余期限 .....	48
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 .....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	49
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 .....	50
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 .....	50
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 .....	51
7.9 投资组合报告附注 .....	51
§8 基金份额持有人信息 .....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
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 .....	53

§9 开放式基金份额变动 .....	53
§10 重大事件揭示 .....	53
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	54
10.9 其他重大事件 .....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
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 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
§12 备查文件目录 .....	56
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	57

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划
基金简称	华安证券月月红现金
基金主代码	970173
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年06月27日
基金管理人	华安证券股份有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司
报告期末基金份额总额	2,284,776,626.56份
基金合同存续期	不定期

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	在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	本集合计划投资策略主要有持有到期策略、利率预期策略、收益率曲线策略、信用债投资策略、类属替换策略、个券优选策略等。
业绩比较基准	活期存款利率（税后）
风险收益特征	本集合计划为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种，其预期风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

### 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		华安证券股份有限公司	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露	姓名	徐玉红	陈晨

露负责人	联系电话	0551-65161962	010-50938723
	电子邮箱	402072670@qq.com	zctg@chinaclear.com.cn
客户服务电话		95318	4008-058-058
传真		0551-65161859	-
注册地址		安徽省合肥市滨湖新区紫云路1018号	北京市西城区太平桥大街17号
办公地址		安徽省合肥市滨湖新区紫云路1018号	北京市西城区锦什坊街26号
邮政编码		230081	100033
法定代表人		章宏韬	于文强

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hazq.com">http://www.hazq.com</a>
基金中期报告备置地点	安徽省合肥市政务区天鹅湖路198号

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期
	(2024年01月01日- 2024年06月30日)
本期已实现收益	12,920,453.33
本期利润	12,920,453.33

本期净值收益率	0.5583%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2024年06月30日)
期末基金资产净值	2,284,776,626.56
期末基金份额净值	1.0000
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2024年06月30日)
累计净值收益率	2.2142%

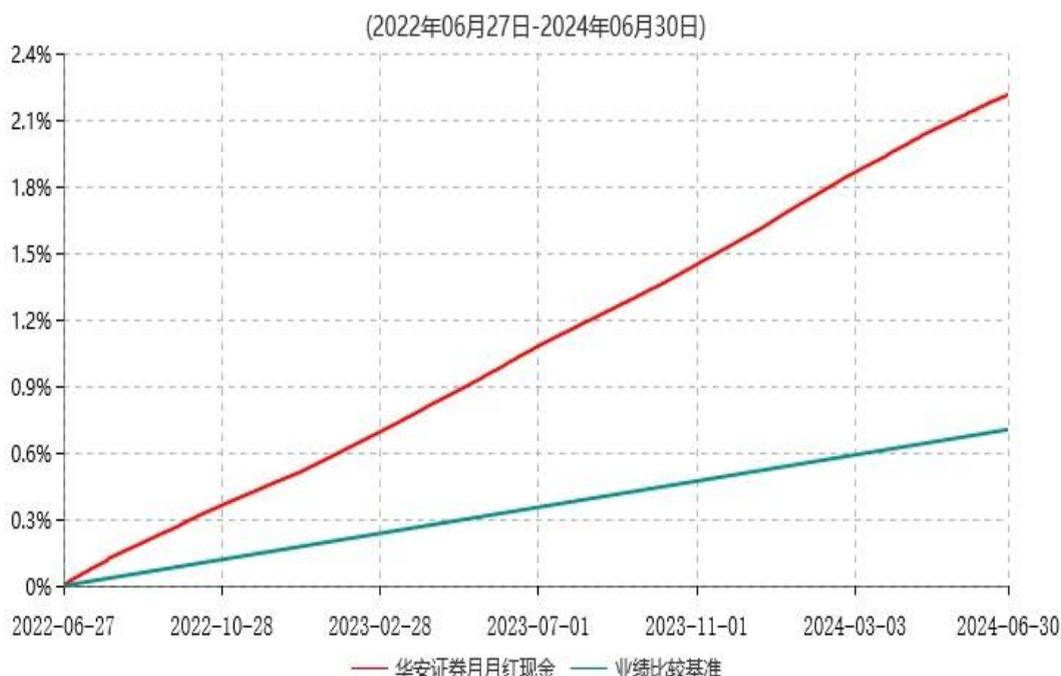
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去一个月	0.0791%	0.0007%	0.0286%	0.0000%	0.0505%	0.0007%
过去三个月	0.2573%	0.0007%	0.0867%	0.0000%	0.1706%	0.0007%
过去六个月	0.5583%	0.0006%	0.1736%	0.0000%	0.3847%	0.0006%
过去一年	1.1249%	0.0005%	0.3497%	0.0000%	0.7752%	0.0005%
自基金合同 生效起至今	2.2142%	0.0005%	0.7038%	0.0000%	1.5104%	0.0005%

#### 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

华安证券月月红现金管理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



## §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

基金管理人前身是1991年成立的安徽省证券公司，安徽省第一家专营证券机构。2001年，在整合原安徽省证券公司、安徽证券交易中心的证券类资产的基础上，成立了华安证券有限责任公司，是安徽省最早设立的综合类证券公司。此后，公司又经历了综合治理和多次增资扩股，2012年整体变更为股份制公司。2016年12月6日，公司首次公开发行股票在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：600909）。公司始终坚持稳健规范的经营风格，深化“合规风控至上”的理念，建立以合规管理和动态风险监控体系为核心的风险控制体系，完善董事会、经营层、风控线及业务单元的四级风险管理架构，努力推进风险管理转型，持续加强合规风控队伍建设、机制建设和文化建设，整体运行平稳。

华安证券根据《证券公司大集合资产管理业务适用《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》操作指引》的要求，截至2022年6月27日，旗下已有9只大集合产品完成公募化改造。

#### 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	证券	说明
----	----	--------	----	----

		金经理（助理） 期限		从业 年限	
		任职 日期	离任 日期		
樊艳	基金经理	2022-06-27	-	20年	樊艳，1999年加入华安证券，曾任证券投资部研究员、投资经理，现任资产管理总部投资经理，担任华安证券汇赢增利一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划、华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划、华安证券合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划、华安证券合赢三个月持有期债券型集合资产管理计划、华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划投资经理。
张钰	基金经理	2022-06-27	-	8年	张钰，2016年加入华安证券，曾任资产管理总部交易员、投资助理，现任资产管理总部投资经理，担任华安证券合赢九个月持有期债券型集合资产管理计划、华安证券合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划、华安证券合赢三个月定期开放债券型集合资产管理计划、华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华安证券股份有限公司公募资产管理业务公平交易制度》的规定。

##### 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。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，产品运作总原则是根据产品规模变动对产品资产结构、组合久期进行动态调整，在确保平稳运行的基础上实现收益最大化。

宏观市场方面，一季度生产端数据好于前值，显示宏观经济在好转趋势中。但经济也有堵点，地产销售、投资低位均未有显著改变；消费两年复合增速只是温和回升，耐用消费品支撑不够。从金融数据来看2月信贷社融均“冲高回落”，M1增速也大幅回落。4月底政治局会议保持积极的政策基调，对房地产的政策倾向由“供给端”彻底转向“供给端+需求端”，为了实现全年经济增速目标5%，政策端始终偏积极。5月份,PMI数据承压，上游工业品价格整体呈上行趋势，但涨幅相对有限，下游除了猪肉以外的商品价格仍有大幅上行的压力。内需中房地产投资增速连续多月处于低位，经济基本面仍受到地产链条的负面影响较大。整体来看，二季度GDP实际增速或弱于一季度。

债券市场方面，央行一月降准幅度扩大至0.5个百分点，向市场提供长期流动性大约一万亿，二月5年期LPR超预期下调25bp，助力“稳地产”，促进实体降成本。4月份以来多数时间央行缩量平价开展逆回购，资金面整体较为平稳，并连续提示超长端收益率风险。银行存款利率持续下调，“手工补息”被禁，存款搬家下资金大幅流入理财产品，资金流动性分层现象消失，机构配置需求旺盛。宽货币预期下，无风险利率震荡下行，二季度末30年国债收益率下行至2.42%，10年国债收益率下行至2.23%，1年期存单利率下行至1.95%。

具体投资上，产品首先保证存单、1年内利率债、信用债等标的的基本仓位以确保产品基础收益。同时，产品根据各类资金、债券资产轮动趋势进行择时配置。具体来讲，年初利率债、信用债收益率处于相对高位，产品适时拉长久期进行信用债、利率债的配置。在保证基本配置的基础上，产品采用骑乘策略兑现收益，并进行久期的动态调控。总体来看，报告期内产品根据市场资产价格波动趋势，组合及时调整了资产结构及组合久期，在保证流动性的基础上尽量提高了产品收益率。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末华安证券月月红现金基金份额净值为1.0000元，本报告期内，基金份额净值收益率为0.5583%，同期业绩比较基准收益率为0.1736%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在二季度GDP增速不及预期的情况下，下半年政策发力以保证年度GDP目标较为关键。货币政策方面，下半年仍将会相对宽松，经济复苏前期，需要宽货币先行。

在货币保持相对宽松，财政政策大概率积极发力的情况下，经济内生动能延续弱修复，对冲逆周期和化解存量债务都需要稳定偏松的货币金融环境，利率走势或将维持趋势性下行的特征，债市仍处于牛市环境。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及集合计划合同约定，本集合计划管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了集合计划估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本集合计划托管人审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查集合计划资产净值和集合计划份额申购、赎回价格。会计师事务所对估值调整导致集合计划资产净值的变化在 0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了监督和复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	194,659,254.26	255,589,832.76
结算备付金		307,863.49	1,164,325.38
存出保证金		37,828.24	108,549.65
交易性金融资产	6.4.7.2	1,503,116,486.63	1,671,502,552.67
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,503,116,486.63	1,671,502,552.67
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	529,617,144.44	-4,721.93
应收清算款		60,070,213.18	40,019,287.69
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,287,808,790.24	1,968,379,826.22
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2024年06月30日</b>	<b>2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	100,012,241.27
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,854,659.65	1,658,052.83
应付托管费		103,036.69	92,114.06
应付销售服务费		515,183.26	460,570.19
应付投资顾问费		-	-
应交税费		71,006.79	66,540.25
应付利润		258,516.16	214,889.87
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	229,761.13	267,133.85
负债合计		3,032,163.68	102,771,542.32
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	2,284,776,626.56	1,865,608,283.90
未分配利润	6.4.7.10	-	-
净资产合计		2,284,776,626.56	1,865,608,283.90

负债和净资产总计		2,287,808,790.24	1,968,379,826.22
----------	--	------------------	------------------

## 6.2 利润表

会计主体：华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		27,198,900.52	31,751,127.60
1.利息收入		7,474,506.06	5,147,667.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,841,364.06	3,531,178.39
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		633,142.00	1,616,489.28
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		19,724,394.46	26,603,459.93
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	19,724,394.46	26,603,459.93
资产支持证券投资 收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-	-
股利收益	6.4.7.18	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”		-	-

号填列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列)	6.4.7.19	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		14,278,447.19	16,819,531.23
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	10,446,503.26	12,083,133.33
2.托管费	6.4.10.2.2	580,361.29	671,285.32
3.销售服务费	6.4.10.2.3	2,901,806.42	3,356,425.95
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		185,648.56	518,705.90
其中：卖出回购金融资产支出		185,648.56	518,705.90
6.信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7.税金及附加		41,512.15	27,801.86
8.其他费用	6.4.7.21	122,615.51	162,178.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)</b>		12,920,453.33	14,931,596.37
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列)</b>		12,920,453.33	14,931,596.37
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		12,920,453.33	14,931,596.37

### 6.3 净资产变动表

会计主体：华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,865,608,283.90	-	1,865,608,283.90

二、本期期初净资产	1,865,608,283.90	-	1,865,608,283.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	419,168,342.66	-	419,168,342.66
（一）、综合收益总额	-	12,920,453.33	12,920,453.33
（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）	419,168,342.66	-	419,168,342.66
其中：1.基金申购款	30,202,607,865.57	-	30,202,607,865.57
2.基金赎回款	-29,783,439,522.91	-	-29,783,439,522.91
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-12,920,453.33	-12,920,453.33
四、本期期末净资产	2,284,776,626.56	-	2,284,776,626.56
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	2,226,769,168.75	-	2,226,769,168.75
二、本期期初净资产	2,226,769,168.75	-	2,226,769,168.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	36,248,725.95	-	36,248,725.95
（一）、综合收益	-	14,931,596.37	14,931,596.37

总额			
(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)	36,248,725.95	-	36,248,725.95
其中: 1.基金申购款	33,239,316,525.05	-	33,239,316,525.05
2.基金赎回款	-33,203,067,799.10	-	-33,203,067,799.10
(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)	-	-14,931,596.37	-14,931,596.37
四、本期期末净资产	2,263,017,894.70	-	2,263,017,894.70

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:

章宏韬

龚胜昔

许琼

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

华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划由华安理财现金管理月月红集合资产管理计划(以下简称“原集合计划”)变更而来。原集合计划为限定性集合资产管理计划,于2013年3月14日取得中国证监会《关于华安证券股份有限公司设立华安理财现金管理月月红集合资产管理计划的备案确认函》(中证协函[2013]201号),自2012年12月18日起开始推广并于2013年2月1日推广结束,于2013年2月4日成立。

根据中国证监会发布的《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》的规定,原集合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,本集合计划参照《基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更,并将集合计划名称变更为“华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划”,变更后的集合计划合同自2022年06月27日起生效,由华

安证券股份有限公司作为计划管理人，中国证券登记结算有限责任公司作为计划托管人的契约型开放式集合资产管理计划。

本集合计划合同生效后，连续20个工作日出现集合计划份额持有人数量不满200人或者集合计划资产净值低于人民币5000万元的，集合计划管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，集合计划管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他集合计划合并或者终止集合计划合同等，并在6个月内召开集合计划份额持有人大会进行表决。

本集合计划自本合同变更生效日起存续期不得超过3年。本集合计划自资产管理合同变更生效日起3年后，按照中国证监会有关规定执行。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

本集合计划的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由集合计划管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。集合计划管理人可根据情况变更或增减销售机构。集合计划投资者应当在销售机构办理集合计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理集合计划份额的申购与赎回。若集合计划管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资者可以通过上述方式进行申购与赎回。

本集合计划的投资范围包括现金、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，及中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

产品投资于前款所述企业债、公司债、短期融资券、中期票据等，其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。同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。

因市场波动、产品规模变动、债券信用评级调整等管理人之外的因素，致使产品投资不符合相关法律法规规定或产品合同约定的，管理人应当在10个交易日内进行调整，中国证监会另有规定的除外。

如法律法规或监管机构以后允许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。

本集合计划的业绩比较基准为：活期存款利率（税后）。

本集合计划定位为现金管理工具，注重集合计划资产的流动性和安全性，因此采用活期存款利率（税后）作为业绩比较基准。活期存款利率由中国人民银行公布，如果活期存款利率或利息税发生调整，则新的业绩比较基准将从调整当日起开始生效。如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本集合计划的业绩基准的指数时，本集合计划可以在与集合计划托管人协商一致的情况下，报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，

无需召开集合计划份额持有人大会。如果本集合计划业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时，集合计划管理人可以按相关监管部门要求履行相关程序后，依据维护集合计划份额持有人合法权益的原则，选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数，而无需召开集合计划份额持有人大会。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的会计报表按照财政部2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《中国证监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2号-年度报告的内容与格式》、《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》、《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》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

本财务报表以本集合计划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

本集合计划编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本集合计划2024年06月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024年06月30日的经营成果和集合计划净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本集合计划的会计年度为公历1月1日至12月31日止。本财务报表的实际编制期间自2024年01月01日至2024年06月30日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本集合计划核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1. 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本集合计划管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金

流量特征。本集合计划现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本集合计划目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、同业存单、资产支持证券和衍生工具等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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本集合计划管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## 2.金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划目前暂无金融负债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。本集合计划持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

原金融工具准则（截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则）

本集合计划于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本集合计划以前年度的如下会计政策。

### （1）金融资产的分类

金融资产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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本集合计划对金融资产的持有意图和持有能力。本集合计划现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

集合计划目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、同业存单和衍生工具等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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

集合计划持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

### （2）金融负债的分类

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及其他金融负债。本集合计划目前暂无金融负债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。集合计划持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。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，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划计价持有的股票投资、债券投资、资产支持证券、同业存单和衍生工具(主要为权证投资)等按如下原则确定公允价值并进行估值：

1.对于存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应该将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，计划管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2.对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可使用不可观察输入值。

3.如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

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，计划管理人可根据具体情况与计划托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

同时满足下列条件的，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；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。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。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的计划份额总额在扣除损益平准金分摊部分后所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于本计划申购确认日及本计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括本计划转换所引起的转入本计划的实收基金增加和转出本计划的实收基金减少。

每份计划份额面值为1.00元。实收基金为对外发行的计划份额总额。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在集合计划份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

收入是本集合计划在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本集合计划、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时，予以确认。

债券投资收益于卖出交易日按卖出成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

基金红利收入按基金公司宣告的分红比例计算的金额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异,按实际利率计算利息收入。

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算本集合计划持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按本集合计划合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本集合计划投资交易时发生的交易费用于交易日确认并作为本集合计划费用计入当年损益。

本集合计划的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认。

本集合计划的其他费用如不影响估值日本集合计划份额净值小数点后第四位,发生时直接计入本集合计划损益;如果影响本集合计划份额净值小数点后第四位的,应采用待摊或预提的方法,待摊或预提计入本集合计划损益。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一计划份额享有同等的分配权;当年收益先弥补上一年度亏损后,方可进行当年收益分配;如果投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;分配收益后每份额净值不能低于发行面值;分红后集合计划总份额不得超过最高规模限制;在符合上述分红条件的前提下,本集合计划每年收益分配次数最多为12次,每份集合计划份额每次集合计划收益分配比例不得低于集合计划收益分配基准日每份集合计划份额可供分配利润的10%,若本集合计划合同生效不满3个月可不进行收益分配。

分配方案由管理人拟定,包括集合计划收益的范围、集合计划净收益、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容,由托管人核实后确定,通过管理人网站和推广网点通告委托人。

本集合计划的收益分配包括现金分红和红利转份额两种方式。投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别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分配方式是现金分红。若投资者选择现金红利转换为相应类别集合计划份额进行再投资的，再投资份额以红利再投日为登记日，且需满足相应类别持有期的规定

#### **6.4.4.12 外币交易**

本报告期间本集合计划无需说明的外币交易。

#### **6.4.4.13 分部报告**

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本集合计划目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计**

本报告期间本集合计划无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本报告期间本集合计划无需要说明的重大会计政策变更。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本报告期间本集合计划无需要说明的重大会计估计变更。

#### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本报告期间本集合计划无需要说明的重大会计差错更正。

### **6.4.6 税项**

据财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2007]84号《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》、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》、2008年04月23日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008年09月18日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》、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《关于全面推开营业税改征增

值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1.基金运营过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税；

2.基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加；

3.对基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税；

4.存款利息收入不征收增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入免征增值税；

5.对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；

6.基金取得的股票股息、红利收入，自2015年9月8日起，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。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；上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

7.对基金取得的企业债券利息收入，应由各兑付机构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；

8.对于基金从事A股买卖，自2008年09月19日起，由出让方按0.1%的税率缴纳证券（股票）交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	194,659,254.26
等于：本金	194,442,800.69
加：应计利息	216,453.57
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

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	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	194,659,254.26

#### 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	154,247,303.98	154,340,841.11	93,537.13	0.0041
	银行间市场	1,348,869,182.6 5	1,349,886,228.7 1	1,017,046.06	0.0445
	合计	1,503,116,486.6 3	1,504,227,069.8 2	1,110,583.19	0.0486
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	1,503,116,486.6 3	1,504,227,069.8 2	1,110,583.19	0.0486

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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	150,001,500.00	-
银行间市场	379,615,644.44	-
合计	529,617,144.44	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**  
无。

**6.4.7.5 债权投资**

**6.4.7.5.1 债权投资情况**

本报告期末，本集合计划未持有债权投资。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

本报告期末，本集合计划未有按预期信用损失一般模型计提减值准备的情况。

**6.4.7.6 其他资产**

无。

**6.4.7.7 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	-
应付交易费用	35,708.15
其中：交易所市场	18,447.20
银行间市场	17,260.95
应付利息	-
预提费用	194,052.98
合计	229,761.13

**6.4.7.8 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,865,608,283.90	1,865,608,283.90
本期申购	30,202,607,865.57	30,202,607,865.57
本期赎回（以“-”号填列）	-29,783,439,522.91	-29,783,439,522.91
本期末	2,284,776,626.56	2,284,776,626.56

#### 6.4.7.9 其他综合收益

本报告期末，本集合计划无其他综合收益。

#### 6.4.7.10 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	12,920,453.33	-	12,920,453.33
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	-12,920,453.33	-	-12,920,453.33
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 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	6,834,499.14
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	6,864.92	

其他	-
合计	6,841,364.06

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本报告期间，本集合计划无股票投资收益--买卖股票差价收入。

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本报告期间，本集合计划无基金投资收益。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 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	19,136,663.30
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	587,731.16
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	19,724,394.46

##### 6.4.7.14.2 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	2,337,048,463.38
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,304,141,859.19
减：应计利息总额	32,318,848.03

减：交易费用	25.00
买卖债券差价收入	587,731.16

#### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.15 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.15.1 资产支持证券投资收益项目构成

本报告期间，本集合计划无资产支持证券投资收益。

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

本报告期间，本集合计划无资产支持证券投资收益--买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.15.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本报告期间，本集合计划无资产支持证券投资收益--赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本报告期间，本集合计划无资产支持证券投资收益--申购差价收入。

#### 6.4.7.16 贵金属投资收益

##### 6.4.7.16.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期间，本集合计划无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.16.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期间，本集合计划无贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入

##### 6.4.7.16.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期间，本集合计划无贵金属投资收益--赎回差价收入

##### 6.4.7.16.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期间，本集合计划无贵金属投资收益--申购差价收入

#### 6.4.7.17 衍生工具收益

##### 6.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期间，本集合计划无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期间，本集合计划无衍生工具收益--其他投资收益。

#### 6.4.7.18 股利收益

本报告期间，本集合计划无股利收益。

#### 6.4.7.19 其他收入

无。

#### 6.4.7.20 信用减值损失

本报告期间，本集合计划无信用减值损失。

#### 6.4.7.21 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	13,380.64
信息披露费	59,672.34
汇划手续费	30,862.53
帐户维护费	18,600.00
其他	100.00
合计	122,615.51

#### 6.4.7.22 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

本报告期末本集合计划不存在需要说明的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本集合计划报告报出日，本集合计划不存在需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

截止本集合计划报告报出日，本集合计划不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安证券股份有限公司	本集合计划的设立人和管理人
中国证券登记结算有限责任公司	本集合计划的托管人

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本报告期间，本集合计划未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本报告期间，本集合计划未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
华安证券 股份有限 公司	165,207,884.00	100.00%	678,629,009.00	100.00%

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
华安证券 股份有限 公司	971,000,000.00	100.00%	1,247,825,000.00	100.00%

**6.4.10.1.5 基金交易**

本报告期间，本集合计划未通过关联方交易单元进行基金交易。

**6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
华安证券 股份有限 公司	44,703.08	100.00%	18,447.20	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例

		例		
华安证券股份有限公司	156,627.67	100.00%	106,663.46	100.00%

#### 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	10,446,503.26	12,083,133.33
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	10,446,503.26	12,083,133.33

①本集合计划各类份额的管理费皆按前一日该类集合计划资产净值的0.9%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.9\% \div \text{当年天数}$$

H为各类份额每日应计提的集合计划管理费；E为该类份额前一日的集合计划资产净值。

②计提方式与支付方式：如果以0.90%的管理费计算的七日年化暂估收益率小于或等于2倍活期存款利率，集合计划管理人将调整管理费为0.25%，以降低每万份集合计划暂估净收益为负并引发交收透支的风险，直至该类风险消除，集合计划管理人方可恢复计提0.90%的管理费。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，由集合计划管理人向集合计划托管人发送集合计划管理费划款指令，集合计划托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给集合计划管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024	上年度可比期间 2023年01月01日至2023

	年06月30日	年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	580,361.29	671,285.32

①本集合计划各类份额的托管费皆按前一日该类集合计划资产净值的0.05%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为各类份额每日应计提的集合计划基金托管费；E为该类份额前一日的集合计划资产净值。

②计提方式与支付方式：集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由集合计划管理人向集合计划托管人发送集合计划托管费划款指令，集合计划托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年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	
华安证券股份有限公司	2,901,806.42	
合计	2,901,806.42	
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	
华安证券股份有限公司	3,356,425.95	
合计	3,356,425.95	

①本集合计划各类份额的销售服务费皆按前一日该类集合计划资产净值的0.25%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为各类份额每日应计提的集合计划销售服务费；E为该类份额前一日的集合计划资产净值。

②计提方式与支付方式：销售服务费每日计提，按月支付。由集合计划管理人向集合计划托管人发送销售服务费划付指令，经集合计划托管人复核后于次月首日起5个工作日内从集合计划财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

#### 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

本报告期间本集合计划未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 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
报告期初持有的基金份额	0.00	28,401,396.99
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	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

##### 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

本报告期末，除管理人之外的其他关联方未投资本集合计划。

##### 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
中国证券登记结算有限责任公司	11,405,963.04	132,998.91	7,188,691.72	279,247.85

公司				
----	--	--	--	--

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本报告期间本集合计划未在承销期内参与关联方承销的证券。

**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**

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
11,390,659.57	-	1,529,793.76	12,920,453.33	-

**6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券**

**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本报告期末本集合计划未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本报告期末本集合计划未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本报告期末本集合计划未持有银行间市场债券正回购。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本报告期末本集合计划未持有交易所市场债券正回购。

**6.4.13 金融工具风险及管理**

本集合计划为公募混合型集合资产管理计划。可能投资股票资产，具有对股票市场的系统性风险，不能完全规避市场下跌的风险，在市场大幅上涨时也不能保证集合计划净值能够完全跟随或超越市场上涨幅度。本集合计划投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资。

本集合计划在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划的基金管理人从事风险管理的主要目的是在力求基金资产安全性、流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定收益。

本集合计划的基金管理人对于金融工具的风险管理办法主要通过定性分析和定量分析的方法去评估各种风险发生的可能损失。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，根据本集合计划的投资目标，结合计划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。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

集合计划的管理人建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的集合计划财产和集合计划管理人的财产相互独立，对所管理的不同集合计划分别管理，分别记账，进行证券投资。

公司全面风险管理的组织体系由董事会、监事会、经理层、各部门、分支机构及子公司构成，各自履行全面风险管理的职责分工，建立多层次、相互衔接、有效制衡的运行机制。

公司董事会是风险管理的最高决策机构，对公司全面风险管理的有效性承担最终责任；审议批准公司全面风险管理的基本制度；根据公司发展战略，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额，以实现对公司风险的总量控制；审议公司定期风险评估报告，提出风险管理意见；建立与首席风险官的直接沟通机制。董事会下设风险控制委员会，负责提出公司经营管理过程中防范风险的指导意见；审阅公司风险管理制度及策略；定期对公司风险管理状况、政策和程序进行评价，确保其与公司的资本实力、管理水平相一致。

公司监事会对公司董事会和经理层在风险管理方面的履职尽责情况进行监督检查并督促整改。

公司经理层负责经营管理中的风险管理，负责组织制定风险管理制度；建立健全公司全面风险管理的经营管理架构，明确各部门在风险管理中的职责分工，并督促各部门的履职；组织制定风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等的具体执行方案，并确保其有效落实；组织评估公司整体风险和各类重要风险管理状况，并积极解决风险管理中存在的问题；组织建立涵盖风险管理有效性的全员绩效考核体系；组织推进风险管理方面信息技术系统和数据质量控制机制的建设。

公司风险管理部在首席风险官的领导下推动全面风险管理工作，履行具体的风险管理职责。稽核部负责协助审计和评价重大风险问题。计划财务部负责流动性风险管理工作。法律合规部负责合规风险和洗钱风险管理工作。办公室负责声誉风险管理工作。

公司各部门、分支机构及子公司对各自所对接的业务或所管理的领域履行相应的风险管理职能。各单位负责人为本单位风险管理工作的第一责任人，承担风险管理的直接责任。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

集合计划的银行存款存放在托管人和其他具有基金托管资格的股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。集合计划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。

本集合计划应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。集合计划持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。

本集合计划债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 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	465,953,203.90	303,236,031.64
合计	465,953,203.90	303,236,031.64

##### 6.4.13.2.2 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	483,249,659.88	593,950,407.95
合计	483,249,659.88	593,950,407.95

### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	277,731,470.35	627,259,436.19
AAA以下	-	-
未评级	276,182,152.50	147,056,676.89
合计	553,913,622.85	774,316,113.08

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因证券市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括集合计划出现巨额赎回，致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

在本集合计划出现巨额赎回情形下，集合计划管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本集合计划单个集合计划份额持有人在单个开放日申请赎回集合计划份额超过集合计划总份额一定比例以上的，集合计划管理人有权对其采取延期办理赎回申请的措施。

本集合计划的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的股票、债券和货币市场工具等，同时本集合计划基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本集合计划的流动性风险适中。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2024年06月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	合计
资产	-	-	-	-	
货币资金	194,659,254.26	-	-	-	194,659,254.26
结算备付金	307,863.49	-	-	-	307,863.49

存出保证金	37,828.24	-	-	-	37,828.24
交易性金融资产	1,106,587,474.54	396,529,012.09	-	-	1,503,116,486.63
买入返售金融资产	529,617,144.44	-	-	-	529,617,144.44
债权投资	-	-	-	-	-
资产总计	1,831,209,564.97	396,529,012.09	-	-	2,227,738,577.06
负债	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-
流动性净额	1,831,209,564.97	396,529,012.09	-	-	2,227,738,577.06
上年度末 2023年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	合计
资产	-	-	-	-	
货币资金	255,589,832.76	-	-	-	255,589,832.76
结算备付金	1,164,325.38	-	-	-	1,164,325.38
存出保证金	108,549.65	-	-	-	108,549.65
交易性金融资产	1,341,530,132.58	329,972,420.09	-	-	1,671,502,552.67
买入返售金融资产	-4,721.93	-	-	-	-4,721.93
债权投资	-	-	-	-	-
资产总计	1,598,388,118.44	329,972,420.09	-	-	1,928,360,538.53
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	100,012,241.27	-	-	-	100,012,241.27
负债总计	100,012,241.27	-	-	-	100,012,241.27

流动性净额	1,498,375,877.17	329,972,420.09	-	-	1,828,348,297.26
-------	------------------	----------------	---	---	------------------

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人在集合计划运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本集合计划的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划品种可以不受此条款规定的比例限制；本集合计划管理人管理的全部公募型集合计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划品种可以不受此条款规定的比例限制；本集合计划进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过集合计划资产净值的40%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；本集合计划持有的全部资产支持证券，其市值不得超过集合计划资产净值的20%。

本集合计划持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；本集合计划管理人管理的全部集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%。本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该集合计划资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、集合计划规模变动等集合计划管理人之外的因素致使集合计划不符合前款所规定比例限制的，集合计划管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

本集合计划所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过集合计划资产净值的15%。于2024年06月30日，本集合计划持有的流动性受限资产的估值占集合计划资产净值的比例未超过15%。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利

率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本集合计划投资交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年0 6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	194,659,254.26	-	-	-	-	194,659,254.26
结算备付金	307,863.49	-	-	-	-	307,863.49
存出保证金	37,828.24	-	-	-	-	37,828.24
交易性金融资产	1,106,587,474.54	396,529,012.09	-	-	-	1,503,116,486.63
买入返售金融资产	529,617,144.44	-	-	-	-	529,617,144.44
应收清算款	-	-	-	-	60,070,213.18	60,070,213.18
资产总计	1,831,209,564.97	396,529,012.09	-	-	60,070,213.18	2,287,808,790.24
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,854,659.65	1,854,659.65
应付托管费	-	-	-	-	103,036.69	103,036.69
应付销售服务费	-	-	-	-	515,183.26	515,183.26
应交税费	-	-	-	-	71,006.79	71,006.79
应付利润	-	-	-	-	258,516.16	258,516.16

其他负债	-	-	-	-	229,761.13	229,761.13
负债总计	-	-	-	-	3,032,163.68	3,032,163.68
利率敏感度缺口	1,831,209,564.97	396,529,012.09	-	-	57,038,049.50	2,284,776,626.56
上年度末 2023年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	255,589,832.76	-	-	-	-	255,589,832.76
结算备付金	1,164,325.38	-	-	-	-	1,164,325.38
存出保证金	108,549.65	-	-	-	-	108,549.65
交易性金融资产	1,341,530,132.58	329,972,420.09	-	-	-	1,671,502,552.67
买入返售金融资产	-4,721.93	-	-	-	-	-4,721.93
应收清算款	-	-	-	-	40,019,287.69	40,019,287.69
资产总计	1,598,388,118.44	329,972,420.09	-	-	40,019,287.69	1,968,379,826.22
负债						
卖出回购金融资产款	100,012,241.27	-	-	-	-	100,012,241.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,658,052.83	1,658,052.83
应付托管费	-	-	-	-	92,114.06	92,114.06
应付销售服务费	-	-	-	-	460,570.19	460,570.19
应交税费	-	-	-	-	66,540.25	66,540.25

应付利润	-	-	-	-	214,889.87	214,889.87
其他负债	-	-	-	-	267,133.85	267,133.85
负债总计	100,012,241.27	-	-	-	2,759,301.05	102,771,542.32
利率敏感度缺口	1,498,375,877.17	329,972,420.09	-	-	37,259,986.64	1,865,608,283.90

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.市场利率变化主要对基金组合债券类资产的估值产生影响,对其他会计科目的影响可忽略。		
假设	2.基金组合对利率的风险暴露,根据报告期末各只债券的修正久期加权计算得到,债券凸性对组合净值的影响可忽略。		
假设	3.市场即期利率曲线平行变动。		
假设	4.基金组合构成和其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率下降25个基点	95,817.50	13,340,747.07
	市场利率上升25个基点	-95,817.50	-13,340,747.07

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2024年06月30日		2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,503,116,486.63	65.79	1,671,502,552.67	89.60
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,503,116,486.63	65.79	1,671,502,552.67	89.60

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本集合计划未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

#### 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	1,503,116,486.63	1,671,502,552.67
第三层次	-	-
合计	1,503,116,486.63	1,671,502,552.67

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,503,116,486.63	65.70
	其中：债券	1,503,116,486.63	65.70
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	529,617,144.44	23.15
	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	194,967,117.75	8.52
4	其他各项资产	60,108,041.42	2.63
5	合计	2,287,808,790.24	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	0.73	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本产品在本报告期内未出现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	106
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	113
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	66

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内未出现投资组合平均剩余期限超过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	35.64	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

2	30天(含)—60天	7.00	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	10.94	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	5.70	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	40.09	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.37	-

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	154,247,303.98	6.75
5	企业短期融资券	465,953,203.90	20.39
6	中期票据	399,666,318.87	17.49
7	同业存单	483,249,659.88	21.15
8	其他	-	-
9	合计	1,503,116,486.63	65.79
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	042380750	23萧山国资CP003	500,000	50,919,844.17	2.23
2	012384518	23武汉城建SCP010	500,000	50,819,663.95	2.22
3	112410104	24兴业银行CD104	500,000	49,203,058.54	2.15
4	112408171	24中信银行CD171	500,000	49,076,443.33	2.15
5	112403140	24农业银行CD140	500,000	49,059,552.17	2.15
6	112408187	24中信银行CD187	500,000	49,031,317.18	2.15
7	112408194	24中信银行CD194	500,000	49,030,239.23	2.15
8	185176	21天风05	400,000	41,282,621.77	1.81
9	188749	21兴杭01	400,000	41,101,939.56	1.80
10	102103248	21淮安国投MTN003	400,000	41,093,888.98	1.80

**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	0.0838%
报告期内偏离度的最低值	0.0065%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0386%

**报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明**

本报告期内未出现产品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

本报告期内未出现产品负偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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

本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

本基金计划采用摊余成本法估值，并采用计算暂估收益率的方法每日进行估值，并按照下列方法确认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；

(3) 债券以买入成本列示，按票面利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日预提收益。

7.9.2 本报告期内，基金投资前十名的发行主体中，兴业银行受到黑龙江银保监局行政处罚、受到福建证监局关于基金销售业务违规采取责令改正的措施。中信银行受到银保监局的处罚。农业银行受到青岛银保监局的罚单处罚。

#### 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	37,828.24
2	应收清算款	60,070,213.18
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	60,108,041.42

### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
34,210	66,786.81	33,243,374.55	1.45%	2,251,533,252.01	98.55%

### 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	个人	32,076,893.34	1.40%
2	个人	23,048,518.86	1.01%
3	机构	20,311,931.80	0.89%
4	个人	17,475,315.56	0.76%
5	个人	15,489,043.54	0.68%
6	个人	15,006,354.60	0.66%
7	个人	12,360,368.14	0.54%
8	个人	11,312,087.69	0.50%
9	个人	10,675,309.69	0.47%
10	个人	8,397,065.16	0.37%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日(2022年06月27日)基金份额总额	2,164,134,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,865,608,283.90
本报告期基金总申购份额	30,202,607,865.57
减：本报告期基金总赎回份额	29,783,439,522.91
本报告期期末基金份额总额	2,284,776,626.56

**§10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内未召开份额持有人大会。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

本报告期内，本基金管理人、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**

本报告期内，无涉及基金管理业务、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**

本基金本报告期投资策略未发生改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本基金本报告期未改聘会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况****10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，基金管理人其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华安证券	2	-	-	44,703.08	100.00%	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华安证券	165,207,884.00	100.00%	971,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

## 10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期没有发生偏离度绝对值超过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	华安证券股份有限公司关于公司住所变更公告	规定媒介	2024-01-19
2	华安证券月月红现金管理型	规定媒介	2024-01-22

	集合资产管理计划2023年第四季度报告		
3	华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划收益支付公告（2024年第01号）	规定媒介	2024-01-30
4	华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划收益支付公告（2024年第02号）	规定媒介	2024-02-28
5	华安证券股份有限公司关于增加奕丰基金销售有限公司为旗下集合资产管理计划代销机构的公告	规定媒介	2024-03-05
6	华安证券股份有限公司关于增加宜信普泽（北京）基金销售有限公司为旗下集合资产管理计划代销机构的公告	规定媒介	2024-03-22
7	华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划收益支付公告（2024年第03号）	规定媒介	2024-03-28
8	华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划2023年年度报告	规定媒介	2024-03-29
9	华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划2024年第一季度报告	规定媒介	2024-04-22
10	华安证券股份有限公司关于增加上海大智慧基金销售有限公司为华安证券旗下集合资产管理计划销售机构的公告	规定媒介	2024-04-26
11	华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划收益支付公告（2024年第04号）	规定媒介	2024-04-29

12	华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划收益支付公告（2024年第05号）	规定媒介	2024-05-30
13	华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划收益支付公告（2024年第06号）	规定媒介	2024-06-27
14	华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划招募说明书更新	规定媒介	2024-06-29
15	华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划基金产品资料概要更新	规定媒介	2024-06-29

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件；
- 2、华安证券华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、华安证券华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划托管协议；
- 4、华安证券华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划招募说明书及其更新；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

安徽省合肥市政务区天鹅湖路198号。

### 12.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95318

公司网址：<http://www.hazq.com/>

华安证券股份有限公司  
二〇二四年八月三十一日