国信现金增利货币型集合资产管理计划

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:国信证券股份有限公司

基金托管人:中国证券登记结算有限责任公司

送出日期:2022 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会、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。

集合计划托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本集合计划合同规定，于2022年08月04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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

自2022年04月25日起，国信现金增利1号集合资产管理计划转型为国信现金增利货币型集合资产管理计划，《国信现金增利1号集合资产管理计划资产管理合同》失效，《国信现金增利货币型集合资产管理计划资产管理合同》同日起生效。

本报告期自2022年04月25日（集合计划合同生效日）起至2022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 9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 11
§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 11
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 12
§6 中期财务会计报告(未经审计) 12
6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 14
6.3 净资产（基金净值）变动表 15
6.4 报表附注 16
§7 投资组合报告 43
7.1 期末基金资产组合情况 43
7.2 债券回购融资情况 43
7.3 基金投资组合平均剩余期限 44
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 45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 45
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 45
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 46
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 46
7.9 投资组合报告附注 46
§8 基金份额持有人信息 47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 47
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 48
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 48
§9 开放式基金份额变动 48

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

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国信现金增利货币型集合资产管理计划
基金简称	国信现金增利
基金主代码	931204
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年04月25日
基金管理人	国信证券股份有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司
报告期末基金份额总额	13,995,520,508.98份
基金合同存续期	本集合计划自本合同变更生效日起存续期不得超过三年。本集合计划自集合计划合同生效日起三年后，按照中国证监会有关规定执行。

注：本报告中所述的“基金”包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

2.2 基金产品说明

投资目标	在力求资产安全性、流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本集合计划主要投资策略包括资产配置策略、个券选择策略、久期管理策略、流动性管理策略、套利策略、滚动配置策略。未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，本集合计划还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富集合计划投资策略。
业绩比较基准	本集合计划的业绩比较基准为：人民币活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本集合计划的类型为货币型集合资产管理计划，预期收益和预期风险低于债券型基金、债券型集合资产管理计划、股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金、混合型集合资产管理计划。

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		国信证券股份有限公司	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露负责人	姓名	成飞	陈晨
	联系电话	0755-81982985	010-50938723
	电子邮箱	08329@guosen.com.cn	zctg@chinaclear.com.cn
客户服务电话		95536	4008-058-058
传真		0755-82130672	-
注册地址		深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层	北京市西城区太平桥大街17号
办公地址		深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦	北京市西城区锦什坊街26号
邮政编码		518001	100033
法定代表人		张纳沙	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	www.guosen.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人办公地址

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	北京市西城区锦什坊街26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 （2022年04月25日（基金合同生效日）- 2022年06月30日）
本期已实现收益	31,961,912.81
本期利润	31,961,912.81
本期净值收益率	0.2593%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末 （2022年06月30日）
期末基金资产净值	13,995,520,508.98
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末 （2022年06月30日）
累计净值收益率	0.2593%

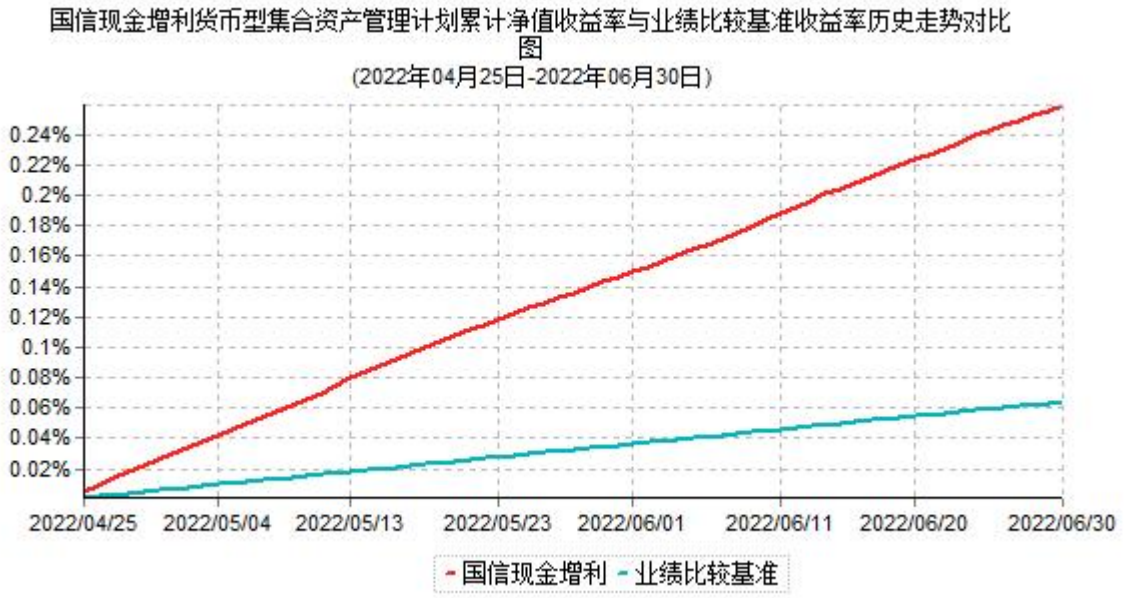
注：1、本集合计划变更后合同生效日为2022年04月25日，集合计划合同生效日至本报告期末，本集合计划运作时间未满半年；
2、本集合计划无持有人认购或交易基金的各项费用；
3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于本集合计划采用实际利率计算账面价值核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；
4、本集合计划收益分配按月结转，收益支付方式为红利再投资（即红利转集合计划份额）。

3.2 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	0.1130%	0.0005%	0.0288%	0.0000%	0.0842%	0.0005%
自基金合同生效起至今	0.2593%	0.0005%	0.0643%	0.0000%	0.1950%	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



注：1、本集合计划合同于2022年04月25日生效，截至本报告期末本集合计划成立未满一年；

2、按集合计划合同和招募说明书的约定，本集合计划建仓期为合同生效后6个月，报告期末已完成建仓，各项资产配置比例符合合同有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金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

国信证券股份有限公司正式成立于1994年6月30日，于2014年12月29日在深交所上市。截至2022年06月30日，公司注册资本为961,242.9377万元。

截至2022年06月30日，本集合计划管理人共管理了2只参照开放式证券投资基金管理的集合计划：国信价值智选混合型集合资产管理计划、国信现金增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		
梁策	基金经理	2022-04-25	-	11	梁策，中国国籍，管理学硕士，经济师，具有基金从业资格、证券从业资格，4年证券研究经验、6年证券投资经验。2011年加入国信证券资产管理总部，历任资产管理总部投资助理、投资经理，现任国信证券资产管理总部投资经理。

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

2、非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定；

4、本集合计划投资经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人建立完善的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，保证公平交易原则的实现，重视交易执行环节的公平交易措施，通过投资交易系统中的公平交易模块等方式，公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本报告期内，未发现本集合计划管理人所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 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

2022年上半年，债券市场长短端走势有所分化，在流动性宽松驱动下短端利率大幅下行，但长端利率受宽信用预期和海外货币政策收紧等因素保持震荡。1月为宽货币主导的行情，收益率下行。1月三大政策利率同步调降，此后央行明确要“把货币政策工具箱开得再大一些”、“政策靠前发力”，宽松货币基调确定。2至3月中旬为宽信用预期逐渐加深主导的行情，债市收益率出现明显回调。3月中旬以来，随着俄乌战争爆发、疫情在长三角、珠三角集中爆发及封控，对我国内外需带来明显冲击，宏观景气度急速下滑。6月起疫情改善、宽信用发力，疫后经济复产复工开启慢修复，市场关注疫情动向和政策应对，长端收益率在此阶段维持窄幅震荡。4月央行再度降准、加快万亿结存利润上缴、加大结构性货币政策实施力度、通过存款利率市场化调整机制降低综合融资成本，隔夜利率DR001处于1.3-1.4%的低位，流动性维持高水平充裕状态，在此推动下，短端利率大幅下行，1年期AAA存单较年初下行32BP。

操作方面，上半年本产品组合投资操作灵活积极，将组合剩余期限维持在合理区间，加大杠杆套利策略实施力度，同时主动把握短端资产利率的波动机会。组合配置方面，组合以银行存款、同业存单和高等级短期债券为主，通过资产比价策略选择性价比较高期限及品种。在管理现金流分布、保障组合充足流动性的同时，采取积极应对措施，调整组合结构，应对市场的变化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本集合计划份额净值收益率为0.2593%，同期业绩比较基准收益率为0.0643%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，随着疫情逐步得到控制、经济从底部爬坡，国内基本面恢复的节奏和货币信用的边际变化将成为影响债市的主要因素，金融周期基本见底，宏观条件上对于债券市场略显不利，但经济增长的动能又有待确认，需要货币政策维持偏松的宏观环境，配置资金充足，短端利率短期无忧，但随着经济企稳回升中期来看仍有逐步向中枢水平回归的可能，需要持续关注融资需求、就业等基本面企稳信号。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本集合计划管理人严格遵守企业会计准则、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集合计划合同约定，制定了相关估值管理制度，建立了估值委员会，估值委员会下设执行机构估值小组。估值小组负责估值方法决策，并审议估值方法年度评估报告、金融工具估值方法确认和调整的临时议案，以及特殊情况下个别金融工具估值结果调整的临时议案等。估值小组成员具有丰富的从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理或产品估值运作等方面的专业胜任能力。集合计划投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与自身担任投资经理的产品估值事项表决投票。

本集合计划托管人根据法律法规要求，审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，履行估值及净值计算的复核责任。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。相关定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及集合计划的资产管理合同等规定，本集合计划收益“每日计提、按月支付”，收益支付方式为红利再投资（即红利转集合计划份额）。本报告期内本集合计划应分配利润 31,961,912.81元，报告期内已分配利润31,961,912.81元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

1、本集合计划本报告期内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的情形；

2、本集合计划本报告期内未出现连续二十个工作日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，本托管人在对本集合计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的有关规定，不存在损害集合计划份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了集合计划托管人应尽的义务。

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、集合计划合同和托管协议的有关规定，对本集合计划的投资运作、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，未发现本集合计划管理人存在损害集合计划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 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国信现金增利货币型集合资产管理计划

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年06月30日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	7,226,956,381.38
结算备付金		1,491,710.65
存出保证金		176,290.90
交易性金融资产	6.4.7.2	6,781,736,594.53
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		6,781,736,594.53
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	-
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-

其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		14,010,360,977.46
负债和净资产	**附注号**	本期末 2022年06月30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		-
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		10,411,880.74
应付托管费		612,463.60
应付销售服务费		1,501,527.54
应付投资顾问费		-
应交税费		30,654.54
应付利润		2,072,793.63
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	211,148.43
负债合计		14,840,468.48
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	13,995,520,508.98
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	-

净资产合计		13,995,520,508.98
负债和净资产总计		14,010,360,977.46

注：1、报告截止日2022年06月30日，本集合计划份额净值1.0000元，集合计划份额总额13,995,520,508.98份；

2、本集合计划于2022年04月25日生效，上年度可比区间无比较数据，因此资产负债表只列示2022年06月30日数据。

6.2 利润表

会计主体：国信现金增利货币型集合资产管理计划

本报告期：2022年04月25日（基金合同生效日）至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022年04月25日（基金合同生效日）至2022年06月30日
一、营业总收入		62,889,463.26
1.利息收入		36,084,164.39
其中：存款利息收入	6.4.7.9	36,051,108.17
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		33,056.22
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		26,805,298.87
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	26,805,298.87
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	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-
减：二、营业总支出		30,927,550.45
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	19,274,111.13
2．托管费	6.4.10.2.2	1,133,771.28
3．销售服务费	6.4.10.2.3	3,586,758.20
4．投资顾问费		-
5．利息支出		6,870,313.49
其中：卖出回购金融资产支出		6,870,313.49
6．信用减值损失	6.4.7.19	-
7．税金及附加		5,189.88
8．其他费用	6.4.7.20	57,406.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,961,912.81
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,961,912.81
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		31,961,912.81

注：本集合计划于2022年04月25日生效，上年度可比区间无比较数据，因此利润表只列示2022年04月25日（集合计划合同生效日）至2022年06月30日数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国信现金增利货币型集合资产管理计划

本报告期：2022年04月25日（基金合同生效日）至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年04月25日（基金合同生效日）至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	6,115,791,509.10	-	-	6,115,791,509.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,879,728,999.88	-	-	7,879,728,999.88
（一）、综合收益总额	-	-	31,961,912.81	31,961,912.81
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	7,879,728,999.88	-	-	7,879,728,999.88
其中：1.基金申购款	66,318,075,104.78	-	-	66,318,075,104.78
2.基金赎回款	-58,438,346,104.90	-	-	-58,438,346,104.90
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-31,961,912.81	-31,961,912.81
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	13,995,520,508.98	-	-	13,995,520,508.98

注：本集合计划于2022年04月25日生效，上年度可比区间无比较数据，因此净资产变动表只列示2022年04月25日（集合计划合同生效日）至2022年06月30日数据。

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:

成飞	程芝英	朱彬
————————	————————	————————
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

国信现金增利货币型集合资产管理计划(以下简称本集合计划或计划）由国信现金增利1号集合资产管理计划变更而来。原国信现金增利1号集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划，无固定存续期。根据中国证监会证券基金机构监管部《关于准予国信现金增利1号集合资产管理计划合同变更的回函》(机构部函〔2022〕506号)，国信现金增利1号集合资产管理计划变更为国信现金增利货币型集合资产管理计划，变更后的《国信现金增利货币型集合资产管理计划资产管理合同》于2022年04月25日起生效，原《国信现金增利1号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。本集合计划以契约型开放式的方式运作。本集合计划自本合同变更生效日起存续期不得超过三年。本集合计划自集合计划合同生效日起三年后，按照中国证监会有关规定执行。国信现金增利1号集合资产管理计划于2012年7月31日经中国证券监督管理委员会证监许可【2012】1018号文核准设立，于2012年11月1日正式成立，设立时募集资金到位情况业经天健会计师事务所审验，并由其出具《验证报告》（天健粤验字〔2012〕第1024号）。有关计划设立等文件已按规定报中国证券投资基金业协会备案。本集合计划的管理人为国信证券股份有限公司(以下简称国信证券),托管人为中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)。

本集合计划以2022年4月25日为份额折算基准日，经本集合计划托管人中国结算确认，本计划折算前单位净值1.0000元，折算后单位净值为1.0000元；本计划折算前份额为6,115,791,509.10份，折算后份额为6,115,791,509.10份。

根据《国信现金增利货币型集合资产管理计划资产管理合同》和《国信现金增利货币型集合资产管理计划招募说明书（更新）》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，具体如下：

（一）现金；

（二）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；

（三）期限在1个月以内的债券回购；

（四）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；

（五）中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

本集合计划投资于前款第（四）项的，其中企业债、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（若无债项评级的以主体评级为准）；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。因债券信用评级调整致使集合计划投资范围不符合上述规定投资范围的，管理人应当在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。法律法规另有规定的，从其规定。

如果法律法规或监管机构以后允许现金管理产品投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称企业会计准则)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称中国基金业协会)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国信现金增利货币型集合资产管理计划集合资产管理合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划2022年06月30日的财务状况以及2022年04月25日（合同生效日）至2022年06月30日的经营成果和净值变动情况等有关信息。

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自公历01月01日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2022年04月25日（集合计划合同生效日）至2022年06月30日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本集合计划成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

（1）金融资产

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业务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。

①债务工具

本集合计划持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

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。本集合计划持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本集合计划将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金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主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

②权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本集合计划将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具（主要为股票投资）按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

（2）金融负债

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。

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

金融资产或金融负债在初始确认时，以公允价值计量。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券投资起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资或资产支持证券投资的账面价值中。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。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率每日计提应计利息，同时在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。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。

本集合计划对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本集合计划考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本集合计划对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本集合计划按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本集合计划按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本集合计划按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本集合计划假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本集合计划对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本集合计划均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本集合计划将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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，且本集合计划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；或者（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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致集合计划资产净值发生重大偏离，从而对集合计划持有人的利益产生稀释或不公平的结果，集合计划管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的集合计划资产净值的偏离度绝对值达到或超过0.25%时，集合计划管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使集合计划资产净值更能公允地反映集合计划投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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，集合计划管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以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金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本集合计划持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本集合计划（1）具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且（2）交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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。

6.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.9 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基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的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。

6.4.4.10 基金的收益分配政策

（1）每一集合计划份额享有同等分配权；

（2）本集合计划收益“每日计提、按月支付”，收益支付方式为红利再投资（即红利转集合计划份额）；

（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之日起，本集合计划根据每日收益情况，以每万份集合计划暂估收益为基准，为投资者计算当日暂估收益，并在月度分红日根据实际未付收益按月支付；

（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，每一集合计划份额计提的收益相等，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，则为集合计划份额持有人增加相应的集合计划份额；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；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，集合计划管理人将根据内部应急机制保障集合计划平稳运行，并保留向该投资者追索资金的权利；

（6）T日申购的集合计划份额不享有当日收益分配权益，自下一工作日起享有收益分配权益；T日赎回的集合计划份额享有当日收益分配权益，自下一工作日起不享有收益分配权益；

（7）本集合计划份额持有人赎回其持有的集合计划份额时，赎回份额当期对应的收益将在当期月度分红日支付；

（8）投资者分红日前解约情形下，集合计划管理人将按解约日中国人民银行活期存款基准利率对该投资人进行收益支付，其实际投资收益与支付收益的差额（损益）由集合计划资产承担；

（9）如需召开集合计划份额持有人大会，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；

（10）在不违反法律法规、集合计划合同的约定以及对集合计划份额持有人利益无实质不利影响的前提下，管理人可调整集合计划收益分配原则和支付方式，不需召开集合计划份额持有人大会；

（11）法律法规或中国证监会另有规定的从其规定。

6.4.4.11 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并披露分部信息。经营分部是指本集合计划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) 本集合计划的管理人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) 本集合计划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。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本集合计划的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本集合计划计算影子价格过程中确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本集合计划持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)，按照第三方机构提供的估值结果确定公允价值。本集合计划持有的银行间同业市场固定收益品种按照第三方机构提供的估值结果确定公允价值。

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

本集合计划在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《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《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》、财税[2016]140号《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《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按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。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	5,422,388,825.77
等于：本金	5,410,466,105.35
加：应计利息	11,922,720.42
减：坏账准备	-
定期存款	1,804,567,555.61
等于：本金	1,800,000,000.00
加：应计利息	4,567,555.61
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	1,804,567,555.61
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	7,226,956,381.38

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	448,759,778.55	449,147,082.20	387,303.65	0.0028
	银行间市场	6,332,976,815.98	6,337,277,147.95	4,300,331.97	0.0307
	合计	6,781,736,594.53	6,786,424,230.15	4,687,635.62	0.0335
资产支持证券		-	-	-	-
合计		6,781,736,594.53	6,786,424,230.15	4,687,635.62	0.0335

注：1、偏离金额＝影子定价－按实际利率计算的账面价值；

2、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

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本集合计划本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	174,848.60
其中：交易所市场	59,352.87
银行间市场	115,495.73
应付利息	-
预提费用-审计费	2,975.64

预提费用-账户维护费	9,300.00
预提费用-信息披露费	24,024.19
合计	211,148.43

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年04月25日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	6,115,791,509.10	6,115,791,509.10
本期申购	66,318,075,104.78	66,318,075,104.78
本期赎回（以“-”号填列）	-58,438,346,104.90	-58,438,346,104.90
本期末	13,995,520,508.98	13,995,520,508.98

注：1、申购含红利再投；

2、自2022年04月25日起，国信现金增利1号集合资产管理计划转型为国信现金增利货币型集合资产管理计划，《国信现金增利1号集合资产管理计划资产管理合同》失效，《国信现金增利货币型集合资产管理计划资产管理合同》同日起生效。本集合计划以2022年4月25日为份额折算基准日，经本集合计划托管人中国结算确认，本计划折算前单位净值1.0000元，折算后单位净值为1.0000元；本计划折算前份额为6,115,791,509.10份，折算后份额为6,115,791,509.10份。

6.4.7.8 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	31,961,912.81	-	31,961,912.81
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	-31,961,912.81	-	-31,961,912.81
本期末	-	-	-

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年04月25日（基金合同生效日）至2022年06月30日
活期存款利息收入	31,338,015.72
定期存款利息收入	4,702,555.61
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	10,060.88
其他	475.96
合计	36,051,108.17

注：其他为交易保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

本集合计划本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.11 基金投资收益

本集合计划本报告期内无基金投资收益。

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 2022年04月25日（基金合同生效日）至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	25,394,185.67
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,411,113.20
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	26,805,298.87

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 2022年04月25日（基金合同生效日）至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,989,633,339.27
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,965,156,477.57
减：应计利息总额	23,065,748.50
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	1,411,113.20

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本集合计划本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本集合计划本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本集合计划本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本集合计划本报告期内无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

本集合计划本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 信用减值损失

本集合计划本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.20其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年04月25日（基金合同生效日）至2022年06月30日
信息披露费	24,024.19
银行结算费用	27,233.60
审计费用	-698.52
帐户维护费	6,847.20
合计	57,406.47

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

截至资产负债表日，本集合计划无需在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本集合计划无需在财务报表附注中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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国信证券股份有限公司	管理人、基金销售机构
中国证券登记结算有限责任公司	托管人、注册登记机构

注：下述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

无。

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

本集合计划本报告期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

本集合计划本报告期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 2022年04月25日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
国信证券股份有限公司	258,784,900.00	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 2022年04月25日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国信证券股份有限公司	1,053,548,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 基金交易

本集合计划本报告期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 2022年04月25日（基金合同生效日）至2022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

国信证券股份有限公司	28,452.24	100.00%	59,352.87	100.00%

注：本集合计划与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2022年04月25日（基金合同生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	19,274,111.13
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.85%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.85%÷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0.85%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，集合计划管理人将调整管理费为0.30%，以降低每万份集合计划暂估净收益为负并引发销售机构交收透支的风险，直至该类风险消除，集合计划管理人方可恢复计提0.85%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，经管理人与托管人核对无误后，由托管人按照与管理人协商一致的方式于次月前5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、公休假等，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 2022年04月25日（基金合同生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,133,771.28

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×0.05%÷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，经管理人与托管人核对无误后，由托管人按照与管理人协商一致的方式于次月前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 2022年04月25日（基金合同生效日）至2022年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
国信证券	3,586,758.20
合计	3,586,758.20

注：本集合计划销售服务费按前一日集合计划资产净值的0.20%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

H=E×0.20%÷当年天数

H为每日应计提的销售服务费

E为前一日的集合计划资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经管理人与托管人核对无误后，由托管人按照与管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性划付给管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划在本报告期内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 2022年04月25日（基金合同生效日）至2022年06月30日
基金合同生效日（2022年04月25日）持有的基金份额	15,489,549.00
报告期初持有的基金份额	-

报告期间申购/买入总份额	4,512,049,521.21
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	4,312,405,322.21
报告期末持有的基金份额	215,133,748.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.54%

注：期间申购/买入总份额交易方式为非交易过户，为管理人提供快取功能产生的份额。

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

本集合计划本报告期无除管理人之外的其他关联方投资本集合计划的情况。

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 2022年04月25日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国证券登记结算有限责任公司	1,496,912.84	30,059.95

注：本集合计划通过托管人转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2022年06月30日的相关余额为人民币1,491,710.65元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期内无其他关联方交易事项。

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
29,865,134.70	23,984.48	2,072,793.63	31,961,912.81	-

6.4.12 期末（2022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

本集合计划本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告期末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

截至本报告期末2022年6月30日止，本集合计划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为0,无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年6月30日止，本集合计划从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本集合计划的类型为货币型集合资产管理计划，预期收益和预期风险低于债券型基金、债券型集合资产管理计划、股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金、混合型集合资产管理计划。

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，具体如下：

1、现金；

2、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；

3、期限在1个月以内的债券回购；

4、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；

5、中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

本集合计划投资于前款第（4）项的，其中企业债、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（若无债项评级的以主体评级为准）；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。因债券信用评级调整致使集合计划投资范围不符合上述规定投资范围的，管理人应当在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。法律法规另有规定的，从其规定。

如果法律法规或监管机构以后允许现金管理产品投资其他品种，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。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

目前，管理人建立了四级风险管理架构，各级组织和人员在授权范围内履行的风险管理职责如下：

（1）董事会及其下设的风险管理委员会

董事会是公司风险管理的最高决策机构，负责合理确立公司风险管理战略和风险政策，确保公司拥有合适的体系、政策、程序和文化以支持风险管理战略的实施。风险管理委员会是董事会下设的专门工作机构，对董事会负责并报告工作。

（2）经营管理层、首席风险官及风险控制委员会

经营管理层在董事会授权范围内负责公司风险管理工作的组织、管理和监督，并将风险管理贯穿经营管理活动的全过程。公司风险控制委员会负责落实董事会风险管理委员会的战略规划和决策，首席风险官牵头开展全面风险管理工作。

（3）独立的风险管理机构（多部门协同）

风险管理总部及相关职能部门牵头各类风险的管理工作。风险管理总部是市场风险、信用风险、操作风险的牵头部门，协同相关专业部门开展流动性风险、信息技术风险、声誉风险管理工作。各部门充分发挥了各自的专业优势，在事前、事中、事后的环节中，对各类型风险予以评估、监测、检查、考核等，形成了全面风险管理合力。

（4）业务部门（含风控中台）

业务部门是风险管理第一责任部门，业务部门负责人是本部门风险管理工作的第一责任人，对所在部门的各类风险承担责任。业务部门建立风控中台（二级部门或风险管理专岗）负责本部门风险管理细则制定、日常业务审核、业务风险排查、风险资料报送等工作，风控中台还承担了业务前台和风险管理部门之间的沟通职责，起到承上启下的重要作用。

公司已形成多部门通力协作、相互制衡的风险管理体系，公司风险控制委员会、首席风险官在风险资源配置、风险限额管理等工作中也发挥统筹管理的作用。

对于集合计划运作，业务部门建立了明确的投资决策流程与授权管理制度，投资决策委员会、投资部门或团队负责人和投资人员对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据不同权限独立、客观地履行职责，实施风险控制。投资、交易、风险、合规管理以及清算人员在不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理，形成了一套贯穿事前监控、事中管理和事后评估的风险监控体系。

本集合计划管理人按照自上而下与自下而上相结合的方式，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

日常经营活动中本集合计划面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内。

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。本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本集合计划的银行存款存放在商业信誉良好的股份制银行，因而银行存款相关资产无重大信用风险。本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，因此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。本集合计划的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。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。

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 2022年06月30日
A-1	201,356,931.51
A-1以下	-
未评级	2,410,505,136.97
合计	2,611,862,068.48

注：1、持有发行期限在一年以内（含）的债券按其债项评级作为短期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为长期信用评级进行列示；
2、未评级部分为国债、政策性金融债、企业短期及超短期融资债券；
3、本集合计划合同生效日期为2022年04月25日。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年06月30日
A-1	-

A-1以下	-
未评级	3,981,855,045.74
合计	3,981,855,045.74

注：1、持有发行期限在一年以内（含）的同业存单按其债项评级作为短期信用评级进行列示，持有的其他同业存单以其债项评级作为长期信用评级进行列示;
2、本集合计划合同生效日期为2022年04月25日。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日
AAA	188,019,480.31
AAA以下	-
未评级	-
合计	188,019,480.31

注：1、持有发行期限在一年以上的债券按其债项评级作为长期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为短期信用评级进行列示；
2、本集合计划合同生效日期为2022年04月25日。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合计划份额持有人可随时要求赎回其持有的集合计划份额，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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本集合计划的管理人每日对本集合计划的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持集合计划投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本集合计划的管理人在集合计划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，有效保障集合计划持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本集合计划的管理人主要通过限制、跟踪和控制集合计划投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。此外本集合计划还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，除发生巨额赎回、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回30%以上的情形外，债券正回购的资金余额占集合计划资产净值的比例不得超过20%。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

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。

本集合计划投资于一家公司发行的证券市值不超过集合计划资产净值的10%，且本集合计划与由本集合计划管理人管理的其他集合计划共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的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本集合计划资产净值的10%。

一般情况下，本集合计划投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过240天；当本集合计划前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本集合计划投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天，且投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占集合计划资产净值的比例合计不得低于20%；当本集合计划前10名份额持有人的持有份额合计超过集合计划总份额的50%时，本集合计划投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过60天，平均剩余存续期不得超过120天，且投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占集合计划资产净值的比例合计不得低于30%；本集合计划的管理人每日对基金组合资产中的7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划所持有大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，因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本集合计划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，其上限一般不超过集合资产管理计划持有的债券投资的公允价值。

同时，本集合计划的管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本集合计划从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本集合计划的管理人根据质押品的资质确定质押率水平，持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与本集合计划合同约定的投资范围保持一致。综合上述各项流动性指标的监测结果以及流动性风险管理措施的实施，本集合计划在本报告期内的流动性情况良好。

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。

本集合计划主要投资于交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本集合计划的管理人每日通过“影子定价”对本集合计划面临的市场风险进行监控，定期对本集合计划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 2022年06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						
银行存款	7,226,956,381.38	-	-	-	-	7,226,956,381.38
结算备付金	1,491,710.65	-	-	-	-	1,491,710.65
存出保证金	176,290.90	-	-	-	-	176,290.90
交易性金融资产	3,667,355,775.42	3,114,380,819.11	-	-	-	6,781,736,594.53
资产总计	10,895,980,158.35	3,114,380,819.11	-	-	-	14,010,360,977.46
负债						

应付管理人报酬	-	-	-	-	10,411,880.74	10,411,880.74
应付托管费	-	-	-	-	612,463.60	612,463.60
应付销售服务费	-	-	-	-	1,501,527.54	1,501,527.54
应交税费	-	-	-	-	30,654.54	30,654.54
应付利润	-	-	-	-	2,072,793.63	2,072,793.63
其他负债	-	-	-	-	211,148.43	211,148.43
负债总计	-	-	-	-	14,840,468.48	14,840,468.48
利率敏感度缺口	10,895,980,158.35	3,114,380,819.11	-	-	-14,840,468.48	13,995,520,508.98

注：1、表中所示为本集合计划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；

2、本集合计划合同生效日期为2022年04月25日，故无上年度末可比数据。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.该利率敏感性分析基于资产负债表日的利率风险状况；2.该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动25个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；3.该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；4.银行活期存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；定期存款利息收入、买入返售金融资产利息收益与卖出回购金融资产的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响；5. 该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。	
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 2022年06月30日
	基准利率减少25个基点	9,501,982.54
	基准利率增加25个基点	-9,469,281.63

注：本集合计划合同生效日期为2022年04月25日，故无上年度末可比数据。

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

本集合计划所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。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。本集合计划主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种和证券交易所的债券回购产品，且以实际利率计算账面价值进行后续计量，因此无重大市场价格风险。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日
第一层次	-
第二层次	6,781,736,594.53
第三层次	-
合计	6,781,736,594.53

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划本报告期内不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划本报告期内不存在非持续的以公允价值计量的金融工具的情况。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本集合计划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

截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

§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	6,781,736,594.53	48.41
	其中：债券	6,781,736,594.53	48.41
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	7,228,448,092.03	51.59
4	其他各项资产	176,290.90	0.00
5	合计	14,010,360,977.46	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	17.52	
	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	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占集合资产净值的比例为报告期内每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

本集合计划本报告期内不存在债券正回购的资金余额超过集合计划资产净值的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	118
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	53

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本集合计划不存在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	40.88	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	1.08	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	3.89	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	7.73	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	46.53	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		100.11	-

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

本集合计划本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

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	41,176,735.29	0.29
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	448,759,778.55	3.21
5	企业短期融资券	2,309,945,034.95	16.50
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,981,855,045.74	28.45
8	其他	-	-
9	合计	6,781,736,594.53	48.46
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	149866	22长江D1	3,000,000	301,917,033.53	2.16
2	112280186	22绍兴银行CD055	2,500,000	244,170,255.31	1.74
3	072210022	22东财证券CP002	2,000,000	201,907,696.24	1.44
4	072210075	22渤海证券CP005	2,000,000	200,470,136.99	1.43
5	072210087	22渤海证券CP006	2,000,000	200,138,630.14	1.43
6	112281708	22厦门国际银行CD115	2,000,000	198,094,583.06	1.42

7	112108168	21中信银行CD168	2,000,000	197,791,802.22	1.41
8	112208058	22中信银行CD058	2,000,000	196,812,175.57	1.41
9	112299392	22厦门国际银行CD087	2,000,000	195,985,094.62	1.40
10	112208055	22中信银行CD055	2,000,000	195,928,466.20	1.40

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	0.0889%
报告期内偏离度的最低值	0.0167%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0449%

注：以上数据按工作日统计

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本集合计划本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本集合计划本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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

本集合计划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

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

7.9.2 本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，中信银行股份有限公司、绍兴银行股份有限公司、厦门国际银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到监管部门的处罚，处罚力度和性质对该公司长期经营未产生重大负面影响。本集合计划对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及合同的要求。除上述主体外，本集合计划投资的其他前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

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	176,290.90
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	176,290.90

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，投资组合报告中市值占净值比例的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
165,983	84,319.00	955,587,660.18	6.83%	13,039,932,848.80	93.17%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	券商类机构	215,133,748.00	1.54%
2	个人	117,614,582.13	0.84%
3	个人	83,820,274.87	0.60%
4	其他机构	60,395,004.91	0.43%

5	个人	59,974,507.44	0.43%
6	其他机构	52,833,222.13	0.38%
7	其他机构	49,136,026.11	0.35%
8	个人	49,078,534.10	0.35%
9	其他机构	43,219,740.20	0.31%
10	个人	35,628,505.87	0.25%

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	45,446,137.59	0.32%

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人指本公司高级管理人员以及本公司资产管理总部总经理、从事大集合业务的副总经理及总经理助理、大集合投资团队负责人和研究团队负责人。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022年04月25日)基金份额总额	6,115,791,509.10
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	66,318,075,104.78
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	58,438,346,104.90
本报告期期末基金份额总额	13,995,520,508.98

注：报告期内基金总申购份额含红利再投资和转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§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，本集合计划未召开集合计划份额持有人大会。

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，本集合计划管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本集合计划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

本报告期无涉及本集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本集合计划的投资策略未有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本集合计划自合同生效日起聘请天健会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划提供审计服务。本报告期内本集合计划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

本集合计划管理人及其高级管理人员未因资产管理业务受到稽查或处罚，本集合计划托管人及其高级管理人员未因托管业务受到稽查或处罚。

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	
国信证券	2	-	-	28,452.24	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
国信证券	258,784,900.00	100.00%	1,053,548,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本报告期内，本集合计划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	“国信现金增利1号集合资产管理计划”变更为 “国信现金增利货币型集合资产管理计划”及其法律文件生效的公告	规定媒介	2022-04-25
2	国信现金增利货币型集合资产管理计划开放日常申购、赎回业务的公告	规定媒介	2022-04-25
3	关于国信现金增利货币型集合资产管理计划快速取出服务调整的公告	规定媒介	2022-04-25
4	国信现金增利货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定媒介	2022-05-25
5	关于国信现金增利货币型集合资产管理计划快速取出服务调整的公告	规定媒介	2022-05-31
6	关于国信现金增利货币型集合资产管理计划招募说明书（更新）的提示性公告	规定媒介	2022-06-02
7	国信现金增利货币型集合资产管理计划招募说明书（更新）	规定媒介	2022-06-02
8	关于国信现金增利货币型集合资产管理计划销售服务费率优惠活动的公告	规定媒介	2022-06-10
9	关于国信现金增利货币型集合资产管理计划快速取出服务调整的公告	规定媒介	2022-06-17
10	关于国信现金增利货币型集合资产管理计划快速取出服务调整的公告	规定媒介	2022-06-27
11	国信现金增利货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定媒介	2022-06-27
12	关于国信现金增利货币型集合资产管理计划销售服务费率优惠活动的公告	规定媒介	2022-06-28

注：规定媒介指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括管理人网站、托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介。

§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

本集合计划本报告期内无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

本集合资产管理计划由国信现金增利1号集合资产管理计划变更而来，并于2022年04月25日变更正式生效，管理人已按照相关法律文件履行了变更程序。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

国信证券股份有限公司

二〇二二年八月三十一日