

国联现金添利货币型集合资产管理计划

2023 年第 2 季度报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:国联证券股份有限公司

基金托管人:中国证券登记结算有限责任公司

报告送出日期:2023 年 07 月 20 日

§ 1 重要提示

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

集合计划托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本集合计划资产管理合同规定，于 2023 年 07 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 04 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国联现金添利货币
基金主代码	970159
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 05 月 09 日
报告期末基金份额总额	2,442,720,944.80 份
投资目标	安全性和流动性优先，在此基础上追求适度收益。
投资策略	本集合计划采用的主要投资策略包括资产配置策略、久期管理策略、个券选择策略、利用短期市场机会的灵活策略、现金流管理策略等。
业绩比较基准	本集合计划采用“同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）”作为业绩比较基准。
风险收益特征	本集合计划的类型为货币型集合资产管理计划，预期收益和预期风险低于债券型基金、债券型集合资产管理计划、股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金、混合型集合资产管理计划。
基金管理人	国联证券股份有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司

注：本集合计划为按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 04 月 01 日-2023 年 06 月 30 日）
1. 本期已实现收益	8,418,679.66
2. 本期利润	8,418,679.66
3. 期末基金资产净值	2,442,720,944.80

注：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，由于按摊余成本法核算的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。

3.2 基金净值表现

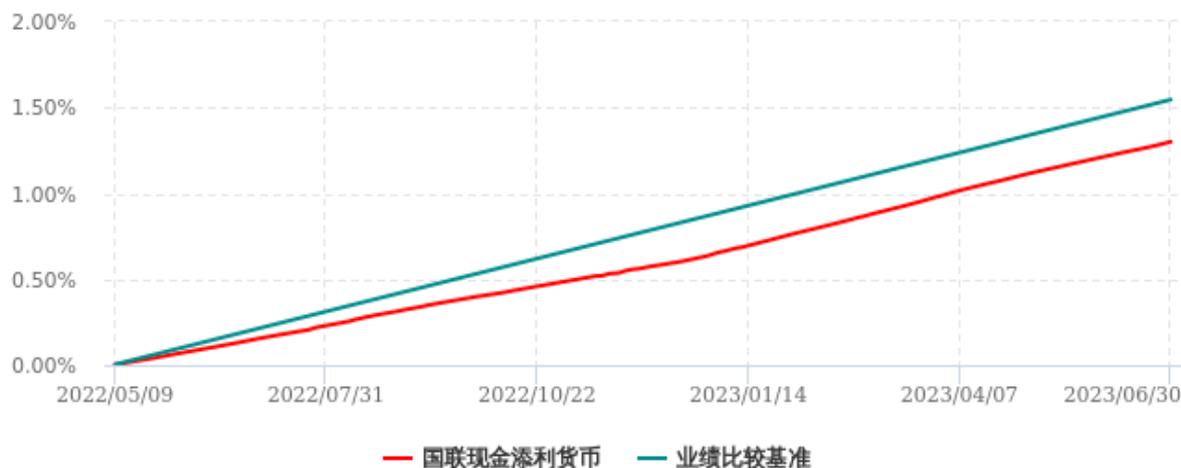
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.3158%	0.0003%	0.3366%	0.0000%	- 0.0208%	0.0003%
过去六个月	0.6566%	0.0004%	0.6695%	0.0000%	- 0.0129%	0.0004%
过去一年	1.1653%	0.0008%	1.3500%	0.0000%	- 0.1847%	0.0008%
自基金合同 生效起至今	1.3074%	0.0007%	1.5460%	0.0000%	- 0.2386%	0.0007%

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

国联现金添利货币型集合资产管理计划累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年05月09日-2023年06月30日)



注：1. 本集合计划合同生效日为 2022 年 5 月 9 日, 由证券公司大集合资产管理产品变更而来。

2. 按本集合计划合同规定, 自合同生效起 6 个月内为建仓期, 建仓结束时各项资产配置比例均符合计划合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
华达	本集合计划投资经理	2022-05-09	-	7 年	华达, CFA, 约翰霍普金斯大学金融学硕士, 具有证券从业资格、基金从业资格、期货从业资格, 最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。于 2015 年加入国联证券, 负责债券投资工作, 研究领域新能源、有色、TMT、城投等, 负责整理一级市场发行人经营与财务数据, 对每日新债发行及定价情况进行跟踪整理, 分析发债企业的资信状况, 构建固定收益组合, 并根

					据市场变化和组合的定期评估，适时调整组合和投资品种。研究能力出众，每年调研企业数十家，对债券市场及各发行人均有深入了解，风险控制能力强。
--	--	--	--	--	--

注：1. 集合计划的首任基金经理，其“任职日期”为资产管理合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

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

3. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内，本集合计划投资经理未同时兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

报告期内，本管理人严格遵守《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》及其他有关法律法规以及集合计划合同、招募说明书的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在控制风险的基础上，为计划份额持有人谋求最大利益，没有发生损害计划份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关规定，通过各项内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本集合计划进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。报告期内，未出现涉及本集合计划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 报告期内基金的投资策略和运作分析

本集合计划资产配置主要以流动性较好、信用评级优质的资产为主，投以同业存款，同业存单，高等级信用债等。

展望来看，我们认为短端利率在当下流动性相对偏松的情形下，跨季以及税期结束后，短期内

或将维持低位；长端利率短期受到经济修复斜率不足以及流动性偏宽的支撑，政策预期博弈背景下，利率水平或将维持低位区间震荡，利率波段交易胜率有所降低，宜多看少动。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国联现金添利货币份额净值为 1.000 元，本报告期内，基金份额净值收益率为 0.3158%，同期业绩比较基准收益率为 0.3366%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日计划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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	996,296,975.34	36.89
	其中:债券	996,296,975.34	36.89
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	851,558,807.68	31.53
	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	853,004,580.69	31.58
4	其他资产	38,116.52	0.00
5	合计	2,700,898,480.23	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	7.75
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	255,119,214.59	10.44
	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

本报告期内本集合计划债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
----	----

报告期末投资组合平均剩余期限	33
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	37
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	24

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本集合计划投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	66.76	10.44
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	13.91	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	17.20	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	11.05	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	0.82	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	109.75	10.44

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本集合计划投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	154,264,046.87	6.32
	其中：政策性金融债	154,264,046.87	6.32
4	企业债券	93,123,613.88	3.81
5	企业短期融资券	132,245,103.05	5.41
6	中期票据	188,059,790.47	7.70
7	同业存单	428,604,421.07	17.55
8	其他	-	-
9	合计	996,296,975.34	40.79

10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-
----	----------------------	---	---

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112303094	23 农业银行 CD094	1,000,000	99,678,571.98	4.08
2	112209141	22 浦发银行 CD141	1,000,000	99,611,342.18	4.08
3	200313	20 进出 13	900,000	92,673,442.12	3.79
4	102101951	21 晋能煤业 MTN001	800,000	83,765,742.46	3.43
5	175066	20 五资 01	800,000	82,708,595.95	3.39
6	102001345	20 晋煤 MTN010	600,000	62,418,376.39	2.56
7	012380034	23 华发集团 SCP001	600,000	61,437,217.23	2.52
8	200207	20 国开 07	500,000	51,387,737.42	2.10
9	012380533	23 环球租赁 SCP004	500,000	50,496,853.44	2.07
10	112214103	22 江苏银行 CD103	500,000	49,953,800.76	2.05

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0152%
报告期内偏离度的最低值	-0.0021%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0069%

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

本集合计划报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

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

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本集合计划采用固定份额净值，计划份额账面净值始终保持为人民币 1.00 元。

本集合计划估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本报告期内集合计划投资的前十名证券中的发行主体包括中国建设银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司。中国银行保险监督管理委员会分别于 2022 年 9 月 9 日、2022 年 9 月 30 日、2023 年 2 月 16 日对中国建设银行股份有限公司，于 2022 年 9 月 30 日对中国农业银行股份有限公司作出了处罚决定。河南银保监局于 2023 年 3 月 7 日对中国建设银行股份有限公司作出了处罚决定。中国人民银行于 2023 年 2 月 6 日对江苏银行股份有限公司作出了处罚决定。上海市市场监督管理局于 2022 年 8 月 17 日对上海浦东发展银行股份有限公司作出了处罚决定。国家外汇管理局上海市分局于 2022 年 9 月 2 日对上海浦东发展银行股份有限公司作出了处罚决定。在上述处罚公布后，本集合计划管理人对该公司进行了深入了解和分析，认为上述处罚不会对中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司和上海浦东发展银行股份有限公司的投资价值构成实质性的负面影响，因此本集合计划管理人对该公司债券的投资判断未发生改变。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	38,116.52
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	38,116.52

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基	2,160,298,730.23
--------	------------------

金份额总额	
报告期期间基金总申购份额	19,022,523,255.85
报告期期间基金总赎回份额	18,740,101,041.28
报告期期末基金份额总额	2,442,720,944.80

注：总申购份额含红利再投（如有）、转换入份额（如有）；总赎回份额含转换出份额（如有）。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	非交易过户转入	2023-04-03	19,665,252	0	0
2	赎回	2023-04-03	-49,990,000	-49,990,000	0
3	非交易过户转入	2023-04-04	39,789,402	0	0
4	赎回	2023-04-04	-19,665,252	-19,665,252	0
5	非交易过户转入	2023-04-06	49,989,538	0	0
6	赎回	2023-04-06	-39,789,402	-39,789,402	0
7	非交易过户转入	2023-04-07	46,187,622	0	0
8	赎回	2023-04-07	-49,989,538	-49,989,538	0
9	非交易过户转入	2023-04-10	41,955,930	0	0
10	赎回	2023-04-10	-46,187,622	-46,187,622	0
11	非交易过户转入	2023-04-11	39,999,882	0	0
12	赎回	2023-04-11	-41,955,930	-41,955,930	0
13	非交易过户转入	2023-04-12	29,730,709	0	0
14	赎回	2023-04-12	-39,999,882	-39,999,882	0
15	非交易过户转入	2023-04-13	36,284,707	0	0
16	赎回	2023-04-13	-29,730,709	-29,730,709	0
17	非交易过户转入	2023-04-14	35,888,532	0	0
18	赎回	2023-04-14	-36,284,707	-36,284,707	0
19	非交易过户	2023-04-17	40,000,000	0	0

	转入				
20	赎回	2023-04-17	-35,888,532	-35,888,532	0
21	非交易过户 转入	2023-04-18	39,802,285	0	0
22	赎回	2023-04-18	-40,000,000	-40,000,000	0
23	非交易过户 转入	2023-04-19	31,642,029	0	0
24	赎回	2023-04-19	-39,802,285	-39,802,285	0
25	非交易过户 转入	2023-04-20	45,056,962	0	0
26	赎回	2023-04-20	-31,642,029	-31,642,029	0
27	非交易过户 转入	2023-04-21	26,122,310	0	0
28	赎回	2023-04-21	-45,056,962	-45,056,962	0
29	非交易过户 转入	2023-04-24	29,150,341	0	0
30	赎回	2023-04-24	-26,122,310	-26,122,310	0
31	非交易过户 转入	2023-04-25	33,689,674	0	0
32	赎回	2023-04-25	-29,150,341	-29,150,341	0
33	非交易过户 转入	2023-04-26	40,979,160	0	0
34	赎回	2023-04-26	-33,689,674	-33,689,674	0
35	非交易过户 转入	2023-04-27	34,409,054	0	0
36	赎回	2023-04-27	-40,979,160	-40,979,160	0
37	非交易过户 转入	2023-04-28	39,998,760	0	0
38	赎回	2023-04-28	-34,409,054	-34,409,054	0
39	非交易过户 转入	2023-05-04	32,911,849	0	0
40	赎回	2023-05-04	-39,998,760	-39,998,760	0
41	非交易过户 转入	2023-05-05	42,114,210	0	0
42	赎回	2023-05-05	-32,911,849	-32,911,849	0
43	非交易过户 转入	2023-05-08	44,866,815	0	0
44	赎回	2023-05-08	-42,114,210	-42,114,210	0
45	非交易过户 转入	2023-05-09	44,867,444	0	0
46	赎回	2023-05-09	-44,866,815	-44,866,815	0
47	非交易过户 转入	2023-05-10	37,588,606	0	0

48	赎回	2023-05-10	-44,867,444	-44,867,444	0
49	非交易过户 转入	2023-05-11	31,243,303	0	0
50	赎回	2023-05-11	-37,588,606	-37,588,606	0
51	非交易过户 转入	2023-05-12	25,484,852	0	0
52	赎回	2023-05-12	-31,243,303	-31,243,303	0
53	非交易过户 转入	2023-05-15	35,306,665	0	0
54	赎回	2023-05-15	-25,484,852	-25,484,852	0
55	非交易过户 转入	2023-05-16	39,999,465	0	0
56	赎回	2023-05-16	-35,306,665	-35,306,665	0
57	非交易过户 转入	2023-05-17	31,565,973	0	0
58	赎回	2023-05-17	-39,999,465	-39,999,465	0
59	非交易过户 转入	2023-05-18	29,889,198	0	0
60	赎回	2023-05-18	-31,565,973	-31,565,973	0
61	非交易过户 转入	2023-05-19	29,825,135	0	0
62	赎回	2023-05-19	-29,889,198	-29,889,198	0
63	非交易过户 转入	2023-05-22	46,981,796	0	0
64	赎回	2023-05-22	-29,825,135	-29,825,135	0
65	非交易过户 转入	2023-05-23	39,709,064	0	0
66	赎回	2023-05-23	-46,981,796	-46,981,796	0
67	非交易过户 转入	2023-05-24	33,449,166	0	0
68	赎回	2023-05-24	-39,709,064	-39,709,064	0
69	非交易过户 转入	2023-05-25	22,629,476	0	0
70	赎回	2023-05-25	-33,449,166	-33,449,166	0
71	非交易过户 转入	2023-05-26	28,962,935	0	0
72	赎回	2023-05-26	-22,629,476	-22,629,476	0
73	非交易过户 转入	2023-05-29	39,469,111	0	0
74	赎回	2023-05-29	-28,962,935	-28,962,935	0
75	非交易过户 转入	2023-05-30	40,798,685	0	0
76	赎回	2023-05-30	-39,469,111	-39,469,111	0

77	非交易过户 转入	2023-05-31	27,611,000	0	0
78	赎回	2023-05-31	-40,798,685	-40,798,685	0
79	非交易过户 转入	2023-06-01	23,454,469	0	0
80	赎回	2023-06-01	-27,611,000	-27,611,000	0
81	非交易过户 转入	2023-06-02	29,637,212	0	0
82	赎回	2023-06-02	-23,454,469	-23,454,469	0
83	非交易过户 转入	2023-06-05	35,009,993	0	0
84	赎回	2023-06-05	-29,637,212	-29,637,212	0
85	非交易过户 转入	2023-06-06	28,748,407	0	0
86	赎回	2023-06-06	-35,009,993	-35,009,993	0
87	非交易过户 转入	2023-06-07	24,654,838	0	0
88	赎回	2023-06-07	-28,748,407	-28,748,407	0
89	非交易过户 转入	2023-06-08	20,245,929	0	0
90	赎回	2023-06-08	-24,654,838	-24,654,838	0
91	非交易过户 转入	2023-06-09	24,638,337	0	0
92	赎回	2023-06-09	-20,245,929	-20,245,929	0
93	非交易过户 转入	2023-06-12	27,516,822	0	0
94	赎回	2023-06-12	-24,638,337	-24,638,337	0
95	非交易过户 转入	2023-06-13	27,104,260	0	0
96	赎回	2023-06-13	-27,516,822	-27,516,822	0
97	非交易过户 转入	2023-06-14	39,999,564	0	0
98	赎回	2023-06-14	-27,104,260	-27,104,260	0
99	非交易过户 转入	2023-06-15	32,769,520	0	0
100	赎回	2023-06-15	-39,999,564	-39,999,564	0
101	非交易过户 转入	2023-06-16	37,676,602	0	0
102	赎回	2023-06-16	-32,769,520	-32,769,520	0
103	非交易过户 转入	2023-06-19	35,376,303	0	0
104	赎回	2023-06-19	-37,676,602	-37,676,602	0
105	非交易过户	2023-06-20	39,318,973	0	0

	转入				
106	赎回	2023-06-20	-35,376,303	-35,376,303	0
107	非交易过户 转入	2023-06-21	39,965,383	0	0
108	赎回	2023-06-21	-39,318,973	-39,318,973	0
109	非交易过户 转入	2023-06-26	44,781,654	0	0
110	红利发放	2023-06-26	122,198.17	122,198.17	0
111	赎回	2023-06-26	-39,965,383	-39,965,383	0
112	非交易过户 转入	2023-06-27	40,722,961	0	0
113	赎回	2023-06-27	-44,781,654	-44,781,654	0
114	非交易过户 转入	2023-06-28	45,136,641	0	0
115	赎回	2023-06-28	-40,722,961	-40,722,961	0
116	非交易过户 转入	2023-06-29	39,815,551	0	0
117	赎回	2023-06-29	-45,136,641	-45,136,641	0
118	非交易过户 转入	2023-06-30	42,873,937	0	0
119	赎回	2023-06-30	-39,815,551	-39,815,551	0
-	-	-	-6,993,864.83	-	-
				2,092,058,117.83	
合计			-	-	

注：上述表内非交易过户转入为管理人支持快速取现业务产生的份额，赎回为赎回非交易过户转入份额。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本集合计划本报告期内，未发现影响投资决策的其他重要信息。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准国联现金添利 1 号集合资产管理计划合同变更的文件；
- (2) 国联现金添利货币型集合资产管理计划资产管理合同；
- (3) 国联现金添利货币型集合资产管理计划托管协议；
- (4) 国联现金添利货币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；
- (8) 业务规则及中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

备查文件存放于本集合计划管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人网站(www.glsc.com.cn)查阅,或在营业时间内至本集合计划管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本集合计划管理人:国联证券股份有限公司
客户服务中心电话:95570

国联证券股份有限公司
二〇二三年七月二十日