

万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:万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

送出日期:2023 年 08 月 01 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 2023 年 7 月 19 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。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 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合规守信情况的说明	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	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	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（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 债券回购融资情况	39
7.3 基金投资组合平均剩余期限	40
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	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	41
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	42
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	42
7.9 投资组合报告附注	42
§8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44

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.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	45
§10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	47
10.9 其他重大事件.....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
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.....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
§12 备查文件目录.....	48
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划
基金简称	万联天添利货币
基金主代码	970177
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年07月22日
基金管理人	万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
报告期末基金份额总额	362,017,818.90份
基金合同存续期	本集合计划的存续期限自资产管理合同生效之日起3年，期限届满后，按照中国证监会有关规定执行。

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	在控制投资组合风险，保持相对流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本集合计划在确保资产安全性和流动性的基础上，采取积极主动的投资策略，综合利用定性分析和定量分析方法，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	人民币活期存款利率（税后）
风险收益特征	本集合计划为货币型产品，属于高流动性、低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	万联证券股份有限公司	中国证券登记结算有限责任公司

信息披露 负责人	姓名	吕嘉琪	陈晨
	联系电话	020-36653026	010-50938723
	电子邮箱	lvjq@wlzq.com.cn	zctg@chinaclear.com.cn
客户服务电话		95322	4008-058-058
传真		020-38286931	—
注册地址		广州市天河区珠江东路11号 高德置地广场F座18、19楼全 层	北京市西城区太平桥大街17 号
办公地址		广州市天河区珠江东路11号 高德置地广场F座18楼	北京市西城区锦什坊街26号
邮政编码		510623	100033
法定代表人		王达	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.wlzq.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18楼

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
	(2023年01月01日-2023年06月30日)

本期已实现收益	3,023,731.57
本期利润	3,023,731.57
本期净值收益率	0.6543%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)
期末基金资产净值	362,017,818.90
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)
累计净值收益率	1.1707%

注：（1）本期已实现收益指集合计划本期利息收入、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。由于本集合计划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）本集合计划收益每日预提、按季支付收益，现金分红，不结转份额。

（3）本集合计划无持有人认购或交易基金的各项费用。

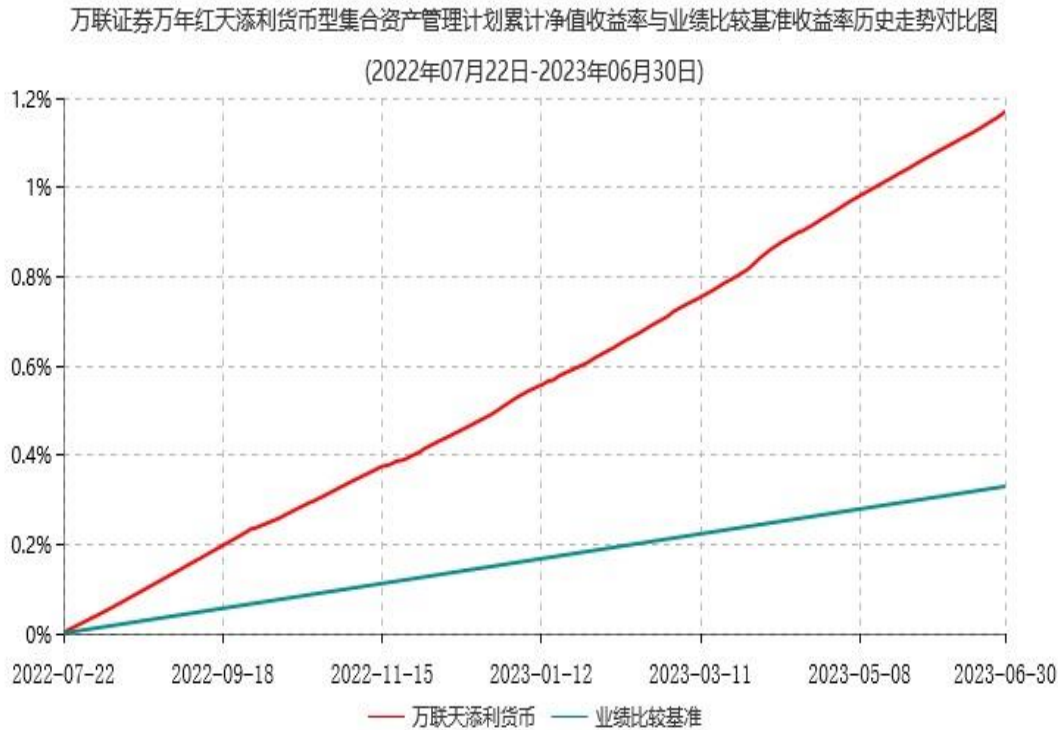
3.2 基金净值表现

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	0.1094%	0.0006%	0.0288%	0.0000%	0.0806%	0.0006%
过去三个月	0.3392%	0.0006%	0.0873%	0.0000%	0.2519%	0.0006%
过去六个月	0.6543%	0.0007%	0.1736%	0.0000%	0.4807%	0.0007%
自基金合同生效起至今	1.1707%	0.0006%	0.3299%	0.0000%	0.8408%	0.0006%

注：本集合计划收益每日预提、按季支付。

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：集合计划合同生效日为2022年7月22日。

§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

万联证券股份有限公司是广州市属全资国有证券公司，于2001年8月23日经中国证监会批准设立，现有注册资本59.54亿元。

截至2023年6月30日，本集合计划管理人共管理了1只参照开放式证券投资基金管理的集合计划：万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘晨	投资经理	2022-0	-	6	英国南安普顿大学管理学

		7-22		年	硕士，具有证券、基金从业资格，多年债券投资研究经历。曾就职于大型股份制银行，对银行间市场流动性有深入研究，并且对债券市场一二级投资有着丰富的投资经验。从业期间具备良好诚信记录及职业操守，未出现被监管机构等处罚的情况。
--	--	------	--	---	--

注：(1)基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，其"离职日期"为根据公司决定确定的解聘日期；(2)非首任基金经理，其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定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相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，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》等有关法律法规及集合计划合同、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集合计划资产，在控制风险的基础上，为集合计划份额持有人谋求最大利益，无损害集合计划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

本报告期内，管理人严格执行《万联证券股份有限公司资产管理业务公平交易管理细则》等相关制度规定，完善相应制度及流程，并重视交易执行环节的公平交易措施，通过投资交易系统内的公平交易模块，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

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本集合计划未发现可能的异常交易情况，不存在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成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

报告期内未发现本管理计划存在异常交易行为。

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

2023年上半年，外需走弱，出口结构性调整，内需仍有进一步提振空间，房地产恢复较为缓慢，资本市场整体也相应呈现债强股弱的局面。

2023年1月，强复苏预期下，权益市场出现回升，债券市场再度走弱，利率债收益率回升，信用债小幅调整。2023年一季度，经济动能有所放缓，通胀数据偏低，楼市降温，市场对房地产放松后的强预期逐渐消退。从2023年2月份开始，CPI当月同比增长率降至1%及以下，市场出现一定的通缩担忧情绪。

2023年二季度，为了进一步提振经济，货币政策继续宽松，2023年3月央行降准25bp，利率债有所修复，信用利差压缩逐步向中等期限传导，高等级3至5年期信用债估值也出现修复。2023年二季度经济数据好转不及市场预期，随着2023年4至5月经济和金融数据的公布，经济弱复苏逐渐证实。6月，央行下调7天逆回购利率、常备借贷便利利率（SLF），随后又分别下调中期借贷便利利率（MLF）、贷款市场报价利率（LPR），降息后市场止盈情绪占上风，利率债、短端信用债、银行二永债出现回调。

伴随债市情绪修复，城投债一级市场超额认购倍数整体逐步回升；市场投资情绪偏谨慎，多在AA+级以上城投债博取收益，地市（开发区）级城投债相对更受青睐；期限方面，市场对短久期债券偏好有所上升，伴随情绪修复，久期有所拉长，但总体表现仍然谨慎。2023年6月末，AA+至AAA各期限等级利差修复较为明显，AA至AA+短期限等级利差也有所修复。期限方面，3年期等级利差在二季度有一定回升，长期限城投债的利率维持在相对高位。当前债券收益率有所恢复，2023年5月至6月，10年国债利率在2.60%-2.70%附近波动，信用债估值有待进一步修复，信用利差也有所压缩，但不同等级信用利差分化较大。

投资操作方面，我们根据债市的长期趋势和短期波动进行了合理的组合调整，以高等级、高流动性的策略为核心，并对组合久期进行灵活优化，组合整体的流动性较好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末万联天添利货币基金份额净值为1.000元，本报告期内，基金份额净值收益率为0.6543%，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

下半年预计货币政策维持宽松基调，总量政策仍有空间。信用方面，2023年一季度信贷与社融持续超市场预期，总量和结构都出现了修复，宽信用正逐步落地。但还应关注居民部门信贷改善幅度有限，企业中长期贷款面临冲量见顶的风险，央行也不断提示信贷投放节奏。流动性方面，信贷投放加大、银行超储率偏低、地方债提前批发行、财政投放力度偏弱、税期因素扰动等综合因素叠加，导致一季度资金利率中枢有所抬升，

波动率也有所加大，流动性分层加剧，同业存单利率持续上行。政策层面，宽松货币政策将继续为稳增长保驾护航，预计资金价格上行空间有限。在没有强刺激政策的前提假设下，基本面内生修复动能有限，总量政策仍有空间。为了稳定经济基本盘，预计会有一些的利好调控政策出台。

经济基本面仍有待进一步恢复，消费温和回升，地产投资端有待进一步改善，基建投资增速适中，外需转弱对出口和制造业投资施加一定的向下压力，货币政策仍处于呵护态度，预计可能出台进一步总量宽松政策。风险点在于估值水平偏低以及市场对宽信用政策出台的担忧。总体看，债券利率上行风险有限，信用债的配置价值仍存。对信用债而言，弱复苏基本面、资金面平稳宽松、供需缺口下，信用债配置力量偏强，中短久期信用债以持有策略为佳，票息策略继续占优。

综上，我们将继续密切关注各项宏观经济和金融数据，分析经济趋势和宏观政策，进而灵活研判债市的长期趋势和短期波动。择机加强信用债配置，继续秉承稳健的投资理念，充分挖掘信用债的配置机会，并做好流动性管理。

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，对集合计划持有的投资品种进行估值。

本集合计划管理人设有估值委员会，估值委员会负责建立并完善资产管理业务相关金融工具公允价值估值体系，制定、修订和完善资产管理业务估值政策，审议和决策资产管理业务相关金融工具公允机制重大调整方案及制度规定的其他事项。估值委员会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、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。资金清算部是资管产品估值的实施部门，该部门设置资产估值岗执行具体工作。基金经理可以参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划资产管理合同》及变更前合同的约定，本集合计划利润每日预提，按季支付，将已实现收益发放给集合计划份额持有人。本集合计划报告期内，进行了2次收益集中支付，采用现金分红的方式支付收益2,816,288.76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

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或集合计划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：万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	95,372,396.32	151,891,598.72
结算备付金		6,903,105.00	10,596,151.58
存出保证金		4,732.30	85,010.22
交易性金融资产	6.4.7.2	111,581,837.69	150,128,379.68
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-

债券投资		111,581,837.69	150,128,379.68
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.3	100,010,978.15	39,991,299.49
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		50,028,664.39	18,601.01
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		363,901,713.85	352,711,040.70
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
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		93,571.24	97,050.97
应付托管费		18,714.23	19,410.18
应付销售服务费		74,856.92	77,640.74

应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,951.74	6,448.63
应付利润		1,554,645.37	1,347,202.56
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.4	137,155.45	234,321.56
负债合计		1,883,894.95	1,782,074.64
净资产：			
实收基金	6.4.7.5	362,017,818.90	350,928,966.06
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.6	-	-
净资产合计		362,017,818.90	350,928,966.06
负债和净资产总计		363,901,713.85	352,711,040.70

6.2 利润表

会计主体：万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日
一、营业总收入		4,278,511.27
1.利息收入		2,934,266.91
其中：存款利息收入	6.4.7.7	1,751,326.73
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		1,182,940.18
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,344,158.87
其中：股票投资收益		-

基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.8	1,344,158.87
资产支持证券投资 收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
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)		-
4.汇兑收益(损失以“-” 号填列)		-
5.其他收入(损失以“-” 号填列)	6.4.7.9	85.49
减：二、营业总支出		1,254,779.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	575,480.26
2. 托管费	6.4.10.2.2	115,096.06
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	460,384.00
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产 支出		-
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		3,333.15
8. 其他费用	6.4.7.10	100,486.23
三、利润总额(亏损总额 以“-”号填列)		3,023,731.57
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”		3,023,731.57

号填列)		
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		3,023,731.57

注：本集合计划合同生效日为2022年7月22日，因此无上年度可比期间数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023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）	350,928,966.06	-	-	350,928,966.06
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）	350,928,966.06	-	-	350,928,966.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	11,088,852.84	-	-	11,088,852.84
（一）、综合收益总额	-	-	3,023,731.57	3,023,731.57
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减	11,088,852.84	-	-	11,088,852.84

少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	5,067,999,864.74	-	-	5,067,999,864.74
2.基金赎回款	-5,056,911,011.90	-	-	-5,056,911,011.90
(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)	-	-	-3,023,731.57	-3,023,731.57
(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)	362,017,818.90	-	-	362,017,818.90

注：本集合计划合同生效日为2022年7月22日，因此无上期可比数据。

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：

黄伟

肖云

钟晖霖

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

万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划（以下简称“集合计划”或“本集合计划”）由万联证券万年红天添利集合资产管理计划变更而来。

万联证券万年红天添利集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划，自2013年5月10日起开始募集，于2013年5月28日结束募集工作，并于2013年5月29日成立。2013年5月31日，万联证券万年红天添利集合资产管理计划取得《关于万联证券有限责任公司发起设立万联证券万年红天添利集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函[2013]547号）。

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，管理人与托管人中国证券登记结算有限责任公司协商一致，开展了本产品的合同变更工作，并取得中国证监会证券基金机构监管部《关于准予万联证券万年红天添利集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2022]507号）。

2022年6月24日，管理人于官网发布《关于万联证券万年红天添利集合资产管理计划变更为万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划及其法律文件变更的公告》，并按照《万联证券万年红天添利集合资产管理计划集合资产管理合同》有关约定履行法律文件变更程序。合同变更自2022年7月22日起生效。存续期限自资产管理合同生效之日起3年，期限届满后，按照中国证监会有关规定执行。

本集合计划投资范围为：法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在1年以内（含1年）的银行存款、中央银行票据、同业存单，期限在1个月以内的债券回购，剩余期限在397天以内（含397天）的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券以及中国证监会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集合计划投资其他品种，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为了供本集合计划管理人、托管人和全体持有人使用，由万联证券股份有限公司管理层按照资产管理合同的有关规定编制。

除本集合计划所拥有的各类证券和其它投资的分类、初始确认及后续计量的会计政策执行资产管理合同的有关规定外(具体参见附注6.4.4.3、6.4.4.4及6.4.4.5)，本集合计划按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制，同时在财务报表编制、具体会计核算和信息披露方面也参考了财政部、中国证监会及中国证券投资基金业协会发布的关于证券投资基金财务报表编制的有关规定。

本集合计划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

本财务报表按照附注6.4.2所述的编制基础编制，真实、完整地反映了本集合计划2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023年6月30日的经营成果和集合计划资产变动情况等有关信息。

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。

6.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本会计期间为2023年1月1日至2023年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本集合计划以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本集合计划的业务特点和风险管理要求，本集合计划将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和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当期损益的金融资产包括债券投资，以交易性金融资产列示。

本集合计划持有的各类应收款项、买入返售金融资产等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分类为以摊余成本计量的金融资产。

(2) 金融负债的分类

根据本集合计划的业务特点和风险管理要求，本集合计划将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

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于本集合计划成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。

(1) 交易性金融资产

(1) 债券投资

买入债券于交易日按应付或实际支付的全部价款(不含应收利息)入账，相关交易费用直接计入债券投资的初始成本。

买入央行票据和零息债券等贴现债券，于交易日按应付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入债券投资的初始成本。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

债券投资持有期间，基于实际利率法计提的债券投资的利息，直接计入到债券投资的账面余额当中。

(2) 买入返售金融资产

买入返售金融资产

买入返售金融资产为本集合计划按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产持有期间，基于实际利率法计提的买入返售金融资产的利息，直接计入到买入返售金融资产的账面余额当中。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始确认金额。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

（3）其他金融负债

卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本集合计划按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始确认金额。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

（4）满足下列条件之一的金融资产，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，虽然本集合计划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。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划所拥有的各类证券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债采用“摊余成本法”进行暂估收益,即计价对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内按实际利率法摊销,每日计提损益。本集合计划不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算集合计划资产净值。具体如下:

（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。

为了避免采用“摊余成本法”计算的集合计划资产净值与按市场利率和交易市价计算的集合计划资产净值发生重大偏离，从而对集合计划份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，管理人于每一估值日，采用估值技术，对集合计划持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“影子定价”确定的集合计划资产净值与“摊余成本法”计算的集合计划资产净值的负偏离度绝对值达到0.25%时，管理人应当在5个工作日内将

负偏离度绝对值调整到0.25%以内。当正偏离度绝对值达到0.5%时，管理人应当暂停接受申购并在5个交易日内将正偏离度绝对值调整到0.5%以内。当负偏离度绝对值达到0.5%时，管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.5%时，管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止资产管理合同进行财产清算等措施。

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，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本集合计划具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本集合计划计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收资金为对外发行集合计划份额所对应的金额。申购、赎回及红利再投资等引起的实收集合计划的变动分别于上述各交易确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回及红利再投资等事项导致集合计划份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占集合计划净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于集合计划申购确认日或赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）利息收入

①存款利息收入，存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

②买入返售金融资产利息收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

（2）投资收益

交易性金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

①债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

②本集合计划持有的付息债券、贴现债券按摊余成本和实际利率计算确认投资收益。

(3) 公允价值变动损益

公允价值变动损益为收益以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；
- (2) 本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.05% 的年费率逐日计提；
- (3) 本集合计划的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；
- (4) 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本集合计划采用 1.00 元固定份额净值交易方式，自资产管理合同生效日起，本集合计划份额采用“每日预提、按季支付”的方式，即本集合计划根据每日暂估收益情况，以每万份暂估净收益为基准，为投资人每日计算预提当日收益，每季进行支付；

(2) 在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下，本集合计划收益每季度支付一次。本集合计划每季对上季实现的收益进行收益结转(如遇节假日顺延)，每个分红期截止日起两个交易日内，管理人公告收益分配方案，并按照法律法规、监管规定及资产管理合同约定向投资人进行支付；

(3) 本集合计划每一份额享有同等收益分配权；

(4) 当日申购的集合计划份额自下一个交易日起，享有集合计划的收益计算预提权益；当日赎回的集合计划份额自下一个交易日起，不享有集合计划的收益计算预提权益；

(5) 如果投资人在收益季度支付前解约自动申购、赎回等相关服务，则管理人在最近的收益季度支付时对该投资人持有的集合计划份额对应的收益部分按累计未结转收益进行支付；

(6) 本集合计划根据每日暂估收益情况，将当日收益计算预提，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。

(7) 在收益季度支付时, 如投资人的累计未结转收益为正, 则为份额持有人支付相应现金; 如投资人的累计未结转收益为负, 则为份额持有人缩减相应的集合计划份额, 遇投资人剩余集合计划份额不足以扣减的情形, 管理人将根据内部应急机制保障集合计划平稳运行。

6.4.5 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

本集合计划本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及财税[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》, 自2018年1月1日起, 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。

此外, 由于财政部、国家税务总局目前尚未对证券公司集合资产管理计划公布专门的印花税及企业所得税政策, 因此, 本集合计划参照以下税收政策执行:

根据财政部和国家税务总局财税[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9月18日《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》及其他相关税务法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 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。

(2) 对于基金从事A股买卖, 出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方不再缴纳印花税。

(3) 本计划的城市维护建设税、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	
	2023年06月30日	
活期存款	95,372,396.32	
等于：本金	95,289,414.37	
加：应计利息	82,981.95	
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	95,372,396.32	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		2023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	20,711,246.77	20,708,727.39	-2,519.38	-0.0007
	银行间市场	90,870,590.92	90,899,881.73	29,290.81	0.0081
	合计	111,581,837.69	111,608,609.12	26,771.43	0.0074
资产支持证券		-	-	-	-
合计		111,581,837.69	111,608,609.12	26,771.43	0.0074

6.4.7.3 买入返售金融资产**6.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	100,010,978.15	-
银行间市场	-	-
合计	100,010,978.15	-

6.4.7.4 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	64,975.00
其中：交易所市场	63,700.00
银行间市场	1,275.00
应付利息	-
预提费用	72,180.45
合计	137,155.45

6.4.7.5 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	350,928,966.06	350,928,966.06
本期申购	5,067,999,864.74	5,067,999,864.74
本期赎回（以“-”号填列）	-5,056,911,011.90	-5,056,911,011.90
本期末	362,017,818.90	362,017,818.90

6.4.7.6 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
本期期初	-	-	-
本期利润	3,023,731.57	-	3,023,731.57
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	-3,023,731.57	-	-3,023,731.57
本期末	-	-	-

6.4.7.7 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	1,659,110.18
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	91,874.77
其他	341.78
合计	1,751,326.73

6.4.7.8 债券投资收益**6.4.7.8.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	1,367,047.92
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-22,889.05

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	1,344,158.87

6.4.7.8.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	220,718,160.96
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	216,029,139.05
减：应计利息总额	4,711,910.96
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-22,889.05

6.4.7.9 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	-
其他	85.49
合计	85.49

6.4.7.10 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	9,173.08
信息披露费	59,507.37

汇划手续费	10,005.78
帐户维护费	21,000.00
其他	800.00
合计	100,486.23

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，本集合计划并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

资产负债表日至本报告批准报出日，本集合计划于2023年7月11日向份额持有人支付收益1,525,413.04元。

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

本报告期管理人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，具体为新增管理人直接或间接控制的企业：万联证券资产管理（广东）有限公司。

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
万联证券股份有限公司	集合计划管理人
中国证券登记结算有限责任公司	集合计划托管人

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

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内无股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本集合计划本报告期内无权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
万联证券股份有限公司	25,572,521.23	100.00%

(注：债券交易成交金额为含息金额)

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 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
万联证券股份有限公司	11,950,000,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
万联证券股份有限公司	141,500.00	100.00%	63,700.00	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

	2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	575,480.26
其中：支付销售机构的客户维护费	-

(1) 管理费的计提方法

资产管理产品的管理人收取管理人报酬的，资产管理产品应当按照权责发生制原则，在管理人提供相关服务的期间，将当期发生的管理人报酬计入当期损益。

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.25% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div 365$$

其中：

H 为每日应计提的管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

(2) 管理费支付

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一致后，由托管人于次月首日起 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 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	115,096.06

(1) 托管费的计提方法

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。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div 365$$

其中：

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

(2) 托管费支付

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一致后，由托管人于次月首日起 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给托管人。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
	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
万联证券股份有限公司	460,384.00
合计	460,384.00

(1) 销售服务费的计提方法

本集合计划的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：

$$H = E \times 0.20\% \div 365$$

其中：

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

(2) 销售管理费支付

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一致后，由托管人于次月首日起 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，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

报告期内本集合计划没有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**

本报告期内管理人无运用固有资金投资本集合计划的情况。

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

报告期末无除基金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	本期

称	2023年01月01日至2023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	95,372,396.32	1,659,110.18

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

报告期内本集合计划无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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
-	-	3,023,731.57	3,023,731.57	-

本集合计划收益每日预提、按季支付，现金分红。在收益发放时，本集合计划红利发放日为收益累计期间末的下一个工作日，其利润通过赎回款发放给投资者，不存在通过应付赎回款转出的情况。

6.4.12 期末（2023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

本集合计划期末未持有暂时停牌等流通受限证券。

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

本集合计划本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

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

本集合计划管理人奉行全面风险管理的理念，坚持“全员风控”原则，高度重视业务开展与风险管理工作同步发展，建立了从上至下的风险管理架构，包括：董事会及下设风险控制委员会、经营班子及下设资产管理业务风险管理委员会、风险管理监督部门、资产管理相关部门的四层级架构。通过建立信息沟通机制，从事前、事中、事后全面进行业务风险管理。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，对本集合计划资产造成损失的风险。为了防范信用风险，本集合计划主要投资于信用等级较高的证券等投资品种，建立内部信用风险评估体系，且通过分散化投资以分散信用风险。

本集合计划在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	80,609,243.71	-
合计	80,609,243.71	-

注：未评级债券为超短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
--------	--------------------	---------------------

AAA	30,972,593.98	150,128,379.68
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	30,972,593.98	150,128,379.68

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或集合计划无法应付集合计划赎回支付的要求所引起的风险。集合计划坚持组合持有、分散投资的原则，在一定程度上减轻了投资变现压力。集合计划所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，本集合计划未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

委托人在集合计划开放日可以办理参与本集合计划的业务，开放日为上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日时间。本集合计划管理人在对市场特征和发展形势等方面进行分析和判断的基础上，结合集合计划运行情况制订本集合计划的风险控制目标和方法，监控各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控。

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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的部门和岗位对流动性指标进行持续的监测和分析。

同时，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，严格管控逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除本报告“持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。本集合计划高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致本集合计划收益水平变化而产生的风险，反映了本集合计划资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。本集合计划的市场风险主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本集合计划管理人通过建立以基点价值为基础、以敏感性分析为工具的风险管理体系，对利率风险进行持续的跟踪和分析，以对该风险进行有效地管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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						
银行存款	95,372,396.32	-	-	-	-	95,372,396.32
结算备付金	6,903,105.00	-	-	-	-	6,903,105.00
存出保证金	4,732.30	-	-	-	-	4,732.30
交易性金融资产	111,581,837.69	-	-	-	-	111,581,837.69
买入返售金融资产	100,010,978.15	-	-	-	-	100,010,978.15
应收清算款	-	-	-	-	50,028,664.39	50,028,664.39
资产总计	313,873,049.46	-	-	-	50,028,664.39	363,901,713.85
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	93,571.24	93,571.24
应付托管费	-	-	-	-	18,714.23	18,714.23
应付销售服务费	-	-	-	-	74,856.92	74,856.92
应交税费	-	-	-	-	4,951.74	4,951.74
应付利润	-	-	-	-	1,554,645.37	1,554,645.37
其他负债	-	-	-	-	137,155.45	137,155.45
负债总计	-	-	-	-	1,883,894.95	1,883,894.95
利率敏感度缺口	313,873,049.46	-	-	-	48,144,769.44	362,017,818.90

上年度末 2022年1 2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						
银行存款	151,891,598.72	-	-	-	-	151,891,598.72
结算备付金	10,596,151.58	-	-	-	-	10,596,151.58
存出保证金	85,010.22	-	-	-	-	85,010.22
交易性金融资产	139,763,199.43	10,365,180.25	-	-	-	150,128,379.68
买入返售金融资产	39,991,299.49	-	-	-	-	39,991,299.49
应收清算款	-	-	-	-	18,601.01	18,601.01
资产总计	342,327,259.44	10,365,180.25	-	-	18,601.01	352,711,040.70
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	97,050.97	97,050.97
应付托管费	-	-	-	-	19,410.18	19,410.18
应付销售服务费	-	-	-	-	77,640.74	77,640.74
应交税费	-	-	-	-	6,448.63	6,448.63
应付利润	-	-	-	-	1,347,202.56	1,347,202.56
其他负债	-	-	-	-	234,321.56	234,321.56
负债总计	-	-	-	-	1,782,074.64	1,782,074.64
利率敏感度缺口	342,327,259.44	10,365,180.25	-	-	-1,763,473.63	350,928,966.06

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的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	上年度末

		2023年06月30日	2022年12月31日
	市场利率上升25个基点	-43,000.91	-124,092.67
	市场利率下降25个基点	43,050.21	124,318.34

本集合计划采取合同约定的估值方式进行估值。同时，为有效管理利率风险，也定期对本集合计划的公允价值进行评估。本报告期内，该利率风险管理机制有效。根据测算数据，本期末，若其他市场变量保持不变，市场利率上升或下降25个基点，对本集合计划资产净值无重大影响。

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。本基金主要投资于具有良好流动性的货币市场工具，不投资股票、权证等其他交易性金融资产。因此，无重大其他价格风险。

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 2023年06月30日		上年度末 2022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	111,581,837.69	30.82	150,128,379.68	42.78
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	111,581,837.69	30.82	150,128,379.68	42.78

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	111,581,837.69	150,128,379.68
第三层次	-	-
合计	111,581,837.69	150,128,379.68

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划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

报告期末，本集合计划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，其账面价值接近于公允价值。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

除公允价值外，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	111,581,837.69	30.66
	其中：债券	111,581,837.69	30.66
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	100,010,978.15	27.48
	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	102,275,501.32	28.11
4	其他各项资产	50,033,396.69	13.75
5	合计	363,901,713.85	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	-	
	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：本报告期本集合计划未进行债券正回购交易。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内无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	18
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	44
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	9

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限未发生超过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	77.96	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	11.05	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	2.77	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	5.52	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	2.77	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.07	-

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

本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过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	20,711,246.77	5.72
5	企业短期融资券	80,609,243.71	22.27
6	中期票据	10,261,347.21	2.83
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	111,581,837.69	30.82
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	012284354	22电网SCP022	200,000	20,230,552.90	5.59
2	012380384	23中化股SCP003	200,000	20,173,775.07	5.57
3	112729	18申宏02	100,000	10,470,735.98	2.89
4	102002066	20汇金MTN010A	100,000	10,261,347.21	2.83
5	188773	21华电05	100,000	10,240,510.79	2.83
6	012380354	23电网SCP002	100,000	10,081,743.69	2.78

7	012381540	23中化股SCP0 13	100,000	10,045,138.54	2.77
8	012381422	23上海机场SC P005	100,000	10,041,750.33	2.77
9	012381607	23南电SCP008	100,000	10,036,283.18	2.77

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	0.0093%
报告期内偏离度的最低值	-0.0737%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0235%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本集合计划未发生负偏离度的绝对值达到0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内本集合计划未发生正偏离度的绝对值达到0.5%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

1、本集合计划估值采用“摊余成本法”进行暂估收益，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益。本集合计划不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算集合计划资产净值。具体如下：

(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。

2、为了避免采用“摊余成本法”计算的集合计划资产净值与按市场利率和交易市价计算的集合计划资产净值发生重大偏离，从而对集合计划份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，管理人于每一估值日，采用估值技术，对集合计划持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“影子定价”确定的集合计划资产净值与“摊余成本法”计算的集合计划资产净值的负偏离度绝对值达到0.25%时，管理人应当在5个交易日内将负偏离度绝对值调整到0.25%以内。当正偏离度绝对值达到0.5%时，管理人应当暂停接受申购并在5个交易日内将正偏离度绝对值调整到0.5%以内。当负偏离度绝对值达到0.5%时，管理人应当使用风险准备金或者自有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.5%时，管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止资产管理合同进行财产清算等措施。

3、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，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

5、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.9.2 本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，在报告编制日前一年内，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。

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	4,732.30
2	应收清算款	50,028,664.39
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	50,033,396.69

7.9.4 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。

§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
3,118	116,105.78	297,351.44	0.08%	361,720,467.46	99.92%

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	11,920,726.24	3.29%
2	个人	8,116,584.18	2.24%
3	个人	8,077,616.89	2.23%
4	个人	6,704,260.27	1.85%
5	个人	6,059,056.46	1.67%
6	个人	5,458,140.43	1.51%
7	个人	5,192,104.34	1.43%
8	个人	3,999,800.53	1.10%
9	个人	3,749,390.35	1.04%
10	个人	2,751,889.55	0.76%

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	871,345.63	0.24%

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07月22日)基金份额总额	612,783,066.15
本报告期期初基金份额总额	350,928,966.06
本报告期基金总申购份额	5,067,999,864.74
减：本报告期基金总赎回份额	5,056,911,011.90
本报告期期末基金份额总额	362,017,818.90

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本集合计划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

报告期内，本集合计划管理人于2023年1月31日发布公告，自2023年1月20日起魏智敏先生担任万联证券股份有限公司副总裁；于2023年2月23日发布公告，自2023年2月17日起刘康莉女士担任万联证券股份有限公司总裁助理，罗钦城先生不再担任万联证券股份有限公司常务副总裁；于2023年3月24日发布公告，自2023年3月21日起张毅峰先生代任万联证券股份有限公司总裁，王耀南女士不再担任万联证券股份有限公司总裁，罗钦城先生不再担任万联证券股份有限公司首席信息官，韦罡先生不再担任万联证券股份有限公司总裁助理；于2023年4月11日发布公告，自2023年4月3日起陈卓权先生担任万联证券股份有限公司首席信息官。

报告期内，本集合计划管理人于2023年3月24日发布公告，公司董事变更情况下：

公司于2023年3月进行董事会换届选举。经2023年度第一次临时股东大会、第四届第一次职工代表大会选举，王达、梁伟健、钟雄、陈宏威、邬斌、黄秀梅、展凯、杨子晖、夏明会、李爱荣、李志坚、李莉等12人组成公司第三届董事会。第二届董事会成员王耀南女士、罗钦城先生、刘平先生、李俊华先生、张放先生、刘世验先生不再担任公司董事，李志明先生、姜永宏先生、彭燎原先生不再担任公司独立董事。

报告期内，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

本集合计划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

本集合计划本报告期内会计师事务所为中审众环会计师事务所（特殊普通合伙），未改聘会计师事务所。本报告期间预提的审计费用为9173.08元人民币。

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

本报告期内管理人及其高级管理人员未有受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员未有受稽查或处罚的情况。

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	
万联证券	2	-	-	141,500.00	100.00%	-

注：（1）此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、债券等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

（2）本集合计划选用管理人自身拥有的交易单元。

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
万联证券	25,572,521.23	100.00%	11,950,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本集合计划本报告期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	万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划收益支付公告	公司官网、证监会指定网站、中国证券报	2023-01-12
2	万联证券股份有限公司旗下部分集合资产管理计划季度报告提示性公告（万联天添利货币）	中国证券报	2023-01-20
3	万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划2022年第4季度报告	公司官网、证监会指定网站	2023-01-20
4	万联证券股份有限公司高级管理人员变更公告	公司官网、证监会指定网站、中国证券报	2023-01-31
5	万联证券股份有限公司高级管理人员变更公告	公司官网、证监会指定网站、中国证券报	2023-02-23
6	万联证券股份有限公司高级管理人员变更公告	公司官网、证监会指定网站	2023-03-24
7	万联证券股份有限公司关于董事变更公告	公司官网、证监会指定网站	2023-03-24
8	万联证券股份有限公司关于董事变更公告	中国证券报	2023-03-27
9	万联证券股份有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报	2023-03-27

10	万联证券股份有限公司旗下部分集合资产管理计划年度报告提示性公告（万联天添利货币）	中国证券报	2023-03-31
11	万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划2022年年度报告	公司官网、证监会指定网站	2023-03-31
12	万联证券股份有限公司高级管理人员变更公告	公司官网、证监会指定网站、中国证券报	2023-04-11
13	万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划收益支付公告	公司官网、证监会指定网站、中国证券报	2023-04-12
14	万联证券股份有限公司旗下部分集合资产管理计划季度报告提示性公告（万联天添利货币）	中国证券报	2023-04-21
15	万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划2023年第1季度报告	公司官网、证监会指定网站	2023-04-21
16	关于万联证券股份有限公司管理的集合资产管理计划拟变更管理人的提示性公告	公司官网、证监会指定网站、中国证券报	2023-05-26

§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未出现单一投资者持有集合计划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

本报告期内，本集合计划没有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、万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划合同
- 2、万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划托管协议
- 3、万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划招募说明书
- 4、管理人业务资格批件、营业执照
- 5、万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19楼。

12.3 查阅方式

投资者可到管理人的办公场所或管理人网站免费查阅。投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。咨询电话：95322。公司网址：www.wlzq.com.cn

万联证券股份有限公司
二〇二三年八月一日