

万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:万联证券资产管理(广东)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 03 月 28 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。本年度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2024年2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。

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。

本报告中财务资料已经审计。中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023年1月1日起至12月31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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 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.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 审计报告.....	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表.....	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	19
7.3 净资产变动表.....	20
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告.....	46
8.1 期末基金资产组合情况.....	46
8.2 债券回购融资情况.....	46
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	47
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
8.6 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.....	48
8.7 “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.....	49
8.8 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.....	49

8.9 投资组合报告附注	49
§9 基金份额持有人信息	51
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	51
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
9.4 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	52
§10 开放式基金份额变动	52
§11 重大事件揭示	52
11.1 基金份额持有人大会决议	52
11.2 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	52
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
11.4 基金投资策略的改变	53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	54
11.9 其他重大事件	54
§12 影响投资者决策的其他重要信息	58
12.1 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	58
§13 备查文件目录	58
13.1 备查文件目录	58
13.2 存放地点	58
13.3 查阅方式	58

§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	万联证券资产管理（广东）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	285,892,591.77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	万联证券资产管理（广东）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		广州市南沙区金隆路37号405房	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8楼	北京市西城区锦什坊街26号
邮政编码		510623	100033
法定代表人		李晔	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.wlzqzg.com
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座8楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)	湖北省武汉市武昌区中北路166号长江产业大厦17-18层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2023年	2022年07月22日(基金合同)
---------------	-------	-------------------

		生效日)-2022年12月31日
本期已实现收益	5,950,132.03	2,360,188.93
本期利润	5,950,132.03	2,360,188.93
本期净值收益率	1.3911%	0.5163%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末	2022年末
期末基金资产净值	285,892,591.77	350,928,966.06
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2023年末	2022年末
累计净值收益率	1.9075%	0.5163%

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

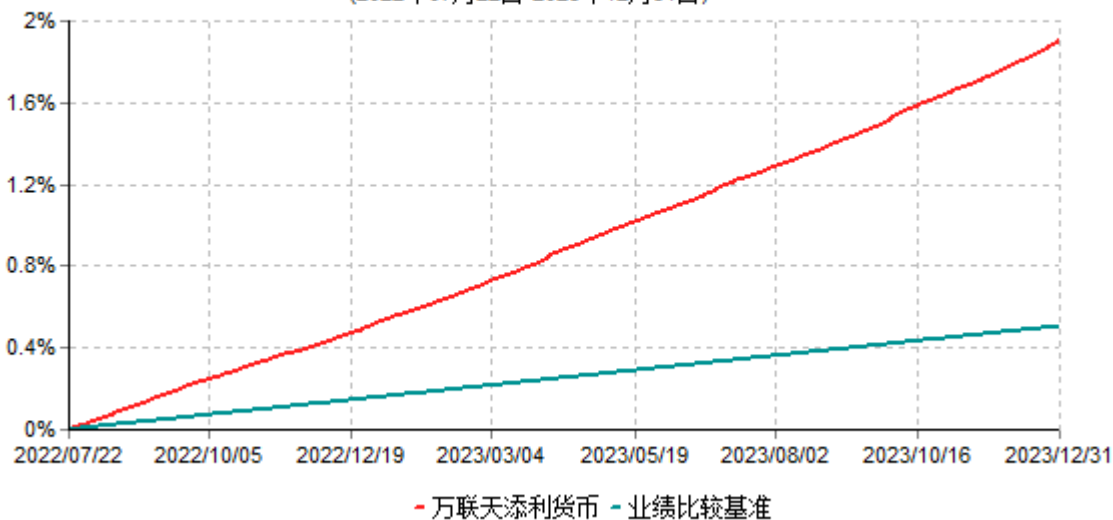
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.3947%	0.0008%	0.0882%	0.0000%	0.3065%	0.0008%
过去六个月	0.7368%	0.0008%	0.1764%	0.0000%	0.5604%	0.0008%
过去一年	1.3911%	0.0008%	0.3500%	0.0000%	1.0411%	0.0008%
自基金合同生效起至今	1.9075%	0.0008%	0.5063%	0.0000%	1.4012%	0.0008%

注：本集合计划收益每日预提、按季支付。

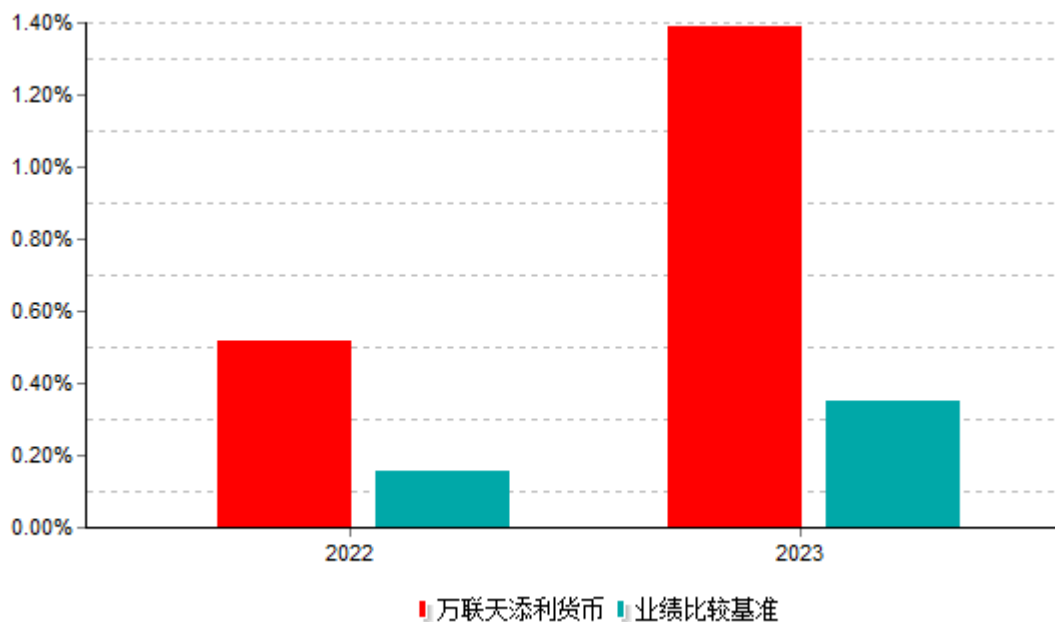
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

万联证券万年红天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07月22日-2023年12月31日)



注：集合计划合同生效日为2022年7月22日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：集合计划合同生效日为2022年7月22日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	已按再投资	直接通过应	应付利润本	年度利润分	备注

	形式转实收 基金	付赎回款转 出金额	年变动	配合计	
2023年	-	-	5,950,132.03	5,950,132.03	-
2022年	-	-	2,360,188.93	2,360,188.93	-
合计	-	-	8,310,320.96	8,310,320.96	-

注：（1）集合计划合同生效日为2022年7月22日。（2）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。

§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。从2023年8月18日起，本集合计划管理人由“万联证券股份有限公司”变更为“万联证券资产管理（广东）有限公司”。万联证券资产管理（广东）有限公司由万联证券股份有限公司独资设立，主要从事资产管理业务。万联资管于2023年2月1日成立，注册资本5亿元。

截至2023年12月31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	基金经理	2022- 07-22	-	6年	英国南安普顿大学管理学硕士，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。
吴永清	基金经理	2023-11-10	-	5年	中国政法大学管理学硕士，具有5年债券从业经历，历任万联证券资管投资部研究员、资管投资部交易员。已取得基金从业资格，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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，建立了公平交易相关的制度。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人严格执行《万联证券资产管理（广东）有限公司公平交易管理规定》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。

4.3.3 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年经济表现可以概括为：顶住外部压力、克服内部困难，着力扩大内需、优化结构、提振信心、防范化解风险，我国经济回升向好。疫情冲击之后经济表现的疲软主要是受疫情对生产、消费等经济活动的制约。“先立后破”或代表着政策的制定更重视战略性缓解中长期矛盾的“迫切性”。在“加强逆周期和跨周期调节”的要求下，逆周期及跨周期调节力度加码或将成为主线。在地方债务风险可控的前提下，财政支出将延续加力并注重政策效能的提升。

全年流动性方面，资金供给因素对流动性的影响愈发重要，资金波动的主要来源是银行负债缺口的扩大，而影响银行资产负债表的主要因素：一是信贷投放，二是政府债供给。一季度银行信贷投放加快，相应减少在回购市场的资金融出，对应相对较高的资金利率。而进入二季度，在经济数据基数较低背景下，信贷投放和政府债发行均放缓，资金面回归自发式平衡状态，资金面宽松一直延续至8月中旬。从8月开始，政府债发行加快，缴款吸收市场流动性，资金利率再度收敛，DR007中枢开始持续高于7天逆回购利率。信贷投放和政府债供给节奏的组合，使得全年资金利率呈现收敛-转松-再收敛的态势。

利率债方面，2023年债券市场的主要交易逻辑围绕着经济修复进程以及政策预期而展开，伴随着经济基本面改善进程放缓以及预期的变化调整，10Y国债收益率在年内呈现M型走势。第一阶段：年初到2月末，市场对疫后经济复苏具有较强预期，叠加信贷投放加快对资金面带来的压力，长债利率有所上行并高位震荡。第二阶段：3月初到8月中下旬，经济基本面弱现实，叠加降息降准等宽货币举措，长债利率重回下行趋势。第三阶段：8月中下旬至11月末，“防空转”叠加财政发力、政府债供给放量，资金面偏紧，利率回升。第四阶段：11月末至年底，稳增长政策力度被市场预期逐步消化，宽货币信号及预期较强，10年期国债收益率在年末下行至2.57%左右。

信用债方面，2023年的信用债市场整体处于牛市环境，理财赎回负反馈逐渐缓解后，再迎“资产荒”的持续演绎，传统信用债和以银行二永债为主的金融次级债皆受到市场追逐，信用债收益率中枢明显下行。上半年，信用债市场经历了去年底超跌后的利差修复以及基本面转弱下跟随利率债走强。下半年，在“一揽子化债方案”提出之后，随着特殊再融资债等化债政策逐步落地，城投债的尾部风险系统性下降，市场情绪高涨，城投债的抢筹行情延伸至产业债和二永债等，信用利差、评级利差、期限利差几乎全面收敛。

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1.3911%，同期业绩比较基准收益率为0.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中央政治局会议对2024年的定调是：“以进促稳、先立后破”，财政政策“适度加力、提质增效”，货币政策“灵活适度、精准有效”。预计宏观政策力度继续偏积极，经济增速在2023年基础上仍会设定一个相对不低的目标；财政政策方面赤字率、专项债、再融资债券规模大概率都有所抬升，“先立后破”或表明地方债务化解仍然是政策主线，导致提升的赤字规模主要是防范债务风险，而非基建刺激投入，从而限制了其对经济拉动的想象空间。“要增强宏观政策取向一致性”指向货币政策会做好配合，总量工具还有空间，出现流动性转向的风险相对有限，不过从最近央行以及人大对当前金融工作的表态看，监管层抑制资金空转、加快金融服务实体决心较为坚定，当前这种流动性分层、贵而不紧的局面可能持续，导致杠杆息差空间收窄。

对于债市而言，长期经济增长预期重塑的宏观大背景使得这轮债券牛市周期被动拉长，谈论牛熊拐点可能为时尚早，当前极平的曲线使得短端性价比凸显，维持中短久期、中低杠杆水平的投资策略。信用债方面，城投债供给收缩大趋势下，不同期限之间的信用利差分化仍将持续，短久期城投债利差或继续处于历史偏低水平，中长端利差相对更高，且视不同区域、不同主体资质分化会加大，优质资产利差还有压缩空间，尾部城投利差在明年下半年可能有利差走扩风险。

利率债方面，2024年地方政府债券和特别国债的发行依然需要低利率环境支撑，因而债市仍处于友好环境，央行仍有降准、降息的可能性，资金利率水平将会维持低位，整体上行风险也相对有限，可以根据市场情况适当介入，以短线波段操作为主。

信用债方面，2023年城投债走出牛市行情，在政治局会议提出的一揽子化债方案支持下，机构对于化债政策落地弱区域的预期带动了利差压缩行情，机构资金的涌入使得各地区城投债收益率扁平化。当前短端收益率逼仄，但仍有短久期债券可供投资者挖掘

票息收益。整体而言，未来短期内仍旧以防守为主线，配置中短久期为主，减少期限错配，降低利率风险。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，管理人本着诚实信用、勤勉尽责和保障持有人利益的原则，持续加强合规管理和监察稽核工作。一是建立完备的制度体系，涵盖内控治理、投资管理、研究、集中交易、产品研发、信息技术、运营管理、内部控制、法律合规、风险管理、销售适当性等业务范围，规范工作流程。二是通过开展定期和不定期的各项合规检查、稽核检查对业务进行持续的监督规范。三是通过政策宣导、合规培训、合规咨询、合规审查、合规考核等方式，有效防控合规风险。四是落实信息披露法规要求，依法合规开展信息披露工作。报告期内，本集合计划的投资运作符合国家相关法律法规、监管部门的有关规定以及公司相关制度的规定。管理人高度重视反洗钱相关工作，参考同业先进经验，积极主动的采取有效措施防控洗钱风险。本集合计划报告期内未发现存在重大异常交易、利益输送、内幕交易及其他有损投资者利益的情形。

4.7 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。运营保障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。

4.8 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4次收益集中支付，采用现金分红的方式支付收益5,761,091.88元。

4.9 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 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	众环审字(2024)0500134号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划全体持有人
审计意见	我们审计了由万联证券资产管理（广东）有限公司担任管理人（以下简称“管理人”）的万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划（以下简

	<p>称"万年红天添利")财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表,2023年度的利润表和净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照财务报表附注2所述编制基础编制,公允反映了万年红天添利2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于万年红天添利管理人,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>强调事项</p>	<p>-</p>
<p>其他事项</p>	<p>-</p>
<p>其他信息</p>	<p>万年红天添利管理人对其他信息负责。我们在审计报告日前已获取的其他信息包括万年红天添利2023年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>万年红天添利管理人负责按照附注7.4.2所述编制基础编制财务报表(包括确定在具体情况下按照附注7.4.2所述编制基础编制财务报表的可接受性),使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊</p>

	<p>或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，万年红天添利管理人负责评估万年红天添利的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非万年红天添利管理人计划清算万年红天添利、终止运营或别无其他现实的选择。万年红天添利管理人治理层负责监督万年红天添利的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价万年红天添利管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对万年红天添利管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对万年红天添利持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披</p>

	露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致万年红天添利不能持续经营。（五）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。	
会计师事务所的名称	中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王兵	唐小琴
会计师事务所的地址	湖北省武汉市武昌区中北路166号长江产业大厦17-18层	
审计报告日期	2024-02-28	

§7 年度财务报表

7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	45,225,594.91	151,891,598.72
结算备付金		6,139,401.18	10,596,151.58
存出保证金		31,185.84	85,010.22
交易性金融资产	7.4.7.2	156,314,639.38	150,128,379.68
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		156,314,639.38	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	7.4.7.3	20,012,707.92	39,991,299.49
应收清算款		60,061,680.81	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		287,785,210.04	352,711,040.70
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末
		2023年12月31日	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		78,675.61	97,050.97
应付托管费		15,735.11	19,410.18
应付销售服务费		62,940.41	77,640.74
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,455.02	6,448.63
应付利润		1,536,242.71	1,347,202.56
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.4	194,569.41	234,321.56
负债合计		1,892,618.27	1,782,074.64
净资产：			
实收基金	7.4.7.5	285,892,591.77	350,928,966.06
未分配利润	7.4.7.6	-	-
净资产合计		285,892,591.77	350,928,966.06
负债和净资产总计		287,785,210.04	352,711,040.70

7.2 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12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年07月22日(基 金合同生效日)至2 022年12月31日
一、营业总收入		8,331,139.34	3,574,196.04
1.利息收入		5,299,521.79	2,099,993.92
其中：存款利息收入	7.4.7.7	3,185,669.34	1,676,557.00
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		2,113,852.45	423,436.92
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		3,031,532.06	1,474,202.12
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.8	3,031,532.06	1,474,202.12
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		-	-
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）	7.4.7.9	85.49	-
减：二、营业总支出		2,381,007.31	1,214,007.11
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	1,085,875.08	511,175.72
2.托管费	7.4.10.2.2	217,175.08	102,235.18
3.销售服务费	7.4.10.2.3	868,699.85	408,940.61
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		8,367.15	3,346.39
8.其他费用	7.4.7.10	200,890.15	188,309.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,950,132.03	2,360,188.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,950,132.03	2,360,188.93
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,950,132.03	2,360,188.93

注：本集合计划合同生效日为2022年7月22日，本财务报表的上年度可比期间为2022年7月22日至2022年12月31日。

7.3 净资产变动表

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12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	350,928,966.06	-	350,928,966.06
二、本期期初净资产	350,928,966.06	-	350,928,966.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-65,036,374.29	-	-65,036,374.29
（一）、综合收益总额	-	5,950,132.03	5,950,132.03
（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）	-65,036,374.29	-	-65,036,374.29
其中：1.基金申购款	9,601,974,050.84	-	9,601,974,050.84
2.基金赎回款	-9,667,010,425.13	-	-9,667,010,425.13
（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）	-	-5,950,132.03	-5,950,132.03
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	285,892,591.77	-	285,892,591.77
项目	上年度可比期间		
	2022年07月22日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	612,783,066.15	-	612,783,066.15

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-261,854,100.09	-	-261,854,100.09
（一）、综合收益总额	-	2,360,188.93	2,360,188.93
（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）	-261,854,100.09	-	-261,854,100.09
其中：1.基金申购款	3,769,682,892.52	-	3,769,682,892.52
2.基金赎回款	-4,031,536,992.61	-	-4,031,536,992.61
（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）	-	-2,360,188.93	-2,360,188.93
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	350,928,966.06	-	350,928,966.06

注：本集合计划合同生效日为2022年7月22日，本财务报表的上年度可比期间为2022年7月22日至2022年12月31日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

李晔

肖云

伍杨君

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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。

经过中国证券监督管理委员会《关于核准万联证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可〔2022〕2816号）核准，本计划管理人万联证券股份有限公司获准设立全资资产管理子公司，即“万联证券资产管理（广东）有限公司”。从2023年8月18日起，本计划管理人由“万联证券股份有限公司”变更为“万联证券资产管理（广东）有限公司”。该变更仅涉及计划管理人法人主体形式上的变更，并不涉及与投资者相关的合同项下权利、义务和责任的实质性变更。

7.4.2 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，由万联证券资产管理（广东）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7.4.4.3、7.4.4.4及7.4.4.5)，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。

7.4.3 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7.4.2所述的编制基础编制，真实、完整地反映了本集合计划2023年12月31日的财务状况以及2023年1月1日至2023年12月31日的经营成果和集合计划资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。本期会计年度为2023年1月1日至2023年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	45,225,594.91	151,891,598.72
等于：本金	45,196,742.04	151,820,010.34
加：应计利息	28,852.87	71,588.38
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	45,225,594.91	151,891,598.72

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023年12月31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	30,855,117.86	30,839,219.18	-15,898.68	-0.0056
	银行间市场	125,459,521.52	125,495,101.02	35,579.50	0.0124
	合计	156,314,639.38	156,334,320.20	19,680.82	0.0069
资产支持证券		-	-	-	-
合计		156,314,639.38	156,334,320.20	19,680.82	0.0069
项目		上年度末 2022年12月31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	150,128,379.68	149,799,216.45	-329,163.23	-0.0938
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	150,128,379.68	149,799,216.45	-329,163.23	-0.0938
资产支持证券		-	-	-	-
合计		150,128,379.68	149,799,216.45	-329,163.23	-0.0938

7.4.7.3 买入返售金融资产

7.4.7.3.1 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12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	20,012,707.92	-
银行间市场	-	-

合计	20,012,707.92	-
项目	上年度末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	39,991,299.49	-
银行间市场	-	-
合计	39,991,299.49	-

7.4.7.4 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付交易费用	52,569.41	62,321.56
其中：交易所市场	50,806.91	62,321.56
银行间市场	1,762.50	-
应付利息	-	-
预提费用	142,000.00	172,000.00
合计	194,569.41	234,321.56

7.4.7.5 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12月31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	9,601,974,050.84	9,601,974,050.84
本期赎回（以“-”号填列）	-9,667,010,425.13	-9,667,010,425.13
本期末	285,892,591.77	285,892,591.77

7.4.7.6 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
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	5,950,132.03	-	5,950,132.03
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	-5,950,132.03	-	-5,950,132.03
本期末	-	-	-

7.4.7.7 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年07月22日（基金合同生效 日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	3,029,653.11	1,635,268.75
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	155,488.55	40,801.99
其他	527.68	486.26
合计	3,185,669.34	1,676,557.00

7.4.7.8 债券投资收益

7.4.7.8.1 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2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年07月22日（基金合同生效 日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	3,054,421.10	1,533,877.06
债券投资收益——买卖债券	-22,889.04	-59,674.94

(债转股及债券到期兑付) 差价收入		
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	3,031,532.06	1,474,202.12

7.4.7.8.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年07月22日（基金合同生效日） 至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	485,569,265.06	111,843,071.08
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	476,029,139.05	110,337,447.39
减：应计利息总额	9,563,015.05	1,565,298.63
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-22,889.04	-59,674.94

7.4.7.9 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年07月22日（基金合同生效 日）至2022年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	85.49	-
合计	85.49	-

7.4.7.10 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年07月22日（基金合同生效 日）至2022年12月31日
审计费用	18,500.00	22,000.00
信息披露费	120,000.00	150,000.00
汇划手续费	21,990.15	11,509.21
帐户维护费	39,000.00	4,500.00
其他	1,400.00	300.00
合计	200,890.15	188,309.21

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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2024年1月11日向份额持有人支付收益 1,483,293.85元。

7.4.9 关联方关系

本报告期内与本集合计划存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化，变化情况详见附注7.4.1集合计划基本情况。

关联方名称	与本基金的关系
万联证券资产管理（广东）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
万联证券股份有限公司	管理人的股东

集合计划的关联方主要包含集合计划管理人、集合计划管理人的股东、托管人。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本集合计划本报告期内无股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本集合计划本报告期内无权证交易。

7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2022年07月22日（基金合同生效日） 至2022年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例
万联证券 股份有限 公司	128,382,178.77	25.47%	331,437,829.36	100.00%

（注：债券交易成交金额为含息金额）

7.4.10.1.4 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12月31日		上年度可比期间 2022年07月22日（基金合同生效日） 至2022年12月31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
万联证券 股份有限 公司	21,300,000,000.00	100.00%	6,290,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 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12月31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	258,114.35	100.00%	50,806.91	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022年07月22日（基金合同生效日）至2022年12月31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	69,326.49	100.00%	62,321.56	100.00%

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日 至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年07月22日（基金合同 生效日）至2022年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,085,875.08	511,175.72
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	1,085,875.08	511,175.72

(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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日 至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年07月22日（基金合同生 效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	217,175.08	102,235.18

(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。

7.4.10.2.3 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12月31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	868,699.85
合计	868,699.85
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2022年07月22日（基金合同生效日）至2022年12月31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	408,940.61
合计	408,940.61

（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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划报告期及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年07月22日（基金合同生效日） 至2022年12月31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	45,225,594.91	3,029,653.11	151,891,598.72	1,635,268.75

7.4.10.6 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及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 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
-	-	5,950,132.03	5,950,132.03	-

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。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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、经营管理层及下设风险管理委员会、风险管理职能部门、业务部门的四层级构。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	20,136,494.67	-
合计	20,136,494.67	-

注：未评级债券为超短期融资券。

7.4.13.2.2 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-

A-1以下	-	-
未评级	84,810,291.94	-
合计	84,810,291.94	-

注：同业存单评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.3 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	51,367,852.77	150,128,379.68
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	51,367,852.77	150,128,379.68

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	45,225,594.91	-	-	-	-	45,225,594.91
结算备付金	6,139,401.18	-	-	-	-	6,139,401.18
存出保证金	31,185.84	-	-	-	-	31,185.84
交易性金融资产	156,314,639.38	-	-	-	-	156,314,639.38
买入返售金融资产	20,012,707.92	-	-	-	-	20,012,707.92
应收清算款	-	-	-	-	60,061,680.81	60,061,680.81
资产总计	227,723,529.23	-	-	-	60,061,680.81	287,785,210.04
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	78,675.61	78,675.61
应付托管	-	-	-	-	15,735.11	15,735.11

万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划 2023 年年度报告

费						
应付销售服务费	-	-	-	-	62,940.41	62,940.41
应交税费	-	-	-	-	4,455.02	4,455.02
应付利润	-	-	-	-	1,536,242.71	1,536,242.71
其他负债	-	-	-	-	194,569.41	194,569.41
负债总计	-	-	-	-	1,892,618.27	1,892,618.27
利率敏感度缺口	227,723,529.23	-	-	-	58,169,062.54	285,892,591.77
上年度末 2022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	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

7.4.13.4.1.2 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率上升25个基点	-48,688.42	-124,092.67
	市场利率下降25个基点	48,732.21	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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2023年12月31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	156,314,639.38	54.68	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	156,314,639.38	54.68	150,128,379.68	42.78

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	156,314,639.38	150,128,379.68
第三层次	-	-
合计	156,314,639.38	150,128,379.68

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	156,314,639.38	54.32
	其中：债券	156,314,639.38	54.32
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	20,012,707.92	6.95
	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	51,364,996.09	17.85
4	其他各项资产	60,092,866.65	20.88
5	合计	287,785,210.04	100.00

8.2 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。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	25
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	52
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存续期未发生超过120天的情况。

8.3.2 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	59.96	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	20.94	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	15.74	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	3.51	-

	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		100.15	-

8.4 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。

8.5 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	30,855,117.86	10.79
5	企业短期融资券	20,136,494.67	7.04
6	中期票据	20,512,734.91	7.17
7	同业存单	84,810,291.94	29.67
8	其他	-	-
9	合计	156,314,639.38	54.68
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.6 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	175789	GC国能01	200,000	20,614,040.07	7.21
2	101900114	19中油股MTN002	200,000	20,512,734.91	7.17
3	012383211	23上海机场SCP011	200,000	20,136,494.6	7.04

				7	
4	112305007	23建设银行CD007	200,000	19,975,536.04	6.99
5	112313182	23浙商银行CD182	200,000	19,959,023.51	6.98
6	112303225	23农业银行CD225	200,000	19,953,843.69	6.98
7	112310046	23兴业银行CD046	200,000	19,949,612.68	6.98
8	188139	21国电01	100,000	10,241,077.79	3.58
9	112373098	23广东南粤银行CD270	50,000	4,972,276.02	1.74

8.7 “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	0.0150%
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	0.0198%

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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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，中国建设银行曾受到银保监会、国家金融监管总局处罚，中国农业银行曾受到国家金融监管总局处罚。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要求。

除上述主体外，未发现期末投资的其他前十名证券的发行主体出现本期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。

8.9.3 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	31,185.84

2	应收清算款	60,061,680.81
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	60,092,866.65

8.9.4 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
2,825	101,200.92	7,388,297.23	2.58%	278,504,294.54	97.42%

9.2 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	机构	6,531,545.00	2.28%
2	个人	5,230,180.19	1.83%
3	个人	4,940,417.86	1.73%
4	个人	3,886,745.82	1.36%
5	个人	3,319,403.04	1.16%
6	个人	3,308,842.00	1.16%
7	个人	3,027,959.96	1.06%
8	个人	2,588,047.73	0.91%

9	个人	2,512,190.27	0.88%
10	个人	2,358,957.35	0.83%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末无集合计划管理人从业人员持有本集合计划。

9.4 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

报告期末无集合计划管理人从业人员持有本集合计划。

§10 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	9,601,974,050.84
减：本报告期基金总赎回份额	9,667,010,425.13
本报告期期末基金份额总额	285,892,591.77

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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；于2023年9月13日发布公告，自2023年9月8日起李晔先生代任万联证券资产管理（广东）有限公司董事长，黄伟先生不再担任万联证券资产管理（广东）有限公司董事长。

报告期内，本集合计划管理人于2023年3月24日发布公告，万联证券股份有限公司董事变更情况下：

万联证券股份有限公司于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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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。本报告期报表审计应支付给中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为18500元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	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	佣金	占当期佣金总量的	

	元数量		额的比例		比例	
万联证券	2	-	-	258,114.35	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）本集合计划选用万联证券股份有限公司的交易单元。

11.7.2 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	128,382,178.77	25.47%	21,300,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 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。

11.9 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	公司官网、证监会指定网站、	2023-01-31

	管理人员变更公告	中国证券报	
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

17	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	2023-07-12
18	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	2023-07-20
19	万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划2023年第2季度报告	公司官网、证监会指定网站	2023-07-20
20	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更新	公司官网、证监会指定网站	2023-07-21
21	万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划基金产品资料概要更新	公司官网、证监会指定网站	2023-07-21
22	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及基金产品资料概要更新的提示性公告	中国证券报	2023-07-21
23	万联证券股份有限公司旗下部分集合资产管理计划中期报告提示性公告	中国证券报	2023-08-01
24	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	公司官网、证监会指定网站	2023-08-01
25	关于万联证券万年红天添利货币型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	2023-08-04
26	关于万联证券股份有限公司管理的集合资产管理计划变更管理人生效的公告	公司官网、证监会指定网站、中国证券报	2023-08-18
27	关于万联证券股份有限公司	公司官网、证监会指定网站、	2023-08-18

	管理的集合资产管理计划变更管理人生效的公告	中国证券报	
28	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更新	公司官网、证监会指定网站	2023-08-18
29	万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划基金产品资料概要更新	公司官网、证监会指定网站	2023-08-18
30	关于万联证券资产管理（广东）有限公司承接万联证券股份有限公司集合资产管理计划资产管理合同和托管协议的补充协议	公司官网、证监会指定网站	2023-08-18
31	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及基金产品资料概要更新、补充协议的提示性公告	中国证券报	2023-08-18
32	万联证券资产管理（广东）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	2023-09-13
33	万联证券资产管理（广东）有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报	2023-09-14
34	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	2023-10-12
35	万联证券资产管理（广东）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	2023-10-24
36	万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划2023年第3季度报告	公司官网、证监会指定网站	2023-10-24

37	万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划基金经理变更公告	公司官网、证监会指定网站、中国证券报	2023-11-10
38	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及基金产品资料概要更新的提示性公告	中国证券报	2023-11-10
39	万联证券万年红天添利货币型集合资产管理计划基金产品资料概要更新	公司官网、证监会指定网站	2023-11-10
40	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更新	公司官网、证监会指定网站	2023-11-10

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

§13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座8楼。

13.3 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.wlzqzg.com.cn

万联证券资产管理（广东）有限公司
二〇二四年三月二十八日