

# 国海证券安盈债券型集合资产管理计划 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：国海证券股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 04 月 08 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
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 其他指标 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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 .....	11
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 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
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 .....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
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的真实、准确和完整发表意见 .....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表 .....	13
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 .....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>53</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	53
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	55

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	56
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	56
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	56
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	56
7.11 投资组合报告附注 .....	56
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	58
8.3 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 .....	58
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>58</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
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 .....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
10.4 基金投资策略的改变 .....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
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 .....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
10.8 其他重大事件 .....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</b>
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 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录 .....	61
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国海证券安盈债券型集合资产管理计划	
基金简称	国海安盈债券	
场内简称	-	
基金主代码	970130	
前端交易代码	-	
后端交易代码	-	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 4 月 8 日	
基金管理人	国海证券股份有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	133,521,010.04 份	
基金合同存续期	3 年，3 年后按监管规定执行	
下属分级基金的基金简称	国海安盈债券 A	国海安盈债券 C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	970130	970131
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	61,760,739.56 份	71,760,270.48 份

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

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求实现计划资产的长期稳定增值，为投资者实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本集合计划将结合经济发展趋势、国家政策安排、行业变迁逻辑、企业自身管理情况，在货币市场工具、利率债、信用债、国债期货、股票等资产之间进行灵活配置，确定各类资产、投资策略比重，构建风险收益均衡投资组合，依托丰富的投资经验和优秀的风险控制能力在控制组合回撤风险的基础上增厚组合收益，力争获取持续稳定的收益。
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率*90%+1 年期定期存款利率（税后）*10%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金、股

	票型集合资产管理计划、混合型基金和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		国海证券股份有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈嘉斌	许俊
	联系电话	010-88576333	95566
	电子邮箱	chenjb02@ghzq.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95563	95566
传真		021-61018090	010-66594942
注册地址		广西桂林市辅星路 13 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市黄浦区福佑路 8 号人保大厦 11 楼	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200010	100818
法定代表人		何春梅	刘连舸

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ghzq.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国海证券股份有限公司	上海市黄浦区福佑路 8 号人保大厦 11 楼
-	-	-

## § 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	2022 年 04 月 08 日（基金合同生效日）-2022 年 06 月 30 日	
	国海安盈债券 A	国海安盈债券 C
本期已实现收益	266,031.17	257,429.43
本期利润	263,794.46	240,481.15
加权平均基金份额本期利润	0.0044	0.0047
本期加权平均净值利润率	0.44%	0.47%
本期基金份额净值	0.43%	0.38%

值增长率		
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	851,173.80	957,087.57
期末可供分配基金份额利润	0.0138	0.0133
期末基金资产净值	62,611,913.36	72,717,358.05
期末基金份额净值	1.0138	1.0133
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	0.43%	0.38%

注：1、本基金分设两级基金份额：A级基金份额和C级基金份额。详情请参阅相关公告。

2、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。所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国海安盈债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.22%	0.03%	0.01%	0.02%	0.21%	0.01%
自基金合同生效起至今	0.43%	0.02%	0.73%	0.03%	-0.30%	-0.01%

国海安盈债券 C

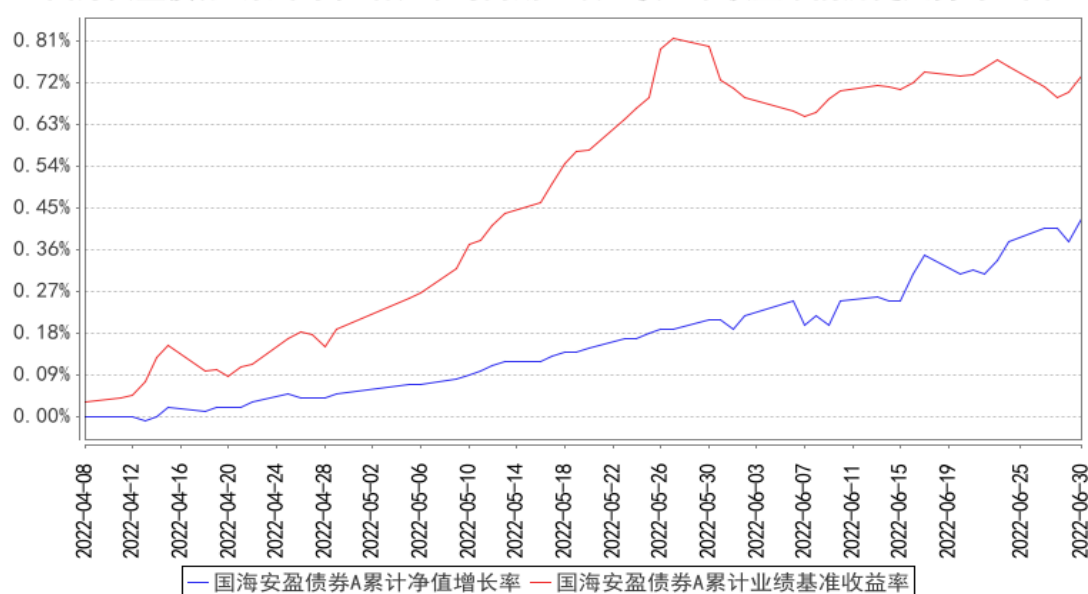
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	0.20%	0.03%	0.01%	0.02%	0.19%	0.01%
自基金合同生效起至今	0.38%	0.02%	0.73%	0.03%	-0.35%	-0.01%

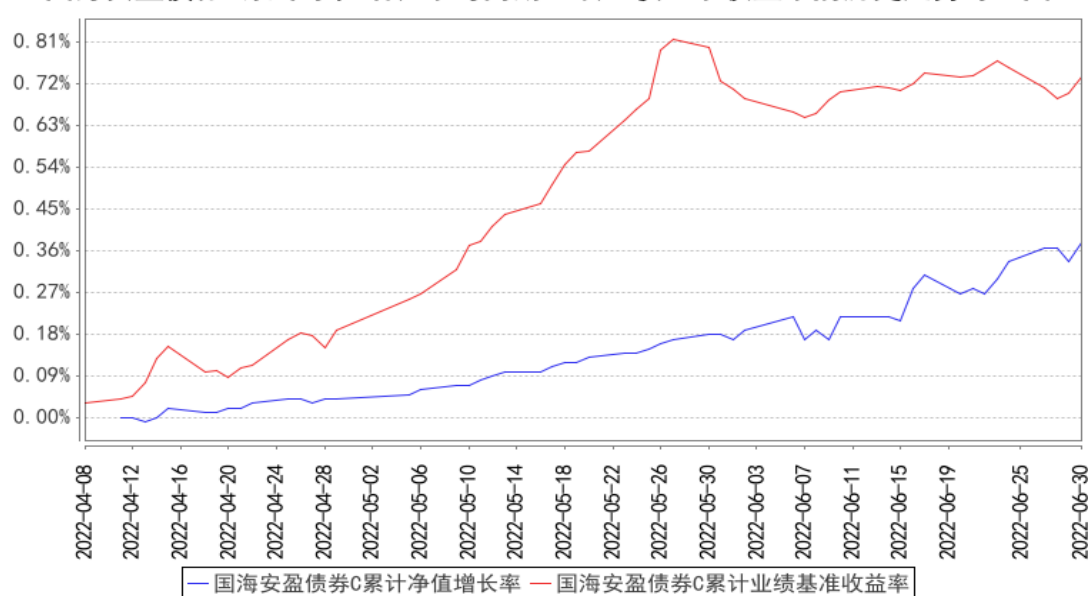
注：本基金为由“国海金贝壳9号集合资产管理计划”公募化改造来的产品，于2022年4月8日正式变更生效。

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

国海安盈债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



国海安盈债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同于2022年4月8日生效，自基金合同生效日起至本报告期末不满一年。



### 3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2022年4月8日（基金合同生效日）至 2022年6月30日）
-	-
其他指标	报告期末（2022年6月30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

国海证券是一家涵盖证券、基金、期货、私募股权投资、另类投资等多元业务体系的全国性上市综合金融服务企业。公司成立于1988年，前身为广西证券公司，是国内首批设立也是在广西区内注册的唯一一家证券公司。2011年8月，借壳桂林集琦药业股份有限公司登陆A股市场，成为国内第16家上市证券公司（股票代码：000750）。截至2022年6月末，公司在全国21个省级区域设有25家分公司、99家营业部、4家子公司（国海富兰克林基金管理有限公司、国海良时期货有限公司、国海创新资本投资管理有限公司、国海证券投资有限公司），形成了以零售财富、企业金融、机构服务与投资、资管管理、精品研究等为支撑的业务体系，为个人、企业、机构及政府客户提供多元化金融服务。

公司控股股东、实际控制人广西投资集团为广西壮族自治区本级国有资本投资公司，同时位列世界500强和中国企业500强，公司其他重要股东为实力雄厚的国有企业和上市公司。依托多元化的股权结构，公司建立了完善的法人治理体系和市场化的经营管理机制，将党的领导与公司治理有机融合，打造了市场化的选人用人机制和激励约束机制，使公司经营管理兼具稳健和市场化特点，为公司持续健康发展提供充足动力。近年来，特别是“十三五”以来，公司经营业绩、综合实力快速成长，公司各项指标位居行业前列。截至2022年6月末，公司总资产863亿元，公司实现合并营收16.84亿元、利润总额3.79亿元。

国海证券根据《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》的要求，截至2022年6月30日，旗下已有三只大集合产品完成公募化改造，为“国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划”、“国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划”、“国海证券安盈债券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		
王力	本基金的基金经理	2022 年 4 月 8 日	-	7 年	现任资管分公司固定收益总部公募产品部负责人、国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划、国海证券金贝壳稳德利保证金现金管理集合资产管理计划投资经理。毕业于上海外国语大学，获得经济学学士学位。2015 年加入申万宏源证券股份有限公司。2016 年 11 月 4 日加入国海证券，先后担任投资助理、投资经理等职务。
张文浩	本基金的基金经理	2022 年 4 月 21 日	-	6 年	现任国海证券股份有限公司证券资产管理分公司固定收益总部公募产品部投资经理，金融学硕士，6 年证券从业经验。2015 年至 2021 年在长信基金管理有限责任公司，先后担任行业研究员与投资经理。2021 年 5 月加入国海证券资产管理分公司，历任资深研究员、投资经理等职务。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、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。

#### 4.1.3 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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
王力	公募基金	1	466,934,471.06	2021 年 06 月 07 日
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	1	1,513,847,345.55	2018 年 09 月 04 日
	合计	-	-	-

注：本基金基金经理兼任一只根据《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》变更而来的参公大集合资管产品计划投资主办及一只证券公司大集合资产管理计划（即上表中的其他组合）投资主办，未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《国海证券股份有限公司资产管理业务公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核对公平交易的过程和结果进行监督。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾二季度，国内疫情的持续发展大幅超出市场预期，经济增长预期的不确定性增大，权益与可转债市场因此大幅回调；但这也让宽货币政策得以延续，利率债收益率走势呈现先下行后上行趋势，十年期国债继续围绕 2.8% 波动，信用债市场中城投债表现亮眼，收益率大幅走低后有一定回升。另外从海外来看，俄乌局势的急转直下也对全球资本市场形成较大冲击，推高了石油等商品价格，造成美国等国家的通胀率持续走高，加息预期不断升温，滞涨与衰退风险抬头。

本季度，国海安盈债券主要配置短久期高等级信用债，积极参与利率波动机会，深入挖掘各类转债标的，增加组合收益。

展望三季度，国内经济可能逐步走向复苏，后续的经济数据和政策方向值得关注。债券市场压力增大，可转债市场或许有更多投资机会待我们发掘。

本基金将继续以短久期高等级信用债为主要配置，大力发掘利率波动与可转债投资机会，精选个券，努力控制组合波动与回撤风险，力争为持有人提供良好体验。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 06 月 30 日，本基金 A 类份额净值为 1.0138 元，本报告期基金 A 类份额净值增长率为 0.43%，同期业绩比较基准收益率为 0.73%；本基金 C 类份额净值为 1.0133 元，本报告期基金 C 类份额净值增长率为 0.38%，同期业绩比较基准收益率为 0.73%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券方面，目前的通胀水平、经济增速都位于历史较低位置。考虑到短端利率已经维持低位较长时间，长端利率下行空间或许更大，但需跟踪经济复苏进度。下半年也要关注或有信用事件冲击短期流动性的问题。总体上，我们保持谨慎乐观的态度。

权益可转债方面，近期市场的分化进一步加大。部分板块在反弹后创下新高，盈利预测与估

值重回高位。相反，部分传统行业的优质公司则底部徘徊，逐步浮现出投资价值。目前阶段看未来一年，我们认为部分低估值优质企业，或有着较好的风险收益比。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括投资风险负责人、基金会计负责人等。该机构成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行利润分配。

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金

融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、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：国海证券安盈债券型集合资产管理计划

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	2,815,179.24
结算备付金		2,353,439.36
存出保证金		3,395.21
交易性金融资产	6.4.7.2	120,502,746.53
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		120,502,746.53
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	12,411,292.96
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		126,459.10
应收股利		-
应收申购款		72,000.00
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		138,284,512.40
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-

卖出回购金融资产款		-
应付清算款		1,787,848.08
应付赎回款		879,835.81
应付管理人报酬		47,937.35
应付托管费		61,655.32
应付销售服务费		22,559.98
应付投资顾问费		-
应交税费		7,434.03
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	147,970.42
负债合计		2,955,240.99
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.10	133,521,010.04
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	1,808,261.37
净资产合计		135,329,271.41
负债和净资产总计		138,284,512.40

注：本基金合同生效日为 2022 年 04 月 08 日，本报告期自基金合同生效日 2022 年 04 月 08 日起至 2022 年 06 月 30 日止。报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 133,521,010.04 份，其中国海安盈债券 A 基金份额总额 61,760,739.56 份，基金份额净值 1.0138 元。国海安盈债券 C 基金份额总额 71,760,270.48 份，基金份额净值 1.0133 元；

## 6.2 利润表

会计主体：国海证券安盈债券型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		682,407.31
1. 利息收入		100,661.97
其中：存款利息收入	6.4.7.13	16,806.21
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		83,855.76
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		438,486.19
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-4,675.44
基金投资收益		-

债券投资收益	6.4.7.15	443,161.63
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	-
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）	6.4.7.20	-19,184.99
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	162,444.14
<b>减：二、营业总支出</b>		178,131.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	101,519.85
2. 托管费	6.4.10.2.2	25,379.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	22,559.98
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-
5. 利息支出		897.41
其中：卖出回购金融资产支出		897.41
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		1,210.56
8. 其他费用	6.4.7.23	26,563.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		504,275.61
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		504,275.61
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		504,275.61

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国海证券安盈债券型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 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、本期末期初净资产(基金净值)	57,578,688.38	-	546,609.14	58,125,297.52
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	75,942,321.66	-	1,261,652.23	77,203,973.89
(一)、综合收益总额	-	-	504,275.61	504,275.61
(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)	75,942,321.66	-	757,376.62	76,699,698.28
其中:1.基金申购款	140,134,418.07	-	1,488,803.01	141,623,221.08
2.基金赎回款	-64,192,096.41	-	-731,426.39	-64,923,522.80
(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)				
(四)、 其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末 净资产(基金 净值)	133,521,010.04	-	1,808,261.37	135,329,271.41

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：

何春梅

谭志华

韦海乐

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

国海证券安盈债券型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)由原国海金贝壳 9 号(债券增强)集合资产管理计划变更而来。国海金贝壳 9 号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 2 日开始募集并于 2013 年 5 月 28 日结束募集,于 2013 年 5 月 31 日成立,2013 年 7 月 8 日获得中国证券业协会备案函《关于国海证券股份有限公司发起设立国海金贝壳 9 号(债券增强)集合资产管理计划的备案确认函》(中证协函[2013]682 号)。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的规定,原集合计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准,《国海证券安盈债券型集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“集合计划合同”)自管理人公告的生效之日起生效,原《国海金贝壳 9 号(债券增强)集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

本集合计划为契约型开放式,存续期自本集合计划变更合同生效之日起 3 年,本集合计划变更合同生效日起 3 年后,按照中国证监会有关规定执行。本集合计划管理人为国海证券股份有限公司,托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和集合计划合同的有关规定,本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(含主板、创业板及其他经中国证监会

核准或注册上市的股票)、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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。本集合计划的投资组合比例为:本集合计划债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%,其中投资于可转换债券(含分离交易可转债)及可交换债券的比例合计不超过集合计划资产的 20%;股票资产的比例不高于集合计划资产的 5%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本集合计划所持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本集合计划的业绩比较基准为:中债综合财富(总值)指数收益率\*90%+1 年期定期存款利率(税后)\*10%

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年半年度的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

除下述变更后的会计政策外,本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计报表的实际编

制期间为 2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金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

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、其他金融负债。

#### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第

二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金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) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(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，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金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**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回

基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

其他金融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。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

无。

#### 6.4.4.13 分部报告

截至本期末，本集合资产管理计划仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

#### 6.4.4.14 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，本集合计划确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本集合计划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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 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、可分离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、可分离债券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立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中央国债登记结算有限责任公司所独立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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财税[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[2016]46号文《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号文《财政部、国家税务总局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号文《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号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

##### 1、增值税

根据财税[2016]140号文件的规定，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。

根据财税[2017]56号文件的规定，自2018年1月1日(含)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。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。

根据财税[2017]90号文件的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：(1)提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；(2)转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以



2017 年最后一个交易日的股票收盘价 (2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值 (中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本集合计划增值税的附加税费，包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等，按照实际缴纳增值税税额的适用比例计算，由管理人申报缴纳。

## 2、印花税

比照《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》(财税字[1998]55 号)和《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税[2002]128 号)文件的规定，管理人运用资产管理计划买卖股票，出股票按 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。

## 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 6 月 30 日
活期存款	2,815,179.24
等于：本金	2,814,905.70
加：应计利息	273.54
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	2,815,179.24

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	18,054,295.93	233,093.23	18,368,643.17	81,254.01
	银行间市场	101,131,259.00	1,103,003.36	102,134,103.36	-100,159.00
	-	-	-	-	-
	合计	119,185,554.93	1,336,096.59	120,502,746.53	-18,904.99
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	119,185,554.93	1,336,096.59	120,502,746.53	-18,904.99	

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
其中：国债期货投资	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
其中：远期外汇投资	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其中：股指期货投资	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
-	-	-	-	-

合计				
减：可抵销期货 暂收款				
净额				

## 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	市值	公允价值变动
-	-	-	-	-
合计				
减：可抵销期货 暂收款				
净额				

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	12,411,292.96	-
银行间市场	-	-
-	-	-
合计	12,411,292.96	-

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日						
	债券代码	债券名称	约定 返售日	估值单价	数量 (张)	估值 总额	其中：已出售 或再质押总额
-	-	-	-	-	-	-	-
合计							

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

-
---

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日				
	初始成本	利息调整	应计利息	减值准备	账面价值
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-

	-	-	-	-	-	-
	小计	-	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-	-
其他		-	-	-	-	-
合计		-	-	-	-	-

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
期初余额	-	-	-	-
本期从其他阶段转入	-	-	-	-
本期转出至其他阶段	-	-	-	-
本期新增	-	-	-	-
本期转回	-	-	-	-
其他变动	-	-	-	-
期末余额	-	-	-	-

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日					
	初始成本	利息调整	应计利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
债券	交易所市场	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
	小计	-	-	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-

合计	-	-	-	-	-	-
----	---	---	---	---	---	---

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
期初余额	-	-	-	-
本期从其他阶段转入	-	-	-	-
本期转出至其他阶段	-	-	-	-
本期新增	-	-	-	-
本期转回	-	-	-	-
其他变动	-	-	-	-
期末余额	-	-	-	-

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
-	-	-	-
合计	-	-	-

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日					
	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因	本期确认的股利收入	累计利得	累计损失	其他综合收益转入留存收益的金额	其他综合收益转入留存收益的原因

-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

## 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	-
-	-
合计	-

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	143,368.06
其中：交易所市场	129,070.87
银行间市场	14,297.19
-	-
应付利息	-
预提费用	4,602.36
合计	147,970.42

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 国海安盈债券 A

项目	本期 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	57,578,688.38	57,578,688.38
本期申购	17,787,453.07	17,787,453.07
本期赎回（以“-”号填列）	-13,605,401.89	-13,605,401.89
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	61,760,739.56	61,760,739.56

## 国海安盈债券 C

项目	本期 2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	122,346,965.00	122,346,965.00
本期赎回（以“-”号填列）	-50,586,694.52	-50,586,694.52
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	71,760,270.48	71,760,270.48

## 6.4.7.11 其他综合收益

单位：人民币元

项目	期初余额	本期发生金额				期末余额
		本期所得 税前发生 额	减：前期计 入其他综 合收益当 期转入损 益	减：前期计 入其他综 合收益当 期转入留 存收益	减：所得税 费用	
一、不能重分 类进损益的 其他综合收 益	-	-	-	-	-	-
其中：其他权 益工具投资 公允价值变 动	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
二、将重分类 进损益的其 他综合收益	-	-	-	-	-	-
其中：其他债 权投资公允 价值变动	-	-	-	-	-	-
其他债权投 资信用减值 准备	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国海安盈债券 A

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	272,318.54	-2,736.71	269,581.83
本期基金份额交易产生的变动数	39,385.82	1,384.38	40,770.20
其中：基金申购款	187,122.25	-105.92	187,016.33
基金赎回款	-147,736.43	1,490.30	-146,246.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	856,916.90	-5,743.10	851,173.80

## 国海安盈债券 C

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	257,429.43	-16,948.28	240,481.15
本期基金份额交易产生的变动数	706,324.44	10,281.98	716,606.42
其中：基金申购款	1,297,782.12	4,004.56	1,301,786.68
基金赎回款	-591,457.68	6,277.42	-585,180.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	963,753.87	-6,666.30	957,087.57

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年6月30日
活期存款利息收入	11,283.51
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	5,433.47
其他	89.23
合计	16,806.21

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,675.44
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-4,675.44

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元



项目	本期 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年6月 30日
卖出股票成交总额	71,804.66
减：卖出股票成本总额	76,402.80
减：交易费用	77.30
买卖股票差价收入	-4,675.44

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年6月30 日
出借证券现金清偿总额	-
减：出借证券成本总额	-
减：应收证券出借利息	-
减：交易费用	-
证券出借差价收入	-

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年6月30 日
债券投资收益——利息收入	439,841.13
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,320.50
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	443,161.63

##### 6.4.7.15.2 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4月8日（基金合同生效日）至2022年6月 30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	24,468,569.68
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	24,066,242.44
减：应计利息总额	388,756.49
减：交易费用	10,250.25
买卖债券差价收入	3,320.50

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回债券成本总额	-
减：赎回债券应计利息总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年6月30日
申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购债券成本总额	-
减：申购债券应计利息总额	-
减：交易费用	-
-	-
申购差价收入	-

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	-

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

单位：人民币元

项目	本期
	2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	-
减：卖出资产支持证券成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	-

资产支持证券投资收益	-
------------	---

#### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回资产支持证券成本总额	-
减：赎回资产支持证券应计利息总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

#### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年6月30日
申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购资产支持证券成本总额	-
减：申购资产支持证券应计利息总额	-
减：交易费用	-
-	-
申购差价收入	-

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年6月30日
贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入	-
贵金属投资收益——赎回差价收入	-
贵金属投资收益——申购差价收入	-
合计	-

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年6月30日
卖出贵金属成交总额	-
减：卖出贵金属成本总额	-

减：交易费用	-
减：买卖贵金属差价收入应缴纳增值税额	-
买卖贵金属差价收入	-

#### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
赎回贵金属份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回贵金属成本总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

#### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
申购贵金属份额总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购贵金属成本总额	-
减：交易费用	-
-	-
申购差价收入	-

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
卖出权证成交总额	-
减：卖出权证成本总额	-
减：交易费用	-
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	-
买卖权证差价收入	-

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
-	-

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	-

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-19,184.99
股票投资	-
债券投资	-19,184.99
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
-	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-19,184.99

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	162,444.14
-	-
合计	162,444.14

## 6.4.7.22 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
银行存款	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其他债权投资	-

其他	-
-	-
合计	-

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	4,602.36
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	5,131.58
账户维护费	16,830.00
合计	26,563.94

#### 6.4.7.24 分部报告

截至本期末，本资产管理计划无需作披露的分部报告。

#### 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，本资产管理计划无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本资产管理计划无需作披露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
国海证券股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
	2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
国海证券	71,666.72	100.00

## 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
国海证券	36,812,778.70	100.00

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
国海证券	698,400,000.00	100.00

## 6.4.10.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比例 (%)
-	-	-

## 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 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年6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 (%)
国海证券	21,121.71	100.00	129,070.87	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 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的0.4%年费率计提，计算方法如下：

$$G = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

G 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划管理费划付指令，经托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。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 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	25,379.96

注：本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的 0.1% 年费率计提，计算方法如下：

$$T = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

T 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划托管费划付指令，经托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给托管人。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		
	2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国海安盈债券 A	国海安盈债券 C	合计
国海证券	-	22,180.64	22,180.64
国海资管	-	378.61	378.61
合计	-	22,559.25	22,559.25

注：本集合计划 A 类计划份额不收取销售服务费，C 类计划份额的销售服务费年费率为 0.2%。销售服务费主要用于本集合计划持续销售以及集合计划份额持有人服务等各项费用。销售服务费按前一日 C 类计划份额资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的 C 类计划份额销售服务费

E 为前一日的 C 类计划份额的资产净值



R 为销售服务年费率

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划销售服务费划付指令，经托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中划出。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

单位：人民币元

本期 2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期 2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借 业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期 2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日										
关联方 名称	合约 编号	证券 名称	成交时 间	交易金额	交易 数量（单 位：股）	出借 期限 （单 位： 天）	费率 （%）	利息 收入	期末证 券出借 业务余 额	期末应收 利息余额
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
	国海安盈债券 A	国海安盈债券 C
基金合同生效日（2022 年 4 月 8 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

## 6.4.10.5.2 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

份额单位：份

## 国海安盈债券 A

关联方名称	本期末	
	2022 年 6 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
-	-	-

份额单位：份

## 国海安盈债券 C

关联方名称	本期末	
	2022 年 6 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
-	-	-

## 6.4.10.6 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 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	2,815,179.24	11,283.51

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内未在承销期内申购关联方承销的证券。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

## 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

国海安盈债券 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
-	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-
国海安盈债券 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
-	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内无利润分配。

## 6.4.12 期末(2022 年 6 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：股)	期末 成本总额	期末估 值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：张)	期末 成本总额	期末估 值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

## 6.4.12.1.4 受限证券类别：权证

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:份)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内不存在股票流通受限情况。

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内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

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
-	-	-	-	-	-
合计				-	-

注：本基金期末无正回购余额。

## 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

## 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

## 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

本集合计划在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本集合计划管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本集合计划管理人建立了由公司投资决策与风险控制委员会、资产管理业务发展与风险管理委员会、资管分公司产品评审与投资决策委员会、资管分公司公募产品投资决策与风险管理委员会组成的四级风险管理体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。本集合计划均投资于具有良好信用等级的证券，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交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；集合计划在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 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 2022年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
-	-
未评级	35,353,980.28
合计	35,353,980.28

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券包括期限一年以内的国债、政策性金融债、央行票据及未有第三方机构评级的短期融资券和超短期融资券。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

注：本期末基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

##### 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 6 月 30 日
A-1	-
A-1 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

注：本期末基金未持有短期信用评级的同业存单。

#### 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 6 月 30 日
AAA	41,522,367.80
AAA 以下	17,545,604.12
-	-
未评级	10,128,635.62
合计	69,196,607.54

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日
AAA	-
AAA 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

注：本期末基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日
AAA	15,952,158.71
AAA 以下	-
-	-
未评级	-
合计	15,952,158.71

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划管理人未能以合理价格及时变现集合计划资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
资产				
-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	-
负债				
-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-
流动性净额	-	-	-	-

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人严格按照《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》等有关法规的要求建立健全流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理。

本集合计划的管理人采用监控组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、集合计划组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本集合计划的申购赎回情况进行监控，保持投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本集合计划资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本集合计划的管理人在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带来的流动性风险，有效保障持有人利益。本集合计划本报告期末无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指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。

本集合计划管理人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。

本集合计划投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	2,815,179.24	-	-	-	2,815,179.24
结算备付金	2,353,439.36	-	-	-	2,353,439.36
存出保证金	3,395.21	-	-	-	3,395.21
交易性金融资产	115,379,028.72	5,123,717.81	-	-	120,502,746.53
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	12,411,292.96	-	-	-	12,411,292.96
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	72,000.00	72,000.00
应收清算款	-	-	-	126,459.10	126,459.10
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>132,962,335.49</b>	<b>5,123,717.81</b>	<b>-</b>	<b>198,459.10</b>	<b>138,284,512.40</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	879,835.81	879,835.81
应付管理人报酬	-	-	-	47,937.35	47,937.35
应付托管费	-	-	-	61,655.32	61,655.32
应付清算款	-	-	-	1,787,848.08	1,787,848.08
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	22,559.98	22,559.98
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	7,434.03	7,434.03
其他负债	-	-	-	147,970.42	147,970.42
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2,955,240.99</b>	<b>2,955,240.99</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>132,962,335.49</b>	<b>5,123,717.81</b>	<b>-</b>	<b>-2,756,781.89</b>	<b>135,329,271.41</b>

#### 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	
	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6月30日）
分析	市场利率上升25个	-353,009.86



	基点	
	市场利率下降 25 个基点	353,610.77

#### 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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-

应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	-		
	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6月30日）	
分析	-		-

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因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证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，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 2022年6月30日	
	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	-	-
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	-	-

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-	
	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6月30日）
分析	-	-

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	-	
	-	
	-	
分析	风险价值 （单位：人民币元）	本期末（2022年6月30日）
	-	-
	合计	-

#### 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，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本资产管理计划以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金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) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(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，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日
第一层次	8,191,077.41
第二层次	112,311,669.12
第三层次	-
合计	120,502,746.53

注：在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

**6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转换。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

无。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

无。

**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基金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	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	120,502,746.53	87.14
	其中：债券	120,502,746.53	87.14
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	12,411,292.96	8.98
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,168,618.60	3.74
-	-	-	-
8	其他各项资产	201,854.31	0.15
9	合计	138,284,512.40	100.00

**7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合****7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
----	------	----------	---------------

A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
可选消费	-	-
主要消费	-	-
医药卫生	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
通信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末无港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000810	创维数字	76,402.80	0.06

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000810	创维数字	71,666.72	0.05

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	76,402.80
卖出股票收入（成交）总额	71,666.72

## 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	10,177,565.76	7.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,123,717.81	3.79
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	25,176,414.52	18.60
6	中期票据	55,881,812.32	41.29
7	可转债（可交换债）	8,191,077.41	6.05
8	同业存单	15,952,158.71	11.79
-	-	-	-
9	其他	-	-
10	合计	120,502,746.53	89.04

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	102002362	20 中铁股 MTN006	100,000	10,277,460.27	7.59
2	102000084	20 南电 MTN002	100,000	10,213,178.08	7.55
3	102100850	21 电网 MTN002	100,000	10,128,635.62	7.48
4	102000879	20 溧阳城建	100,000	10,128,616.44	7.48

		MTN001			
5	102000680	20 中国一汽 MTN001	100,000	10,077,958.90	7.45

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末无资产支持证券投资。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

金额单位：人民币元

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末无贵金属投资。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末无权证投资。

### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

#### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

无。

#### 7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

否。

#### 7.11.3 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	3,395.21
2	应收清算款	126,459.10
3	应收股利	-



4	应收利息	-
5	应收申购款	72,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	201,854.31

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110059	浦发转债	5,830,052.74	4.31
2	128073	哈尔转债	1,514,015.64	1.12
3	128048	张行转债	252,972.63	0.19
4	128109	楚江转债	191,807.96	0.14
5	113039	嘉泽转债	97,766.22	0.07
6	123091	长海转债	69,395.66	0.05

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内不存在股票流通受限情况。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 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

份额级别	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 (%)
国海安盈债券 A	496	124,517.62	5,441,251.95	8.81	56,319,487.61	91.19
国海安盈	777	92,355.56	6,554,166.78	9.13	65,206,103.70	90.87

债券 C						
合计	1,273	104,886.89	11,995,418.73	8.98	121,525,591.31	91.02

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	国海安盈债券 A	1,035,173.42	1.68
	国海安盈债券 C	2,099,849.01	2.93
	合计	3,135,022.43	2.35

### 8.3 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	份额级别	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	国海安盈债券 A	-
	国海安盈债券 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	国海安盈债券 A	-
	国海安盈债券 C	-
	合计	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国海安盈债券 A	国海安盈债券 C
基金合同生效日 (2022 年 4 月 8 日) 基金份额总额	57,578,688.38	-
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	17,787,453.07	122,346,965.00
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	13,605,401.89	50,586,694.52
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	61,760,739.56	71,760,270.48

## § 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，本基金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，本基金管理人重大人事变动如下：

2022 年 1 月 5 日，公司召开第九届董事会第十一次会议，聘任蒋健先生、程明先生为公司副总裁，蒋健先生、程明先生自 2022 年 1 月 5 日起正式履行副总裁职责。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金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

本报告期内，基金管理人或其高级管理人员、基金经理未因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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 (%)	
国海证券	2	71,666.72	100.00	21,121.71	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	
	成交金额	占当期债券成交总额的	成交金额	占当期债券回购成交总额的	成交金额	占当期权证成交总额的

		比例 (%)		比例 (%)		比例 (%)
国海证券	36,812,778.70	100.00	698,400,000.00	100.00	-	-

## 10.8 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	国海证券安盈债券型集合资产管理计划基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 4 月 8 日
2	国海证券安盈债券型集合资产管理计划基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 4 月 8 日
3	国海证券股份有限公司关于增加奕丰基金为国海证券安盈债券型集合资产管理计划代销机构的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 4 月 15 日
4	国海证券股份有限公司关于增加度小满基金为国海证券安盈债券型集合资产管理计划代销机构的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 4 月 19 日
5	国海证券安盈债券型集合资产管理计划基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 4 月 21 日
6	国海证券安盈债券型集合资产管理计划招募说明书更新	中国证监会规定网站	2022 年 4 月 21 日
7	国海证券安盈债券型集合资产管理计划(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2022 年 4 月 21 日
8	国海证券安盈债券型集合资产管理计划(C类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2022 年 4 月 21 日
9	国海证券股份有限公司关于终止与北京植信基金销售有限公司销售合作关系的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 5 月 13 日

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险
--------

-
---

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。
----

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《国海证券安盈债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《国海证券安盈债券型集合资产管理计划招募说明书》；
- 3、《国海证券安盈债券型集合资产管理计划资产托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 5、法律法规及中国证监会规定的其他文件。

### 12.2 存放地点

上海市黄浦区福佑路 8 号人保寿险大厦 11 层。

广西南宁市滨湖路 46 号国海大厦。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人互联网站（[www.ghzq.com.cn](http://www.ghzq.com.cn)）查阅，或在营业时间内至集合计划管理人的办公场所免费查阅。

国海证券股份有限公司

2022 年 8 月 31 日