

# 海通现金宝货币型集合资产管理计划 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：上海海通证券资产管理有限公司

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 8 月 30 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及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

集合计划托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本集合计划合同规定，于 2024 年 8 月 23 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 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.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
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.....	6
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	9
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.....	9
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>9</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	9
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.....	10
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.....	10
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>10</b>
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	11
6.3 净资产变动表.....	12
6.4 报表附注.....	14
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 债券回购融资情况.....	31
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	32
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.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	32
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.....	33
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.....	33
7.8 期末按实际利率计算的账面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.....	34
7.9 投资组合报告附注.....	34
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>35</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	35
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	35
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	35
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.....	35
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>36</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>36</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	36
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.....	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4 基金投资策略的改变.....	36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	37
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.....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	37
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	37
10.9 其他重大事件.....	37
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>38</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.....	38
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	38
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>38</b>
12.1 备查文件目录.....	38
12.2 存放地点.....	38
12.3 查阅方式.....	38

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海通现金宝货币型集合资产管理计划
基金简称	海通现金宝货币
基金主代码	850011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 5 月 31 日
基金管理人	上海海通证券资产管理有限公司
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	9,174,140,276.53 份
基金合同存续期	三年

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争为投资人提供稳定的收益。
投资策略	本集合计划主要投资策略有：利率策略、骑乘策略、回购策略、个券选择策略。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本集合计划是一只货币型集合计划，其预期风险和预期收益低于债券型基金、债券型集合计划、混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、股票型集合计划。

注：详见《海通现金宝货币型集合资产管理计划招募说明书》第九部分“集合计划的投资”。

### 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	上海海通证券资产管理有限公司	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露 负责人	姓名	吴文然
	联系电话	021-23154762
	电子邮箱	htam@haitong.com
客户服务电话	95553、4008888001	010-59378888
传真	021-63410460	010-59378771
注册地址	上海市广东路 689 号海通证券大厦 32 楼	北京市西城区太平桥大街 17 号
办公地址	上海市广东路 689 号海通证券大厦 32 楼	北京市西城区太平桥大街 17 号
邮政编码	200001	100033
法定代表人	路颖	周明

### 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	<a href="http://www.htsamc.com">http://www.htsamc.com</a>

基金中期报告备置地点	集合计划管理人及集合计划托管人的办公场所
------------	----------------------

## 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	61,757,138.88
本期利润	61,757,138.88
本期净值收益率	0.7381%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	9,174,140,276.53
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	2.9868%

注：1、本集合计划无持有人认购或交易集合计划的各项费用。

2、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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本集合计划采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本集合计划的利润分配按月结转为对应份额。

### 3.2 基金净值表现

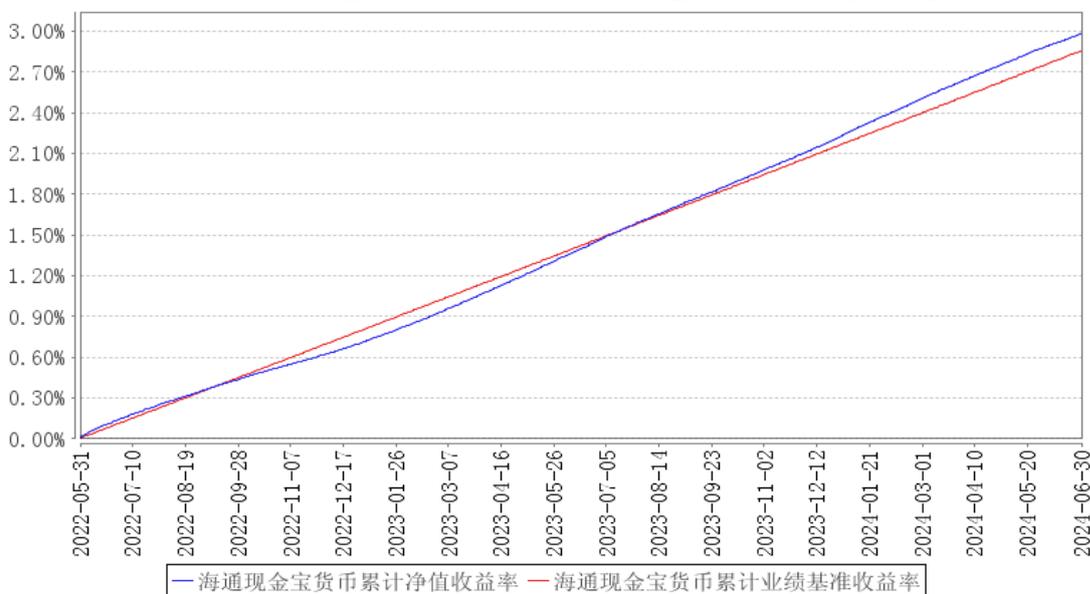
#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.1075%	0.0009%	0.1110%	0.0000%	-0.0035%	0.0009%
过去三个月	0.3460%	0.0007%	0.3371%	0.0000%	0.0089%	0.0007%
过去六个月	0.7381%	0.0006%	0.6754%	0.0000%	0.0627%	0.0006%
过去一年	1.4993%	0.0005%	1.3629%	0.0000%	0.1364%	0.0005%

自基金合同生效 起至今	2.9868%	0.0008%	2.8584%	0.0000%	0.1284%	0.0008%
----------------	---------	---------	---------	---------	---------	---------

### 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

海通现金宝货币累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 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

本集合资产管理计划管理人上海海通证券资产管理有限公司前身为海通证券客户资产管理部，2002 年开始从事持牌受托投资管理业务（证监机构字【2001】265 号），2012 年 6 月经核准成为资管子公司，秉承海通证券资产管理牌照和业务，注册资本 10 亿元，注册地上海市。经过多次增资，目前注册资本为 22 亿元人民币整。公司的经营范围为证券资产管理业务，包括：单一业务、集合业务、专项业务、QDII 业务和创新业务，覆盖主动权益、固收、量化、现金管理、另类投资、ABS、QDII 等全业务产品线。

截至 2024 年 6 月 30 日，集合资产管理计划管理人共管理 17 只公募集合资产管理计划。

#### 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		
李佳闻	投资经理	2022 年 5 月 31 日	-	8 年	李佳闻，女，香港科技大学经济学硕士。历任上海海通证券资产管理有限公司固定收益部研究员、投资经理助理，现任上海

					海通证券资产管理有限公司公募固收部投资经理。
李夏	投资经理	2022 年 5 月 31 日	-	8 年	李夏，女，西安交通大学金融学和曼彻斯特大学统计学双硕士，8 年证券从业经验，2015 年加入上海海通证券资产管理有限公司，历任固定收益部研究员和投资经理，历任海通现金赢家，年年鑫，增益系列，慧享系列等产品投资经理。

## 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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本集合计划进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 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

2024 年上半年，债券收益率震荡下行。一季度，经济基本面预期偏弱，年初机构配置力量较强，货币政策降准以及中小行存款利率下调，债券收益率震荡下行，期限利差和信用利差压缩到偏低水平。3 月在特别国债供给压力、地产政策等影响下，收益率小幅调整后维持震荡走势。二季度，理财规模快速增长，手工补息叫停后非银流动性充裕，市场配置需求旺盛，但政府债券供给偏慢、城投债供给偏少，债券收益率持续下行，利率债短端下行幅度大于长端，信用债下行幅度大于利率债。尽管期间债市也受到央行对利率持续关注、地产政策预期升温、特别国债供给等利空扰动，但在消化利空后收益率继续下行。组合在报告期内坚持均衡配置，增配 3M-1Y 存单及短久期高等级信用债。灵活调整各类资产比例和组合久期，适度拉长组合久期，积极把握配置时点以及交易性机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期集合计划上述份额净值增长率为 0.7381%。业绩比较基准收益率为 0.6754%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，从基本面来看，内需不足、预期偏弱、物价低位运行等问题仍存，基本面对债市仍有支持。央行降息开启宽松周期，叠加机构配置需求旺盛，利率下行趋势仍在。但也需要关注央行对收益率曲线调控、三季度政府债券供给加大带来的扰动。本产品将根据基本面及政策面灵活调整久期，把握资金面收紧带来的配置机会，根据存款/存单/短债收益率灵活调整各类资产比例，平衡产品流动性和收益率。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本集合计划管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》等法律法规、估值指引的相关规定，以及集合计划合同对估值程序的相关约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、集合计划份额净值的计算由集合计划管理人独立完成，并与集合计划托管人进行账务核对，经集合计划托管人复核无误后，由集合计划管理人对外公布。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

集合计划收益分配原则：每一集合计划份额享有同等分配权。申购的集合计划份额享有确认当日的分红权益，而赎回的集合计划份额不享有确认当日的分红权益。本集合计划以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每月以红利再投资方式集中支付累计收益。

一、本集合计划本报告期内应分配 61,757,138.88 元。二、已实施的利润分配 56,867,867.33 元。三、应分配但尚未实施的利润 4,889,271.55 元，将于资产负债表日后首次分红日按 1.0000 元的份额面值结转为集合计划份额。以上符合相关法规及集合计划合同的规定。

#### 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

本集合计划本报告期无需要说明的情形。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在对本集合计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的有关规定，不存在损害集合计划份额持有人利益的行

为，尽职尽责地履行了集合计划托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的有关规定，对本集合计划的投资运作、集合计划资产净值计算、集合计划费用开支等方面进行了监督和复核，未发现本集合计划管理人存在损害集合计划份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其内容真实、准确和完整。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：海通现金宝货币型集合资产管理计划

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	3,509,237,652.14	2,917,453,201.79
结算备付金		35,550,402.29	13,188,572.53
存出保证金		338,888.63	548,603.15
交易性金融资产	6.4.7.2	4,824,096,117.62	3,641,520,584.27
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,824,096,117.62	3,641,520,584.27
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	1,086,693,550.88	18,805,077.32
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		54,797,377.64	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		9,510,713,989.20	6,591,516,039.06
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31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		305,693,000.00	452,195,094.33
应付清算款		18,819,493.15	250,084,986.24
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,440,753.23	3,251,132.98
应付托管费		403,704.84	295,557.52
应付销售服务费		2,018,524.19	1,477,787.71
应付投资顾问费		-	-
应交税费		165,328.16	88,128.10
应付利润		4,889,271.55	4,262,901.34
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	143,637.55	179,887.06
负债合计		336,573,712.67	711,835,475.28
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	9,174,140,276.53	5,879,680,563.78
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		9,174,140,276.53	5,879,680,563.78
负债和净资产总计		9,510,713,989.20	6,591,516,039.06

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，集合计划份额净值 1.0000 元，集合计划份额总额 9,174,140,276.53 份。

## 6.2 利润表

会计主体：海通现金宝货币型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		99,944,669.37	88,626,877.79
1. 利息收入		46,148,226.99	37,651,602.94
其中：存款利息收入	6.4.7.13	42,138,178.51	32,252,286.65
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		4,010,048.48	5,399,316.29
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		53,796,442.38	50,975,274.85
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	53,796,442.38	50,975,274.85
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	-	-
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	-	-
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>38,187,530.49</b>	<b>32,579,088.83</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	23,116,210.39	20,346,746.77
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,101,473.74	1,849,704.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	10,507,368.30	9,248,521.22
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,244,494.51	894,679.03
其中：卖出回购金融资产支出		2,244,494.51	894,679.03
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		83,613.28	102,958.61
8. 其他费用	6.4.7.23	134,370.27	136,479.09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>61,757,138.88</b>	<b>56,047,788.96</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>61,757,138.88</b>	<b>56,047,788.96</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>61,757,138.88</b>	<b>56,047,788.96</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：海通现金宝货币型集合资产管理计划

本报告期：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,879,680,563.78	-	5,879,680,563.78
二、本期期初净资产	5,879,680,563.78	-	5,879,680,563.78
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	3,294,459,712.75	-	3,294,459,712.75
(一)、综合收益总额	-	61,757,138.88	61,757,138.88
(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)	3,294,459,712.75	-	3,294,459,712.75
其中：1. 基金申购款	98,967,598,402.26	-	98,967,598,402.26
2. 基金赎回款	-95,673,138,689.51	-	-95,673,138,689.51
(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)	-	-61,757,138.88	-61,757,138.88
四、本期期末净资产	9,174,140,276.53	-	9,174,140,276.53
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	6,133,343,803.81	-	6,133,343,803.81
二、本期期初净资产	6,133,343,803.81	-	6,133,343,803.81
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	22,410,044.62	-	22,410,044.62
(一)、综合收益总额	-	56,047,788.96	56,047,788.96
(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)	22,410,044.62	-	22,410,044.62
其中：1. 基金申购款	81,352,711,639.99	-	81,352,711,639.99

2. 基金赎回款	-81,330,301,595.37	-	-81,330,301,595.37
(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）	-	-56,047,788.96	-56,047,788.96
四、本期期末净资产	6,155,753,848.43	-	6,155,753,848.43

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：

<u>王岗</u>	<u>陈颖</u>	<u>刘雯</u>
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

海通现金宝货币型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）变更自原大集合“海通现金赢家集合资产管理计划”（以下简称“原集合计划”）。原集合计划为现金管理产品，于 2012 年 9 月 27 日经中国证监会证监许可（2012）1301 号核准设立，自 2012 年 10 月 18 日起开始募集并于 2012 年 11 月 28 日结束募集，于 2012 年 11 月 29 日成立。本集合计划于 2022 年 3 月 29 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予海通现金赢家集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2022]575 号）批准，《海通现金宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”）于 2022 年 5 月 31 日起正式变更生效。本集合计划为契约型开放式，自合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本集合计划的管理人为上海海通证券资产管理有限公司，托管人为中国证券登记结算有限责任公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海通现金宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划的投资范围为：1、现金；2、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、中央银行票据、同业存单；3、期限在 1 个月以内的债券回购；4、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券；5、中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

本集合计划投资于前款第 4 项的，其中企业债、公司债、短期融资券、中期票据的主体信用评级和债项信用评级均应当为最高级，若无债项信用评级，按主体信用评级；超短期融资券的主

体信用评级应当为最高级。发行人同时有两家以上境内评级机构评级的，按照孰低原则确定评级，具体以监管要求为准。

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。

本集合计划的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海通现金宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划 2024 年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年度上半年的经营成果和净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

本集合计划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。

#### 6.4.5 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未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

集合计划目前比照公开募集证券投资基金所依据的相关财税法规和实务操作及其他相关国内财税法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产

品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对集合计划从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 本集合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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,500,476,402.33
等于：本金	1,499,078,099.41
加：应计利息	1,398,302.92
减：坏账准备	-
定期存款	2,008,761,249.81
等于：本金	2,000,000,000.00
加：应计利息	8,761,249.81
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	2,008,761,249.81
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	3,509,237,652.14

注：定期存款的存款期限为定期存款的票面存期。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 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	509,791,435.32	509,968,418.90	176,983.58	0.0019
	银行间市场	4,314,304,682.30	4,315,166,338.93	861,656.63	0.0094

	合计	4,824,096,117.62	4,825,134,757.83	1,038,640.21	0.0113
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	4,824,096,117.62	4,825,134,757.83	1,038,640.21	0.0113

注：1、偏离金额=影子定价-按实际利率计算的账面价值。

2、偏离度=偏离金额/通过按实际利率计算账面价值确定的集合计划资产净值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

#### 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 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,086,693,550.88	-
合计	1,086,693,550.88	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本集合计划本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 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

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

#### 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

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本集合计划本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	65,714.45
其中：交易所市场	-
银行间市场	65,714.45
应付利息	-
预提费用	77,923.10
合计	143,637.55

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,879,680,563.78	5,879,680,563.78
本期申购	98,967,598,402.26	98,967,598,402.26
本期赎回（以“-”号填列）	-95,673,138,689.51	-95,673,138,689.51
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	9,174,140,276.53	9,174,140,276.53

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

## 6.4.7.11 其他综合收益

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

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	61,757,138.88	-	61,757,138.88
本期基金份额交易	-	-	-

产生的变动数			
其中：基金申购款	-	-	-
金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-61,757,138.88	-	-61,757,138.88
期末	-	-	-

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	24,494,116.98
定期存款利息收入	17,520,291.43
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	121,255.12
其他	2,514.98
合计	42,138,178.51

注：其他包含结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

注：本集合计划本报告期无股票投资收益。

#### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	50,629,478.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,166,963.98
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	53,796,442.38
----	---------------

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,601,251,757.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,539,671,214.25
减：应计利息总额	58,413,579.36
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	3,166,963.98

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——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

#### 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

注：本集合计划本报告期无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

#### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——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

#### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——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

#### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——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

注：本集合计划本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

#### 6.4.7.19 股利收益

注：本集合计划本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

注：本集合计划本报告期无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.21 其他收入

注：本集合计划本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本集合计划本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	8,950.76
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	46,887.17
账户维护费	18,600.00
其他费用	260.00
合计	134,370.27

#### 6.4.7.24 分部报告

本集合计划本报告期无分部报告。

#### 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

截至财务报表报出日，本集合计划并无须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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 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
上海海通证券资产管理有限公司（“海通资管”）	基金管理人、基金销售机构
中国证券登记结算有限责任公司	基金托管人
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

#### 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

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	23,116,210.39	20,346,746.77
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	23,116,210.39	20,346,746.77

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.55%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.55\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

当以 0.55%的年管理费率计算的七日年化暂估收益率小于或等于 2 倍活期存款利率，管理人将调整年管理费率为 0.30%，以降低每万份集合计划暂估净收益为负并引发销售机构交收透支的风险，直至该类风险消除，管理人方可恢复按 0.55%年费率计提管理费。管理人应在费率调整后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,101,473.74	1,849,704.11

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.05%年费率计提。托管费的计算方法如

下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	海通现金宝货币
海通资管	10,507,368.30
合计	10,507,368.30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	海通现金宝货币
海通资管	9,248,521.22
合计	9,248,521.22

注：本集合计划的销售服务费按前一日集合计划资产净值的 0.25% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 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

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 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

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间均未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。

##### 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

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
基金合同生效日（2022年5月31日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	30,651,252.01	30,196,912.04
报告期间申购/买入总份额	230,949.55	222,512.24
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	30,882,201.56	30,419,424.28
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.34%	0.49%

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

##### 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

注：本报告期末及上年度末除集合计划管理人之外的其他关联方未投资及持有本集合计划份额。

#### 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		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30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	28,860,230.96	846,328.35	5,974,934.78	808,959.16

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本集合计划均无其他关联交易事项的说明。

#### 6.4.11 利润分配情况

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
61,074,836.26	55,932.41	626,370.21	61,757,138.88	-

#### 6.4.12 期末（2024 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

注：本集合计划无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本集合计划本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本集合计划从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 305,693,000.00 元，于 2024 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本集合计划在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本集合计划本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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。

本计划管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、经营层及其下设的合规与风险控制委员会、合规与法务部和风控与稽核部、各业务部门和职能部门构成的风险管理架构体系。

##### 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。

本集合计划投资于一家上市公司发行的证券市值不超过集合计划资产净值的 10%，且本集合计划与由本集合计划管理人管理的其他全部公开募集性质的集合计划共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本集合计划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。

本集合计划的管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。其中单一机构发行的金融工具占集合计划资产净值的比例合计不得超过 2%。且本集合计划与由本集合计划的集合计划管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净资产的 10%。

由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不在下表进行列示。

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	3,198,696,956.09	1,060,231,681.13
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	3,198,696,956.09	1,060,231,681.13

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	1,622,359,100.35	2,417,781,565.96
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	1,622,359,100.35	2,417,781,565.96

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合计划份额持有人可随时要求赎回其持有的集合计划份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

#### 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、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。

本集合计划所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在 6.4.12 中列示的部分集合计划资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过资产净值的 15%。此外，本集合计划可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过集合计划持有的债券资产的公允价值。

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

市场风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本集合计划主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本集合计划的管理人每日通过“影子定价”对本集合计划面临的市场风险进行监控，定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	3,108,222,179.82	401,015,472.32	-	-	3,509,237,652.14
结算备付金	35,550,402.29	-	-	-	35,550,402.29
存出保证金	338,888.63	-	-	-	338,888.63
交易性金融资产	3,867,068,914.82	957,027,202.80	-	-	4,824,096,117.62
买入返售金融资产	1,086,693,550.88	-	-	-	1,086,693,550.88
应收清算款	-	-	-	54,797,377.64	54,797,377.64
资产总计	8,097,873,936.44	1,358,042,675.12	-	54,797,377.64	9,510,713,989.20
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	4,440,753.23	4,440,753.23
应付托管费	-	-	-	403,704.84	403,704.84
应付清算款	-	-	-	18,819,493.15	18,819,493.15
卖出回购金融资产款	305,693,000.00	-	-	-	305,693,000.00
应付销售服务费	-	-	-	2,018,524.19	2,018,524.19
应付利润	-	-	-	4,889,271.55	4,889,271.55
应交税费	-	-	-	165,328.16	165,328.16
其他负债	-	-	-	143,637.55	143,637.55
负债总计	305,693,000.00	-	-	30,880,712.67	336,573,712.67
利率敏感度缺口	7,792,180,936.44	1,358,042,675.12	-	23,916,664.97	9,174,140,276.53
<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>6 个月以内</b>	<b>6 个月-1 年</b>	<b>1-5 年</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
货币资金	2,917,453,201.79	-	-	-	2,917,453,201.79
结算备付金	13,188,572.53	-	-	-	13,188,572.53
存出保证金	548,603.15	-	-	-	548,603.15
交易性金融资产	3,034,957,037.85	606,563,546.42	-	-	3,641,520,584.27

买入返售金融资产	18,805,077.32	-	-	-	18,805,077.32
资产总计	5,984,952,492.64	606,563,546.42	-	-	6,591,516,039.06
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	3,251,132.98	3,251,132.98
应付托管费	-	-	-	295,557.52	295,557.52
应付清算款	-	-	-	250,084,986.24	250,084,986.24
卖出回购金融资产款	452,195,094.33	-	-	-	452,195,094.33
应付销售服务费	-	-	-	1,477,787.71	1,477,787.71
应付利润	-	-	-	4,262,901.34	4,262,901.34
应交税费	-	-	-	88,128.10	88,128.10
其他负债	-	-	-	179,887.06	179,887.06
负债总计	452,195,094.33	-	-	259,640,380.95	711,835,475.28
利率敏感度缺口	5,532,757,398.31	606,563,546.42	-	-259,640,380.95	5,879,680,563.78

注：上表统计了本集合计划面临的利率风险敞口，表中所示为本集合计划资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 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		
	利率曲线平行移动		
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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率下降25个基点	3,762,412.48	3,486,779.36
市场利率上升25个基点	-3,753,245.69	-3,479,252.73	

#### 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。本集合计划未持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此不存在相应的外汇风险。

#### 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债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项

的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，本集合计划各类资产的投资比例范围为：1、现金；2、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、中央银行票据、同业存单；3、期限在 1 个月以内的债券回购；4、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券；5、中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本集合计划通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本集合计划的管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

#### 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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	4,824,096,117.62	3,641,520,584.27
第三层次	-	-
合计	4,824,096,117.62	3,641,520,584.27

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划本期及上年度可比期间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**

于 2024 年 6 月 30 日，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，其账面价值与公允价值相差很小。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至 2024 年 6 月 30 日，本集合计划无需要披露的其他重要事项。

**§ 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	4,824,096,117.62	50.72
	其中：债券	4,824,096,117.62	50.72
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	1,086,693,550.88	11.43
	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	3,544,788,054.43	37.27
4	其他各项资产	55,136,266.27	0.58
5	合计	9,510,713,989.20	100.00

**7.2 债券回购融资情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.20	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	305,693,000.00	3.33
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占集合计划资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

**债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明**

注：在本报告期内本集合计划债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 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	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	60

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本集合计划投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

#### 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	36.04	3.54
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	21.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	5.67	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	4.03	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	35.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	103.21	3.54

#### 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

注：本报告期未发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	440,829,091.22	4.81
	其中：政策性金融债	3,040,061.18	0.03
4	企业债券	72,002,405.28	0.78
5	企业短期融资券	2,586,776,982.05	28.20

6	中期票据	102,128,538.72	1.11
7	同业存单	1,622,359,100.35	17.68
8	其他	-	-
9	合计	4,824,096,117.62	52.58
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)	按实际利率计算的账面价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	188387	21 招证 G5	1,000,000	103,149,023.01	1.12
2	112413023	24 浙商银行 CD023	1,000,000	99,732,875.88	1.09
3	112312160	23 北京银行 CD160	1,000,000	99,276,070.41	1.08
4	112416091	24 上海银行 CD091	1,000,000	99,223,693.12	1.08
5	112499413	24 杭州银行 CD096	1,000,000	99,195,309.28	1.08
6	112403129	24 农业银行 CD129	1,000,000	98,735,430.94	1.08
7	112417028	24 光大银行 CD028	1,000,000	98,725,170.61	1.08
8	112403026	24 农业银行 CD026	1,000,000	98,713,541.88	1.08
9	112403039	24 农业银行 CD039	1,000,000	98,630,880.27	1.08
10	112403157	24 农业银行 CD157	1,000,000	98,611,456.77	1.07

### 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	0.0476%
报告期内偏离度的最低值	-0.0124%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0180%

注：以上数据根据报告期内交易日数据统计。

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明

注：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% 的情况。

## 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：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%的情况。

## 7.8 期末按实际利率计算的账面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

注：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

鉴于货币市场基金的特性，本集合计划采用摊余成本法计算集合计划资产净值，即本集合计划按持有债券投资的票面利率或商定利率每日计提应收利息，并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价，以摊余的成本计算集合计划资产净值。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或交易市价计算的集合计划资产净值发生重大偏离，从而对持有人的利益产生稀释或不公平的结果，集合计划管理人采用“影子定价”，即于每一计价日采用市场利率和交易价格对集合计划持有的计价对象进行重新评估，当集合计划资产净值与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，应按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整，调整差额确认为“公允价值变动损益”，并按其他公允价值指标进行后续计量。如集合计划份额净值恢复至 1.00 元，可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，集合计划管理人可根据具体情况，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

### 7.9.2 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

本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，招商证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到证监会、深交所、税务局的处罚；浙商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到金融监管总局、央行、外汇管理局、税务局的处罚；北京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到金融监管总局、央行、外汇管理局的处罚；上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到金融监管总局、外汇管理局的处罚；杭州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到金融监管总局、外汇管理局、证监会的处罚；中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到金融监管总局、外汇管理局、央行、税务局、安监局、工商局的处罚；中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到金融监管总局、外汇管理局、央行、工商局的处罚。

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及产品合同的要求。

## 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	338,888.63
2	应收清算款	54,797,377.64
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	55,136,266.27

## 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（%）
95,022	96,547.54	1,604,715,688.20	17.49	7,569,424,588.33	82.51

## 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	券商类机构	670,629,846.14	7.31
2	基金类机构	186,787,669.19	2.04
3	基金类机构	150,932,845.35	1.65
4	个人	94,058,410.90	1.03
5	其他机构	46,517,680.92	0.51
6	个人	42,008,398.09	0.46
7	其他机构	39,819,771.59	0.43
8	个人	36,778,718.44	0.40
9	基金类机构	36,346,980.44	0.40
10	个人	35,743,877.43	0.39

## 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	165,920.28	0.0018

## 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 5 月 31 日） 基金份额总额	6,342,810,619.93
本报告期期初基金份额总额	5,879,680,563.78
本报告期基金总申购份额	98,967,598,402.26
减：本报告期基金总赎回份额	95,673,138,689.51
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,174,140,276.53

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无集合计划份额持有人大会决议。

### 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

- 2024 年 1 月 5 日，经董事会审议通过，路颖女士自 2024 年 1 月 5 日起担任上海海通证券资产管理有限公司董事长。
- 2024 年 3 月 19 日，经董事会审议通过，曾丽琼女士自 2024 年 3 月 19 日起不再担任上海海通证券资产管理有限公司总经理助理。
- 本报告期内，集合计划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

- 因金融委托理财合同纠纷，四川信托有限公司向四川省成都市中级人民法院起诉，要求上海海通证券资产管理有限公司等多个被告返还或赔偿原告委托财产 51,455 万元及相应利息。2023 年 9 月 27 日法院作出一审判决，判决驳回原告对海通资管的所有诉讼请求。上诉期内原告提起上诉，目前案件正在二审程序中。
- 报告期内未发生涉及集合计划托管业务的重大诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

无。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内集合计划管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：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。

### 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 (%)	
海通证券	2	-	-	-	-	-

#### 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 (%)
海通证券	1,487,683,700.00	100.00	17,228,741,000.00	100.00	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

注：本报告期内未发生偏离度绝对值超过 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	海通现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定披露媒介	2024 年 6 月 19 日
2	海通现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定披露媒介	2024 年 5 月 17 日
3	海通现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定披露媒介	2024 年 4 月 17 日
4	关于海通现金宝货币型集合资产管理计划调整“快速取现”额度的公告	规定披露媒介	2024 年 3 月 27 日
5	海通现金宝货币型集合资产管理计划	规定披露媒介	2024 年 3 月 19 日

	收益支付公告		
6	海通现金宝货币型集合资产管理计划 收益支付公告	规定披露媒介	2024 年 2 月 21 日
7	海通现金宝货币型集合资产管理计划 收益支付公告	规定披露媒介	2024 年 1 月 17 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

注：本集合计划报告期内无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，未发现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

- (一) 中国证监会准予海通现金赢家集合资产管理计划变更的文件
- (二) 《海通现金宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》
- (三) 《海通现金宝货币型集合资产管理计划托管协议》
- (四) 管理人业务资格批件、营业执照
- (五) 托管人业务资格批件、营业执照
- (六) 关于申请《海通现金赢家集合资产管理计划资产管理合同变更》的法律意见
- (七) 中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本集合计划管理人：上海海通证券资产管理有限公司  
客户服务中心电话：95553

上海海通证券资产管理有限公司

2024 年 8 月 30 日