

# 国海证券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：国海证券股份有限公司

基金托管人：中国证券登记结算有限责任公司

送出日期：2024 年 8 月 30 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。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 7 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 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.....	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>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	14
6.4 报表附注.....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 债券回购融资情况.....	46
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	47
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.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	48

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.....	48
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.....	49
7.9 投资组合报告附注.....	49
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	53
10.9 其他重大事件.....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>54</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.....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国海证券现金宝货币型集合资产管理计划
基金简称	国海现金宝
场内简称	-
基金主代码	970175
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 7 月 4 日
基金管理人	国海证券股份有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司
报告期末基金份额总额	2,811,480,857.44 份
基金合同存续期	3 年

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。国海证券现金宝货币型集合资产管理计划以下简称“本集合计划”、“本基金”或“国海现金宝”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	基于客户交易结算账户留存资金及其波动特点，在保证投资者资产安全性、流动性的前提下，将客户账户中的闲置资金集中投资于低风险且具有一定收益的投资品种，提高投资者资产收益率，力争为投资人提供稳定的收益。
投资策略	<p>1、利率策略</p> <p>本集合计划将首先采用“自上而下”的研究方法，综合研究主要经济变量指标、分析宏观经济情况，建立经济前景的情景模拟，进而判断财政政策、货币政策等宏观经济政策取向。同时，本集合计划还将分析金融市场资金供求状况变化趋势，对影响资金面的因素进行详细分析与预判，建立资金面的场景模拟。</p> <p>在宏观分析与流动性分析的基础上，结合历史与经验数据，确定当前资金的时间价值、通货膨胀补偿、流动性溢价等要素，得到当前宏观与流动性条件下的均衡收益率曲线。区分当前利率债收益率曲线期限利差、曲率与券间利差所面临的历史分位，然后通过市场收益率曲线与均衡收益率曲线的对比，判断收益率曲线参数变动的程度和概率，确定组合的平均剩余期限，并据此动态调整投资组合。</p> <p>2、骑乘策略</p> <p>当市场利率期限结构向上倾斜并且相对较陡时，投资并持有债券一段时间，随着时间推移，债券剩余年限减少，市场同样年限的债券收益率较低，这时将债券按市场价格出售，投资人除了获得债券利息以外，还可以获得资本利得。在多数情况下，这样的骑乘操作策</p>

	略可以获得比持有到期更高的收益。 3、放大策略 放大策略即以组合现有债券为基础，利用买断式回购、质押式回购等方式融入资金，并购买剩余年限相对较长的债券，以期获取超额收益的操作方式。在回购利率过高、流动性不足、或者市场状况不宜采用放大策略等情况下，本计划将适时降低杠杆投资比例。 4、个券选择策略 在个券选择层面，首先从安全性角度出发，优先选择央票、短期国债等高信用等级、剩余期限和流动性（流通总量、日均交易量）进行初步筛选；然后，根据各券种的收益率与剩余期限的结构合理性，评估其投资价值，进行再次筛选；最后，根据各券种的到期收益率波动性与可投资量（发行总量、流通量、上市时间），决定具体投资比例。
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	本集合计划的类型为货币型集合资产管理计划，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。

### 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	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露 负责人	姓名	陈嘉斌	陈晨
	联系电话	010-88576333	010-50938723
	电子邮箱	chenjb02@ghzq.com.cn	zctg@chinaclear.com.cn
客户服务电话		95563	4008058058
传真		021-60338151	-
注册地址		广西桂林市辅星路 13 号	北京市西城区太平桥大街 17 号
办公地址		上海市黄浦区中山南路 988 号绿地外滩中心 C1 栋国海证券大厦 9 层	北京市西城区锦什坊街 26 号
邮政编码		200010	100033
法定代表人		何春梅	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	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区锦什坊街 26 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	16,184,427.67
本期利润	16,184,427.67
本期净值收益率	0.5824%
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	2,811,480,857.44
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	2.5667%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币型集合资产管理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、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、本集合计划收益采用“每日分配、按月支付”的方式，收益支付方式为现金分红。

#### 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

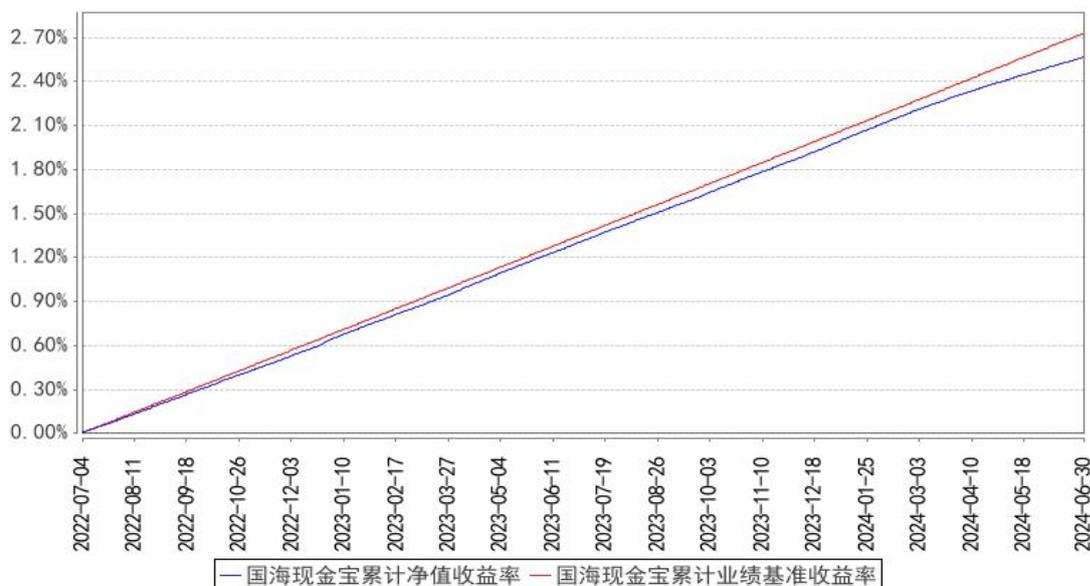
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.0820%	0.0001%	0.1110%	0.0000%	-0.0290%	0.0001%
过去三个月	0.2566%	0.0002%	0.3371%	0.0000%	-0.0805%	0.0002%
过去六个月	0.5824%	0.0004%	0.6754%	0.0000%	-0.0930%	0.0004%
过去一年	1.2481%	0.0004%	1.3629%	0.0000%	-0.1148%	0.0004%
自基金合同生效起至今	2.5667%	0.0003%	2.7291%	0.0000%	-0.1624%	0.0003%

注：1、本基金为由“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”公募化改造来的产品，于 2022 年 7 月 4 日正式变更生效。

2、本集合计划收益采用“每日分配、按月支付”的方式，收益支付方式为现金分红。

### 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

国海现金宝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



注：本集合计划业绩比较基准收益率为同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

### 3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
-	-
其他指标	报告期末（2024 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 2024 年 6 月末，公司在全国 22 个省级

区域设有 31 家分公司、88 家营业部，控股国海富兰克林基金管理有限公司、国海良时期货有限公司，全资设立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、资产管理、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。

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 2024 年 6 月 30 日，旗下四只大集合产品均已完成公募化改造，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”、“国海证券现金宝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		
王力	本基金的基金经理	2022 年 7 月 4 日	-	9 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经理、国海证券安盈债券型集合资产管理计划、国海六个月滚动债券型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。

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
-	公募基金	-	-	-

私募资产管理计划	-	-	-
其他组合	-	-	-
合计	-	-	-

注：本基金基金经理兼任两只根据《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产管理计划投资经理，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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国海证券股份有限公司资产管理业务公平交易制度》的规定。

### 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

2024 年上半年经济增速表现符合预期，并且达到预期增速目标 5.0%。上半年 CPI 同比上涨 0.1%，其中二季度上涨 0.3%；核心 CPI 基本稳定。中国债券牛市延续，与风险资产形成跷跷板效应。利率债方面，10 年期国债收益率下行至 2.23% 低点，小幅回调后低位窄幅震荡。信用债收益率依然呈现波动下行态势，信用利差全面收窄，中低等级利差收窄幅度更大。

投资策略上，本基金将继续坚持采用稳健谨慎的投资操作策略，依旧以高等级同业存单、高评级信用债为持仓资产，根据资金面情况择机把握同业存单和信用债的波段操作，并继续把基金资产收益性、安全性和流动性作为突出考虑的因素，争取为投资者创造稳定收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本集合计划份额净值收益率为 0.5824%，同期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

国内经济持续复苏势头仍然有望延续，但复苏斜率仍然需要继续观察，特别是要跟踪地产行业的复苏力度，以及海外下半年旺季出口的韧性。债券市场方面预计利率维持低位运行，信用债市场中短端可能较为拥挤，可适当拉长久期。

#### 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，以及合同对估值程序的相关约定，对所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、份额净值的计算由管理人独立完成，并与托管人进行账务核对，经托管人复核无误后，由管理人对外公布。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金在本报告期累计分配收益 16,184,427.67 元，均计入应付利润科目。以上符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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

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，本托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国海证券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	2,029,903,840.07	1,325,623,707.24
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	398,876,344.68	1,001,498,617.67
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		398,876,344.68	1,001,498,617.67
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	387,074,046.59	-
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		-	-
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		2,815,854,231.34	2,327,122,324.91
<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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,342,785.24	1,236,734.06
应付托管费		122,071.38	112,430.37
应付销售服务费		488,285.52	449,721.48
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		2,275,162.90	3,024,386.70
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	145,068.86	179,915.00
负债合计		4,373,373.90	5,003,187.61
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	2,811,480,857.44	2,322,119,137.30
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		2,811,480,857.44	2,322,119,137.30
负债和净资产总计		2,815,854,231.34	2,327,122,324.91

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,811,480,857.44 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国海证券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>		27,467,682.67	30,675,185.40
1. 利息收入		20,089,955.66	19,164,756.97
其中：存款利息收入	6.4.7.13	20,017,142.57	19,102,738.43
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		72,813.09	62,018.54
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,377,727.01	11,510,428.43
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	7,377,727.01	11,510,428.43
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	-	-
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>		11,283,255.00	11,568,154.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,676,457.31	7,885,263.04
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	697,859.79	716,842.10
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,791,438.95	2,838,198.56
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	10,471.76
8. 其他费用	6.4.7.23	117,498.95	117,378.88
<b>三、利润总额(亏损总额 以“-”号填列)</b>		16,184,427.67	19,107,031.06
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-” 号填列)</b>		16,184,427.67	19,107,031.06
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		16,184,427.67	19,107,031.06

### 6.3 净资产变动表

会计主体：国海证券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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,322,119,137.30	-	-	2,322,119,137.30
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,322,119,137.30	-	-	2,322,119,137.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	489,361,720.14	-	-	489,361,720.14
（一）、综合收益总额	-	-	16,184,427.67	16,184,427.67
（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）	489,361,720.14	-	-	489,361,720.14
其中：1. 基金申购款	32,391,732,851.20	-	-	32,391,732,851.20
2. 基金赎回款	-31,902,371,131.06	-	-	-31,902,371,131.06
（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）	-	-	-16,184,427.67	-16,184,427.67
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,811,480,857.44	-	-	2,811,480,857.44
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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,365,995,041.52	-	-	2,365,995,041.52

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,365,995,041.52	-	-	2,365,995,041.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	263,641,808.32	-	-	263,641,808.32
（一）、综合收益总额	-	-	19,107,031.06	19,107,031.06
（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）	263,641,808.32	-	-	263,641,808.32
其中：1. 基金申购款	33,453,169,549.88	-	-	33,453,169,549.88
2. 基金赎回款	-33,189,527,741.56	-	-	-33,189,527,741.56
（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）	-	-	-19,107,031.06	-19,107,031.06
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,629,636,849.84	-	-	2,629,636,849.84

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

国海证券现金宝货币型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)由原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变更而来。原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为现金管理产品,自 2013 年 5 月 2 日起开始募集并于 2013 年 5 月 17 日结束募集,于 2013 年 5 月 20 日成立,2013 年 5 月 31 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证券金贝壳稳德利保证金现金管理集合资产管理计划的备案确认函》(中证协函[2013]527 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,《国海证券现金宝货币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《国海证券金贝壳稳德利保证金现金管理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,本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。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》和集合计划合同的有关规定,本集合计划主要投资于以下金融工具: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。

本财务报表以本集合计划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

本集合计划财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本集合计划于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年半年度的经营成果和净值变动情况。

#### 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

本基金报告期所采用的会计政策、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。

#### 6.4.5 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。

#### 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	2,029,903,840.07
等于：本金	2,028,732,691.04
加：应计利息	1,171,149.03
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	2,029,903,840.07

##### 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	-	-	-	-
	银行间市场	398,876,344.68	398,920,000.00	43,655.32	0.0016
	-	-	-	-	-
	合计	398,876,344.68	398,920,000.00	43,655.32	0.0016
资产支持证券		-	-	-	-
合计		398,876,344.68	398,920,000.00	43,655.32	0.0016

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/基金资产净值。

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：本基金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

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				-

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

### 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				-

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 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	387,074,046.59	-
-	-	-
合计	387,074,046.59	-

#### 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 2024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					-	-	-

注：本基金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

无。
----

### 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 2024年6月30日

		初始成本	利息调整	应计利息	减：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		-	-	-	-	-

注：本基金本报告期期末未持有债权投资。

#### 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 2024 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 2024 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
-	-	-	-
合计	-	-	-

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

## 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 2024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 2024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 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	1,233.50
其中：交易所市场	-
银行间市场	1,233.50
-	-
应付利息	-
预提费用	143,835.36
合计	145,068.86

## 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	2,322,119,137.30	2,322,119,137.30

本期申购	32,391,732,851.20	32,391,732,851.20
本期赎回（以“-”号填列）	-31,902,371,131.06	-31,902,371,131.06
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	2,811,480,857.44	2,811,480,857.44

#### 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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	16,184,427.67	-	16,184,427.67
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	-16,184,427.67	-	-16,184,427.67
本期末	-	-	-

#### 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	19,969,142.57	
定期存款利息收入	48,000.00	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	-	
其他	-	
合计	20,017,142.57	

注：报告期内本集合计划未发生提前支取定期存款而产生利息损失的情况。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额	-	
减：卖出股票成本总额	-	
减：交易费用	-	
买卖股票差价收入	-	

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 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	7,377,727.01	
债券投资收益——买卖债券（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	7,377,727.01
----	--------------

#### 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	610,000,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	610,000,000.00
减：应计利息总额	-
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-

#### 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 2024年1月1日至2024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 2024年1月1日至2024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 2024年1月1日至2024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	-

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 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 2024年1月1日至2024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 2024年1月1日至2024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 2024年1月1日至2024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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-

注：本基金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

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
-	-

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-

注：本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-
股票投资	-
债券投资	-
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	-

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
-	-
合计	-

#### 6.4.7.22 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	14,363.59
账户维护费	18,600.00
合计	117,498.95

#### 6.4.7.24 分部报告

截至本期末，本集合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，本集合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，本集合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
中国证券登记结算有限责任公司	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

无。

### 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 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	
	成交金 额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
-	-	-	-	-

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	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（%）
-	-	-	-	-

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 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 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
-	-	-

	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 (%)
-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期权证 成交总额的比 例 (%)
-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 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 2024年1月1日至2024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 总量的比例 (%)
-	-	-	-	-
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 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 总量的比例 (%)
-	-	-	-	-

注：本基金本报告期间无应付关联方的佣金。

#### 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	7,676,457.31	7,885,263.04
其中：应支付销售机构的客户维护 费	3,838,228.66	-
应支付基金管理人的净管理费	3,838,228.65	7,885,263.04

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，管理人将下调管理费率为 0.3%，以降低每万份集合计划暂估净收益为负并引发证券交收透支的风险，直至该类风险消除，管理人方可恢复计提 0.55% 的管理费。

集合计划管理费每日计提，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，由托管人于次月前 5 个交易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 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	697,859.79	716,842.10

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% 的年费率计提。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。经管理人与托管人核对一致后，由托管人于次月前 10 个交易日内从集合计划财产中一次性支取。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 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
	国海现金宝
国海证券	2,791,438.95
合计	2,791,438.95
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
	国海现金宝
国海证券	2,838,198.56
合计	2,838,198.56

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 0.2% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划销售服务费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划销售服务费每日计提，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，由托管人于次月前 5 个交易日内从集合计划财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
-	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内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 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
	基金合同生效日（2022 年 7 月 4 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	-	-

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
-	-	-	-	-

注：报告期末除基金管理人之外无其他关联方投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	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	
	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	475,948,568.24	6,819,076.25	4,734,440.02	1,844,131.85

注：本集合计划的银行存款由集合计划托管人中国证券登记结算有限责任公司保管，按同业利率计息。

6.4.10.6 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 2024年1月1日至2024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： 股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023年1月1日至2023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： 股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 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
-	16,933,651.47	-749,223.80	16,184,427.67	-

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

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：本基金本报告期末无因认购新发/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

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

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：本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

#### 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

集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；本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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日

A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有短期信用评级的债券投资。

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有长期信用评级的债券。

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	398,876,344.68	1,001,498,617.67
合计	398,876,344.68	1,001,498,617.67

注：本表主要列示同业存单，评级取自第三方评级机构的主体评级。

#### 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 2024 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	合计
资产				
-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	-
负债				
-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-
流动性净额	-	-	-	-
上年度末 2023 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	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。

本集合计划主要投资于交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款等利率敏感性资产，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
资产					
货币资金	2,029,903,840.07	-	-	-	2,029,903,840.07
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	398,876,344.68	-	-	-	398,876,344.68
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	387,074,046.59	-	-	-	387,074,046.59
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,815,854,231.34	-	-	-	2,815,854,231.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,342,785.24	1,342,785.24
应付托管费	-	-	-	122,071.38	122,071.38
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	488,285.52	488,285.52
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	2,275,162.90	2,275,162.90
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	145,068.86	145,068.86
负债总计	-	-	-	4,373,373.90	4,373,373.90
利率敏感度缺口	2,815,854,231.34	-	-	-4,373,373.90	2,811,480,857.44
上年度末 2023 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
货币资金	1,325,623,707.24	-	-	-	1,325,623,707.24
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	606,530,267.95	394,968,349.72	-	-	1,001,498,617.67
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,932,153,975.19	394,968,349.72	-	-	2,327,122,324.91

负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,236,734.06	1,236,734.06
应付托管费	-	-	-	112,430.37	112,430.37
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	449,721.48	449,721.48
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	3,024,386.70	3,024,386.70
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	179,915.00	179,915.00
负债总计	-	-	-	5,003,187.61	5,003,187.61
利率敏感度缺口	1,932,153,975.19	394,968,349.72	-	-5,003,187.61	2,322,119,137.30

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（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	147,540.50	985,050.18
	市场利率上升25个基点	-147,428.56	-982,588.01

#### 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。

#### 6.4.13.4.3 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 2024年6月30日	上年度末 2023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	398,876,344.68	14.19	1,001,498,617.67	43.13
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	398,876,344.68	14.19	1,001,498,617.67	43.13

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-		
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）
	-	-	-

注：本基金主要投资于固定收益类金融工具，主要风险为利率风险和信用风险，其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响。

#### 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31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	398,876,344.68	1,001,498,617.67
第三层次	-	-
合计	398,876,344.68	1,001,498,617.67

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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及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

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，除

债权投资外，其余金融工具因其剩余期限较短，因此账面价值与公允价值相若。

#### 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	固定收益投资	398,876,344.68	14.17
	其中：债券	398,876,344.68	14.17
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	387,074,046.59	13.75
	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	2,029,903,840.07	72.09
-	-	-	-
4	其他各项资产	-	-
5	合计	2,815,854,231.34	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	-	-
	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	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：本基金本报告期末未有债券回购融资余额。

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资 产净值比例 (%)	原因	调整期
-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的情况。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	8
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	55
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	8

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限（天数）	原因	调整期
-	-	-	-	-

注：本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

#### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	85.92	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	14.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	-	-
	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）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.11	-

#### 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

序号	发生日期	平均剩余期限（天数）	原因	调整期
-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内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	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	398,876,344.68	14.19
-	-	-	-
8	其他	-	-
9	合计	398,876,344.68	14.19
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	112311122	23 平安银行 CD122	2,000,000	199,438,172.34	7.09
2	112317193	23 光大银行 CD193	2,000,000	199,438,172.34	7.09

### 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	0.0051%
报告期内偏离度的最低值	-0.0410%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0110%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
-	-	-	-	-

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
-	-	-	-	-

### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：本基金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

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

#### 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

无。

#### 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	-
2	应收清算款	-
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	-

#### 7.9.4 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

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 (%)
33,947	82,819.71	107,107,938.40	3.81	2,704,372,919.04	96.19

## 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	31,836,571.00	1.13
2	基金类机构	28,204,862.44	1.00
3	个人	18,933,691.51	0.67
4	个人	16,581,405.03	0.59
5	其他机构	12,069,252.38	0.43
6	个人	10,291,403.10	0.37
7	基金类机构	10,212,381.43	0.36
8	个人	9,743,078.56	0.35
9	个人	9,313,222.63	0.33
10	个人	9,208,852.16	0.33

## 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	13,586,509.97	0.48

## 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2022 年 7 月 4 日) 基金份额总额	1,533,752,173.38
本报告期期初基金份额总额	2,322,119,137.30
本报告期基金总申购份额	32,391,732,851.20
减：本报告期基金总赎回份额	31,902,371,131.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,811,480,857.44

## § 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

基金管理人本报告期基金管理人重大人事变动如下：

2024 年 2 月 1 日，公司召开第十届董事会第一次会议，聘任度万中先生为公司总裁，度万中先生自 2024 年 2 月 1 日起正式履行总裁职责；聘任汪成接先生为公司副总裁，汪成接先生自 2024 年 2 月 1 日起正式履行副总裁职责；聘任张宁先生为公司首席信息官，张宁先生自 2024 年 2 月 1 日起正式履行首席信息官职责；因任期届满，蒋健先生自 2024 年 2 月 1 日起不再担任公司副总裁，温力先生自 2024 年 2 月 1 日起不再担任公司首席信息官。

本报告期内，本托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

## 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

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-
采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-
受到稽查或处罚等措施的原因	-
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-
采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-
受到稽查或处罚等措施的原因	-
管理人采取整改措施的情况（如	-

提出整改意见)	
其他	-

注：本报告期内，管理人及其高级管理人员未因资产管理业务受到稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-
采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-
受到稽查或处罚等措施的原因	-
托管人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-
采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-
受到稽查或处罚等措施的原因	-
托管人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-

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 (%)	
-	-	-	-	-	-	-

### 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 (%)

-	-	-	-	-	-	-
---	---	---	---	---	---	---

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

项目	发生日期	偏离度	法定披露报刊	法定披露日期
报告期内偏离度绝对值在 0.5%（含）以上	-	-	-	-

注：本基金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	国海证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 1 月 3 日
2	国海证券现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告（2024 年 1 月）	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 1 月 3 日
3	关于国海证券现金宝货币型集合资产管理计划“快速取现”服务额度调整的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 1 月 5 日
4	国海证券股份有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划 2023 年第四季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2024 年 1 月 22 日
5	国海证券现金宝货币型集合资产管理计划 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定网站	2024 年 1 月 22 日
6	国海证券现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告（2024 年 2 月）	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 2 月 2 日
7	国海证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 2 月 6 日
8	国海证券现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告（2024 年 3 月）	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 3 月 4 日
9	关于国海证券现金宝货币型集合资产管理计划“快速取现”服务额度调整的公告（2024 年 3 月 20 日）	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 3 月 20 日
10	国海证券股份有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2024 年 3 月 29 日
11	国海证券现金宝货币型集合资产管理计划 2023 年年度报告	中国证监会规定网站	2024 年 3 月 29 日
12	国海证券现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告（2024 年 4 月）	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 4 月 2 日
13	关于国海证券现金宝货币型集合资产管理计划“快速取现”服务额度调整的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 4 月 19 日
14	国海证券股份有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计	中国证监会规定报刊	2024 年 4 月 22 日

	划 2024 年第一季度报告提示性公告		
15	国海证券现金宝货币型集合资产管理计划 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定网站	2024 年 4 月 22 日
16	国海证券现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告（2024 年 5 月）	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 5 月 7 日
17	国海证券现金宝货币型集合资产管理计划基金产品资料概要更新（2024 年 5 月）	中国证监会规定网站	2024 年 5 月 31 日
18	国海证券现金宝货币型集合资产管理计划招募说明书更新（2024 年 5 月）	中国证监会规定网站	2024 年 5 月 31 日
19	国海证券现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告（2024 年 6 月）	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 6 月 4 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							
-							

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金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

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

(1) 中国证监会关于准予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合同变更的回函；

(2) 《国海证券现金宝货币型集合资产管理计划招募说明书》；

(3) 《国海证券现金宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》；

- (4) 《国海证券现金宝货币型集合资产管理计划托管协议》;
- (5) 《国海证券现金宝货币型集合资产管理计划产品资料概要》;
- (7) 集合计划管理人业务资格批件、营业执照;
- (8) 国海证券现金宝货币型集合资产管理计划报告期内披露的各项公告;
- (9) 中国证监会要求的其他文件。

## 12.2 存放地点

上海市黄浦区中山南路 988 号绿地外滩中心 C1 栋国海证券大厦 9 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

2024 年 8 月 30 日