

东海证券现金管家现金管理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：东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

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

集合计划托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本集合计划合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	7
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.....	9
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.....	10
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.....	10
§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
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的真实、准确和完整发表意见.....	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 债券回购融资情况.....	35
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	36
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.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
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.....	37
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.....	37
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.....	38
7.9 投资组合报告附注.....	38
§8 基金份额持有人信息.....	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
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.....	39
§9 开放式基金份额变动.....	39
§10 重大事件揭示.....	39
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
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.....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4 基金投资策略的改变.....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
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.....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	41
10.9 其他重大事件.....	41
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	42
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.....	42
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	42
§12 备查文件目录.....	42
12.1 备查文件目录.....	42
12.2 存放地点.....	42
12.3 查阅方式.....	42

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东海证券现金管家现金管理型集合资产管理计划
基金简称	东海证券现金管家
基金主代码	970162
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 7 月 1 日
基金管理人	东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	506,209,133.14 份
基金合同存续期	本集合计划存续期限自合同生效至本合同终止之间的期限。本集合计划自本集合计划合同变更生效日起存续期不得超过 3 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的收益。
投资策略	本集合计划的主要投资策略包括： 1、整体资产配置策略； 2、类属资产配置策略； 3、个券选择策略； 4、流动性管理策略； 5、套利策略； 6、回购策略。
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市场型集合计划，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。

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		东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	高宇	陈晨
	联系电话	95531	010-50938723
	电子邮箱	gyu@longone.com.cn	zctg@chinaclear.com.cn
客户服务电话		95531	4008-058-058
传真		021-50498827	-
注册地址		江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层	北京市西城区太平桥大街 17 号
办公地址		上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦	北京市西城区锦什坊街 26 号
邮政编码		200125	100033

法定代表人	王文卓	于文强
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.longone.com.cn
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	3,695,930.06
本期利润	3,695,930.06
本期净值收益率	0.8050%
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	506,209,133.14
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	2.7498%

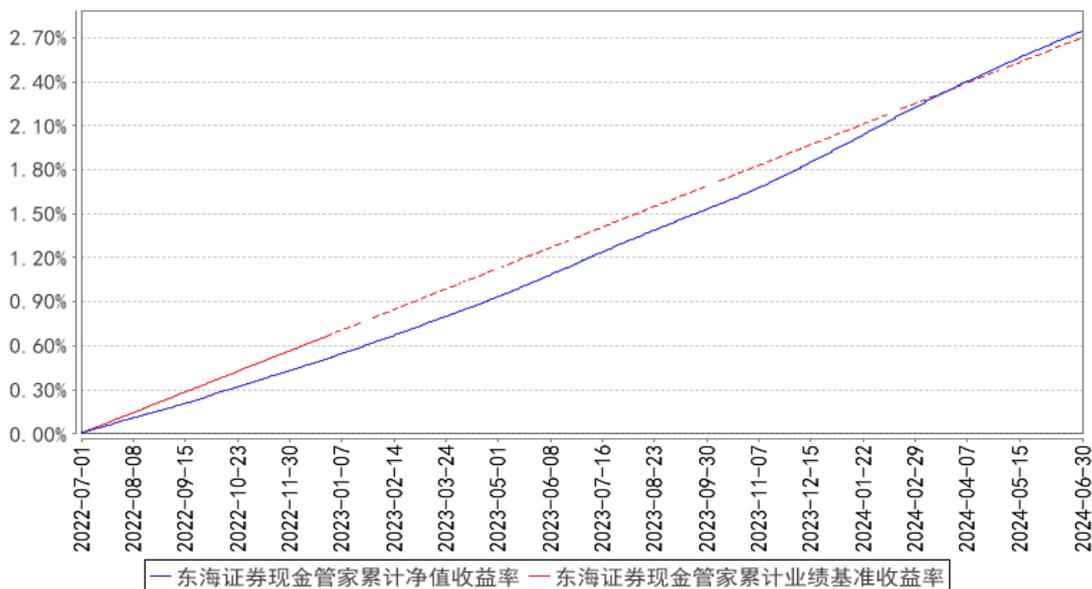
3.2 基金净值表现

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	0.1173%	0.0001%	0.1110%	0.0000%	0.0063%	0.0001%
过去三个月	0.3707%	0.0002%	0.3366%	0.0000%	0.0341%	0.0002%
过去六个月	0.8050%	0.0004%	0.6732%	0.0000%	0.1318%	0.0004%
过去一年	1.5579%	0.0005%	1.3537%	0.0000%	0.2042%	0.0005%
自基金合同生效起至今	2.7498%	0.0007%	2.7037%	0.0000%	0.0461%	0.0007%

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

东海证券现金管家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：（1）本集合计划合同生效日为 2022 年 07 月 01 日，图示日期为 2022 年 07 月 01 日至 2024 年 6 月 30 日；

（2）本集合计划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；超短期融资券的主体信用评级应当为最高级。信用评级主要参照最近一个会计年度的信用评级，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。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。

§ 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

东海证券成立于 1993 年，原名“常州证券”，是全国最早设立的综合性券商之一，2005 年成为全国首批 10 家创新试点券商之一；2015 年在全国中小企业股份转让系统挂牌。目前，公司注册资本为 18.56 亿元，客户数超百万。公司始终倡导“务实、创新、规范、协同”的价值理念，坚守稳健合规的经营理念，各项经营指标均符合监管要求。

东海证券 2005 年取得证监会出具的《关于东海证券有限责任公司客户资产管理业务资格的批复》（证监机构字[2005]77 号）批准从事客户资产管理业务的资格。

东海证券设立资产管理部，由资产管理部开展资产管理业务。为落实公募业务与私募业务相分离的监管要求，资产管理部设立专门的基金投资团队和专户投资团队，分别负责大集合产品和私募产品的投资运作；设置独立研究团队，提供投资研究支持，确保各个岗位保持独立，权责分明、互相制衡。

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		
朱晨飞	本集合计划的投资经理	2022 年 7 月 1 日	-	11 年	上海交通大学工商管理硕士，证券从业资格编号 S0630816100001，不曾被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施。2012 年进入东海证券，现任东海证券股份有限公司资产管理部投资经理；历任东海证券股份有限公司资产管理部运营经理、债券交易员。投资风格稳健，对于宏观、利率市场有很好的把握，严格控制流动性风险，注重信用研究。

注：1、本集合计划的投资经理朱晨飞自 2019 年 2 月 18 日起担任原东海证券现金管家集合资产管理计划投资经理。

2、集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为资产管理合同生效日，其“离职日期”根据公司决议确定的解聘日期；

3、非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

4、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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和集合计划合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在严格控制风险的前提下，为集合计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划无重大违法违规行为及违反集合计划合同约定的行为，未有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

本集合计划管理人一贯公平对待旗下管理的所有投资组合，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，本集合计划管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《东海证券股份有限公司资产管理部公平交易实施细则》等规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未出现涉及本集合计划的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。未发现本集合计划存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

央行公开市场操作方面，2024 年上半年逆回购投放 120690 亿元，逆回购到期 141580 亿元；MLF 投放 22890 亿元，MLF 到期 22910 亿元；央行票据互换发行 300 亿元，央行票据互换到期 300 亿元；开展国库现金定存操作 3400 亿元，国库现金定存到期 4500 亿元；合计净回笼 22010 亿元。银行间 1 天债券质押式回购利率加权平均值 1.8413%，银行间 7 天债券质押式回购利率加权平均值 1.9414%，资金面较为宽松。报告期内，本组合在保持流动性的基础上，通过操作积极增厚组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末东海证券现金管家现金管理型集合资产管理计划份额净值为 1.0000 元，本报告期内计划份额净值收益率为 0.8050%，同期业绩比较基准收益率为 0.6732%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度国内经济增速有所下行，在地产放松政策持续推出的情形下，地产销售和 investment 数据仍未有明显改善，对经济拖累较为明显；外需方面，受地缘政治和美国经济增速放缓的影响，下半年出口表现亦有较大不确定性，总体而言，基本面对债市有支撑，短期限债券利率风险较小。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，经公司执行委员会批准，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由财务、风险管理、运营等相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、资管产品投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、资管产品的风险控制与绩效评估、会计政策与资管产品核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。估值委员会审议并依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场环境相适应的估值方法，运营部应征询会计师事务所、集合计划托管人的相关意见。公司

按特殊流程改变估值技术时，导致集合计划资产净值的变化在 0.25% 以上的，应就集合计划管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见，会计师事务所应对公司所采用的相关估值模型、假设、参数及输入的适当性发表审核意见，同时公司按照相关法律法规要求履行信息披露义务。另外，对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，比如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的，应参照协会通知执行。可根据指引的指导意见，并经估值委员会审议，采用第三方估值机构提供的估值相关的数据服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本集合计划本报告期内实施利润分配两次，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

截至本报告期末，未出现连续二十个工作日计划份额持有人数量不满两百人和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，集合计划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，集合计划托管人根据《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

集合计划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：东海证券现金管家现金管理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
资产：			
货币资金	6.4.7.1	17,937,206.58	1,751,968.14
结算备付金		134,506.65	406,959.49
存出保证金		30,023.36	28,612.18
交易性金融资产	6.4.7.2	449,770,472.85	353,544,518.82
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		449,770,472.85	353,544,518.82
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	40,511,172.62	-
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		508,383,382.06	355,732,058.63
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
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		-	14,672,717.72
应付清算款		308,099.18	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		219,170.37	154,565.65
应付托管费		21,917.04	15,456.55
应付销售服务费		109,585.19	77,282.82
应付投资顾问费		-	-
应交税费		26,943.87	19,644.64
应付利润		1,447,972.55	1,421,924.19

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	40,560.72	169,021.19
负债合计		2,174,248.92	16,530,612.76
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	506,209,133.14	339,201,445.87
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		506,209,133.14	339,201,445.87
负债和净资产总计		508,383,382.06	355,732,058.63

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，东海证券现金管家集合计划份额总额 506,209,133.14 份，集合计划份额净值 1.0000 元。

6.2 利润表

会计主体：东海证券现金管家现金管理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
一、营业总收入		5,665,492.00	3,391,000.12
1. 利息收入		475,438.30	482,006.40
其中：存款利息收入	6.4.7.13	117,940.72	360,142.80
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		357,497.58	121,863.60
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,190,053.70	2,908,993.72
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	5,190,053.70	2,908,993.72
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	-	-
减：二、营业总支出		1,969,561.94	1,368,179.51
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,159,865.94	777,187.87
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	115,986.63	77,718.79
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	579,933.01	388,593.89
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		68,036.16	24,995.71
其中：卖出回购金融资产支出		68,036.16	24,995.71
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		16,606.49	5,661.54
8. 其他费用	6.4.7.23	29,133.71	94,021.71
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		3,695,930.06	2,022,820.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		3,695,930.06	2,022,820.61
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,695,930.06	2,022,820.61

6.3 净资产变动表

会计主体：东海证券现金管家现金管理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	339,201,445.87	-	-	339,201,445.87
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	339,201,445.87	-	-	339,201,445.87

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	167,007,687.27	-	-	167,007,687.27
(一)、综合收益总额	-	-	3,695,930.06	3,695,930.06
(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)	167,007,687.27	-	-	167,007,687.27
其中：1. 基金申购款	5,839,584,000.00	-	-	5,839,584,000.00
2. 基金赎回款	-5,672,576,312.73	-	-	-5,672,576,312.73
(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)	-	-	-3,695,930.06	-3,695,930.06
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	506,209,133.14	-	-	506,209,133.14
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	266,109,462.17	-	-	266,109,462.17
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	266,109,462.17	-	-	266,109,462.17
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-8,472,222.44	-	-	-8,472,222.44

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	2,022,820.61	2,022,820.61
(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)	-8,472,222.44	-	-	-8,472,222.44
其中：1. 基金申购款	3,728,703,000.00	-	-	3,728,703,000.00
2. 基金赎回款	-3,737,175,222.44	-	-	-3,737,175,222.44
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-2,022,820.61	-2,022,820.61
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	257,637,239.73	-	-	257,637,239.73

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告-至-财务报表由下列负责人签署：

王文卓

蔡志勇

吴江虹

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

东海证券现金管家现金管理型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”），原东海证券现金管家集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）为现金管理产品，于 2013 年 3 月 4 日经中国证券业协会中证协函〔2013〕150 号备案确认，自 2012 年 12 月 21 日起开始募集并于 2013 年 1 月 11 日结束募集，于 2013 年 1 月 15 日成立。

根据中国证监会发布的《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，本集合计划参照《基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，并将集合计划名称变更为“东海证券现金管家现金管理型集合资产管理计划”，变更后的集合计划合同自 2022 年 7 月 1 日起生效，由东海证券股份有限公司作为计划管理人，中国证券登记结算有限责任公司作为计划托管人的契约型开放式集合资产管理计划。

2022 年 3 月 10 日，本集合计划经中国证券监督管理委员会《关于准予东海证券现金管家集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函〔2022〕455 号）变更。《东海证券现金管家现金管理型集合资产管理计划资产管理合同》自管理人公告的生效之日起生效，原《东海证券现金管家集合资产管理计划管理合同》同日起失效。

本集合计划合同生效后，连续 20 个工作日出现集合计划份额持有人数量不满 200 人或者集合计划资产净值低于 5000 万元情形的，管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他集合计划合并或者终止资产管理合同等，并在 6 个月内召集集合计划份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

投资范围：现金；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、中央银行票据、同业存单；期限在 1 个月以内的债券回购；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券；中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

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；超短期融资券的主体信用评级应当为最高级。信用评级主要参照最近一个会计年度的信用评级，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。

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：同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）×100%。

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、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《中国证监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 2 号—年度报告的内容与格式》《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》《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》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，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 年上半年的经营成果和集合计划净值变动情况。

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

本报告期间，本集合计划无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期间，本集合计划无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期间，本集合计划无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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《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 号文《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《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本集合计划适用的主要税项列

示如下：

1. 管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

2. 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，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：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；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。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，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 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

3. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

4. 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个

月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

5. 基金卖出股票按 0.1% 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. 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

7. 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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	17,937,206.58
等于：本金	17,926,682.12
加：应计利息	10,524.46
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	17,937,206.58

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	137,600,737.39	137,657,014.55	56,277.16	0.0111
	银行间市场	312,169,735.46	312,328,357.17	158,621.71	0.0313

	合计	449,770,472.85	449,985,371.72	214,898.87	0.0425
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	449,770,472.85	449,985,371.72	214,898.87	0.0425

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：本报告期末，本集合计划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

注：本报告期末，本集合计划未持有任何期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本报告期末，本集合计划未持有任何黄金衍生品。

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	10,001,947.96	-
银行间市场	30,509,224.66	-
合计	40,511,172.62	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本报告期末，本集合计划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

本报告期末，本集合计划无按预期信用损失一般模型计提减值准备的情况。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本报告期末，本集合计划未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本报告期末，本集合计划无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

注：本报告期末，本集合计划未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本报告期末，本集合计划无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

注：本报告期末，本集合计划未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本报告期末，本集合计划未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本报告期末，本集合计划未持有其他资产。

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	31,560.72
其中：交易所市场	2,638.70
银行间市场	28,922.02
应付利息	-
预提费用	9,000.00
合计	40,560.72

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	339,201,445.87	339,201,445.87
本期申购	5,839,584,000.00	5,839,584,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-5,672,576,312.73	-5,672,576,312.73
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	506,209,133.14	506,209,133.14

6.4.7.11 其他综合收益

注：本报告期，本集合计划无其他综合收益。

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	3,695,930.06	-	3,695,930.06
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-3,695,930.06	-	-3,695,930.06
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	114,807.52
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	2,871.46
其他	261.74
合计	117,940.72

注：其他为存出保证金利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

注：本报告期，本集合计划无股票投资收益。

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	5,190,053.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	0.01
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	5,190,053.70

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	539,236,296.32
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	524,800,000.00
减：应计利息总额	14,436,296.31
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	0.01

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本报告期，本集合计划无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本报告期，本集合计划无债券投资收益——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**

注：本报告期，本集合计划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

注：本报告期，本集合计划无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本报告期，本集合计划无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

注：本报告期，本集合计划无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**

注：本报告期，本集合计划无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本报告期，本集合计划无贵金属投资收益——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

注：本报告期，本集合计划无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本报告期，本集合计划无贵金属投资收益——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：本报告期，本集合计划无衍生工具收益——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

注：本报告期，本集合计划无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

注：本报告期，本集合计划无股利收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益

注：本报告期，本集合计划无公允价值变动收益。

6.4.7.21 其他收入

注：本报告期，本集合计划无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本报告期，本集合计划无信用减值损失。

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	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	11,133.71
账户维护费	18,000.00
合计	29,133.71

6.4.7.24 分部报告

本报告期间，本集合计划无分部报告。

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，本集合计划无需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本集合计划无需要在财务报表附注中说明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
东海证券股份有限公司	集合计划管理人、集合计划销售机构
中国证券登记结算有限责任公司	集合计划托管人
关联自然人	公司董监高及其关系密切的家庭成员

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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：本报告期间及上年度可比期间，本集合计划均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

注：本报告期间及上年度可比期间，本集合计划均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

注：本报告期间及上年度可比期间，本集合计划均未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

注：本报告期间及上年度可比期间，本集合计划均未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

注：本报告期间及上年度可比期间，本集合计划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	1,159,865.94	777,187.87
其中：应支付销售机构的客户维护费	566,881.06	384,091.41
应支付基金管理人的净管理费	592,984.88	393,096.46

注：①本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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。

②当以 0.50%的管理费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，管理人将调整管理费为 0.25%，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，管理人方可恢复计提 0.50%的管理费。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。经管理人与托管人核对一致后，由托管人于次月前 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	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
当期发生的基金应支付的托管费	115,986.63	77,718.79

注：①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

②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 5 个工作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
	东海证券现金管家
东海证券股份有限公司	579,933.01
中国证券登记结算有限责任公司	-
合计	579,933.01
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
	东海证券现金管家
东海证券股份有限公司	388,535.90

中国证券登记结算有限责任公司	-
合计	388,535.90

注：①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%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的销售服务费；E 为前一日的集合计划资产净值

②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 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给注册登记机构或管理人，由注册登记机构或管理人代付给销售机构。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

注：本报告期间及上年度可比期间，本集合计划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 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

注：本报告期间及上年度可比期间，本集合计划管理人均未运用固有资金投资本集合计划。

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 (%)
关联自然人	590,626.45	0.12	308,034.88	0.09

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	17,937,206.58	114,807.52	1,597,759.85	356,127.79

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期间及上年度可比期间，本集合计划均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期间及上年度可比期间，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
-	-	3,695,930.06	3,695,930.06	-

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：本报告期末，本集合计划未持有因认购新发/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：本报告期末，本集合计划未持有的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：本报告期末，本集合计划未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本集合计划未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中面临的相关的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组织健全、职责边界清晰的风险管理组织架构体系，形成多层次、相互衔接、有效制衡的运行机制。风险管理组织架构由董事会及其风险控制委员会、监事会、经营管理层及其下设的各专业委员会、风险管理部门（风险管理部及其他各类专业风险管理部门）、其他各部门、分支机构及子公司组成。

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；本集合计划在银行间同业市场进行的交易通过交易对手库管理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	122,254,247.48	115,526,647.28
合计	122,254,247.48	115,526,647.28

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中未评级债券主要为国债、政策性金融债、超短期融资券及同业存单等。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本报告期末及上年度末，本集合计划均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

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	-	19,920,411.39
合计	-	19,920,411.39

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	222,709,662.22	116,473,465.68
AAA 以下	-	-
未评级	104,806,563.15	61,797,666.68
合计	327,516,225.37	178,271,132.36

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中未评级债券主要包含国债、政策性金融债和超短期融资券等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本报告期末及上年度末，本集合计划均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

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	-	39,826,327.79
合计	-	39,826,327.79

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划所持金融工具变现的难易程度。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在集合计划每个开放日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 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的集合计划管理人严格按照《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集合计划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。

本集合计划的集合计划管理人采用监控集合计划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。同时，对本集合计划的申购赎回情况进行监控，保持集合计划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。本集合计划的集合计划管理人在集合计划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，有效保障集合计划持有人利益。

本集合计划所持证券在证券交易所上市或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。

本集合计划本报告期内无重大流动性风险。

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因市场利率变动而发生波动的风险。本集合计划的集合计划管理人定期对本集合计划面临的利率风险进行监控，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	17,937,206.58	-	-	-	17,937,206.58
结算备付金	134,506.65	-	-	-	134,506.65
存出保证金	30,023.36	-	-	-	30,023.36
交易性金融资产	423,977,853.18	25,792,619.67	-	-	449,770,472.85
买入返售金融资产	40,511,172.62	-	-	-	40,511,172.62
资产总计	482,590,762.39	25,792,619.67	-	-	508,383,382.06
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	219,170.37	219,170.37
应付托管费	-	-	-	21,917.04	21,917.04
应付清算款	-	-	-	308,099.18	308,099.18
应付销售服务费	-	-	-	109,585.19	109,585.19
应付利润	-	-	-	1,447,972.55	1,447,972.55
应交税费	-	-	-	26,943.87	26,943.87
其他负债	-	-	-	40,560.72	40,560.72
负债总计	-	-	-	2,174,248.92	2,174,248.92
利率敏感度缺口	482,590,762.39	25,792,619.67	-	-2,174,248.92	506,209,133.14
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	1,751,968.14	-	-	-	1,751,968.14
结算备付金	406,959.49	-	-	-	406,959.49
存出保证金	28,612.18	-	-	-	28,612.18
交易性金融资产	350,490,409.65	3,054,109.17	-	-	353,544,518.82
资产总计	352,677,949.46	3,054,109.17	-	-	355,732,058.63
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	154,565.65	154,565.65
应付托管费	-	-	-	15,456.55	15,456.55
卖出回购金融资产款	14,672,717.72	-	-	-	14,672,717.72
应付销售服务费	-	-	-	77,282.82	77,282.82
应付利润	-	-	-	1,421,924.19	1,421,924.19
应交税费	-	-	-	19,644.64	19,644.64
其他负债	-	-	-	169,021.19	169,021.19
负债总计	14,672,717.72	-	-	1,857,895.04	16,530,612.76
利率敏感度缺口	338,005,231.74	3,054,109.17	-	-1,857,895.04	339,201,445.87

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变，市场利率上升或下降 25 个基点	
	对资产负债表日基金资产净值的	

	相关风险变量的变动	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）
分析	市场利率下降 25 个基点	215, 111. 24	144, 399. 79
	市场利率上升 25 个基点	-214, 746. 82	-144, 199. 50

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

本集合计划其他价格风险主要系市场价格风险，市场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，所面临的最大的市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本集合计划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

注：本集合计划主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，未持有权益类证券及贵金属投资、权证投资等，因此无重大其他价格风险敞口。

6. 4. 13. 4. 3. 2 其他价格风险的敏感性分析

注：本报告期末，本集合计划未持有交易性权益投资、可转换债券及可交换债券，因此除市场利率和外汇利率以外的市场价格因素的变动对于本集合计划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

注：本报告期末及上年度末，本集合计划均未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6. 4. 14 公允价值

6. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

金融资产或金融负债于本集合计划成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。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，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或

资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本集合计划将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；（3）该金融资产已转移，虽然本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

本集合计划持有的股票投资、债券投资、资产支持证券、同业存单和衍生工具（主要为权证投资）等按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）对于存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应该将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。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，集合计划管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（2）对不存在活跃市场的投资品种，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，才可使用不可观察输入值。

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，集合计划

管理公司根据具体情况与托管银行进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。
国家有最新规定的，按其规定进行估值。

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	449,770,472.85	353,544,518.82
第三层次	-	-
合计	449,770,472.85	353,544,518.82

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本报告期间及上年度可比期间，本集合计划均无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

非持续的公允价值计量，是指其他相关会计准则要求或者允许集合计划管理人在特定情况下的资产负债表中以公允价值进行的计量。

在相关资产或负债初始确认后的资产负债表中，集合计划管理人至少应当在附注中披露非持续以公允价值计量的每组资产和负债的下列信息：

1) 其他相关会计准则要求或者允许集合计划管理人在特定情况下非持续以公允价值计量的项目和金额，以及以公允价值计量的原因。

2) 公允价值计量的层次。

3) 对于第二层次的公允价值计量，集合计划管理人应当披露使用的估值技术和输入值的描述性信息。当变更估值技术时，集合计划管理人还应当披露这一变更以及变更的原因。

4) 对于第三层次的公允价值计量，集合计划管理人应当披露使用的估值技术、输入值和估值流程的描述性信息，当变更估值技术时，集合计划管理人还应当披露这一变更以及变更的原因。集合计划管理人应当披露公允价值计量中使用的重要不可观察输入值的量化信息。

5) 当非金融资产的最佳用途与其当前用途不同时，集合计划管理人应当披露这一事实及其原因。

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：货币资金、应收票据、应收账款、其他应收款、短期借款、应付票据、应付账款、其他应付款、一年内到期的长期借款、长期应付款、长期借款和应付债券等。除持有至到期投资、长期应收款、长期借款、应付债券、长期应付款、其他流动负债（不含递延收益）以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值通常相差很小。长期应收款、固定利率的长期借款以及不存在活跃市场的应付债券，通常以合同规定的未来现金流量按照市场上具有可比信用等级并在相同条件下提供几乎相同现金流量的市场收益率进行折现后的现值确定其公允价值。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本集合计划无有助于理解和分析财务报表需要说明的其他事项。

§ 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	449,770,472.85	88.47
	其中：债券	449,770,472.85	88.47
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	40,511,172.62	7.97
	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	18,071,713.23	3.55
4	其他各项资产	30,023.36	0.01
5	合计	508,383,382.06	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	1.03	
	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	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

注：本报告期内不存在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	62
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	103
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	52

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比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	26.40	0.06
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	42.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	13.73	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	4.05	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	11.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	97.68	0.06

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：本报告期内本集合计划不存在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	7,689,059.56	1.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,120,112.24	1.41
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	115,428,400.55	22.80
5	企业短期融	142,876,423.72	28.22

	资券		
6	中期票据	169,293,311.74	33.44
7	同业存单	-	-
8	其他	7,363,165.04	1.45
9	合计	449,770,472.85	88.85
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	102281785	22 津城建 MTN010	300,000	31,597,879.39	6.24
2	101901299	19 甘国投 MTN001	300,000	31,029,818.77	6.13
3	188639	国电投 10	300,000	30,815,749.73	6.09
4	102101453	21 津地铁 MTN001	200,000	21,018,637.47	4.15
5	042380453	23 天津轨交 CP003	200,000	20,622,176.24	4.07
6	012383760	23 天津轨交 SCP018	200,000	20,420,199.62	4.03
7	012481096	24 滨建投 SCP002	200,000	20,166,905.74	3.98
8	042380482	23 云能投 CP011	170,000	17,697,746.70	3.50
9	155635	19 云投 G2	128,890	13,443,289.05	2.66
10	102381988	23 昆明交通 MTN002	118,000	12,594,829.16	2.49

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	0.0667%
报告期内偏离度的最低值	0.0049%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0371%

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不存在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不存在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

本集合计划采用固定份额净值，集合计划份额账面净值始终保持为人民币 1.00 元。

本集合计划估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

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

报告期内，本集合计划投资的前十名证券的发行主体中本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	30,023.36
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	30,023.36

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因公允价值占集合计划资产净值的比例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 (%)

4,927	102,741.86	17,239,285.10	3.41	488,969,848.00	96.59
-------	------------	---------------	------	----------------	-------

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	个人	63,939,445.89	12.63
2	机构	11,367,000.00	2.25
3	个人	8,807,330.68	1.74
4	个人	7,849,889.46	1.55
5	个人	6,870,447.67	1.36
6	个人	6,560,911.22	1.30
7	个人	6,205,000.00	1.23
8	个人	6,195,000.00	1.22
9	个人	4,303,165.48	0.85
10	个人	4,258,802.14	0.84

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	3,280,970.68	0.65

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、基金投资和相关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7月1日） 基金份额总额	281,946,000.00
本报告期期初基金份额总额	339,201,445.87
本报告期基金总申购份额	5,839,584,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	5,672,576,312.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	506,209,133.14

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开集合计划份额持有人大会。

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

1、集合计划管理人 2024 年 2 月 6 日发布公告，自 2024 年 2 月 5 日起新任王文卓先生为集

合计划管理人董事长，钱俊文先生不再担任集合计划管理人董事长。

2、本报告期内，本集合计划托管人的专门集合计划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

本报告期内无涉及本集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼。本报告期内无涉及本集合计划托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本集合计划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

本报告期内本集合计划未改聘会计事务所，为本集合计划提供审计服务的会计师事务所为天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）。

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	东海证券股份有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 4 月 13 日
采取稽查或处罚等措施的机构	江苏证监局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	一、在全面风险管理方面,公司未建立多层次、相互衔接、有效制衡的风险管理运行机制。自营业务风险控制组织架构不合理,风险管理不到位,权益类业务内设风险限额管理未能有效执行;部分固收类业务经营未受到有效制衡和监督。 二、2020 年 10 月至 2021 年 3 月期间,未能及时完成子公司东海投资有限责任公司监事的任免工作。三、部分投行项目中,未建立完善的包销风险评估与处理机制;未对网下投资者定价依据进行严格审核;未按照要求进行簿记建档录像;部分投资价值研究报告撰写不够审慎、客观。
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	总裁杨明
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 4 月 13 日
采取稽查或处罚等措施的机构	江苏证监局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	东海证券股份有限公司(以下简称“东海证券”)在全面风险管理方面,未建立多层次、相互衔接、有效制衡的风险管

	理运行机制。自营业务风险控制组织架构不合理,风险管理不到位,权益类业务内设风险限额管理未能有效执行;部分固收类业务经营未受到有效制衡和监督。上述情况违反了《证券公司监督管理条例》(国务院令第 653 号)第二十七条第一款、《证券公司风险控制指标管理办法》(证监会令第 166 号)第六条第一款的规定。作为东海证券执行委员会主任(总裁),未能有效落实公司的合规管理目标,对上述问题负有管理责任,违反《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》(证监会令第 166 号)第九条的规定。
管理人采取整改措施的情况(如提出整改意见)	-
其他	-

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注:本报告期内未发生集合计划托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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 (%)	
东海证券	2	-	-	20,502.75	100.00	-

注:本报告期间,本集合计划无租用证券公司交易单元进行股票投资情况。

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 (%)
东海证券	136,545,396.00	100.00	217,747,000.00	100.00	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注:本报告期内本集合计划不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东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网站	2024 年 2 月 6 日

2	东海证券现金管家现金管理型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 3 月 26 日
3	东海证券现金管家现金管理型集合资产管理计划收益支付公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 6 月 25 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：本报告期内，本集合计划不存在单一投资者持有集合计划份额比例达到或者超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本集合计划管理人根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等法规对照公募基金对本集合计划进行了规范改造，并在收到中国证监会准予本集合计划合同变更生效的回函后，完成了向产品持有人的意见征询。改造后的集合计划合同已于 2022 年 07 月 01 日变更生效。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、关于准予东海证券现金管家集合资产管理计划合同变更的回函；
- 2、《东海证券现金管家现金管理型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《东海证券现金管家现金管理型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《东海证券现金管家现金管理型集合资产管理计划招募说明书》；
- 5、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、集合计划托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、法律意见书；
- 8、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所，并登载于集合计划管理人互联网站 <http://www.longone.com.cn/>。

12.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人互联网站查阅，或在营业时间内至集合计划管理人或集合计划

托管人的办公场所免费查阅。

东海证券股份有限公司

2024 年 8 月 30 日