

东海证券现金管家现金管理型集合资产管理计划
2024 年第 4 季度报告

2024 年 12 月 31 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

报告送出日期：2025 年 1 月 22 日

§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 2025 年 1 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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资产管理计划资产，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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	638,910,201.22 份
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 10 月 1 日-2024 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	2,237,802.97
2. 本期利润	2,237,802.97
3. 期末基金资产净值	638,910,201.22

注：1. 本期已实现收益指本期利息收入、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；

2. 所述业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

3. 本集合计划资产管理合同生效日为 2022 年 7 月 1 日（由证券公司大集合资产管理产品现金管家变更而来）。

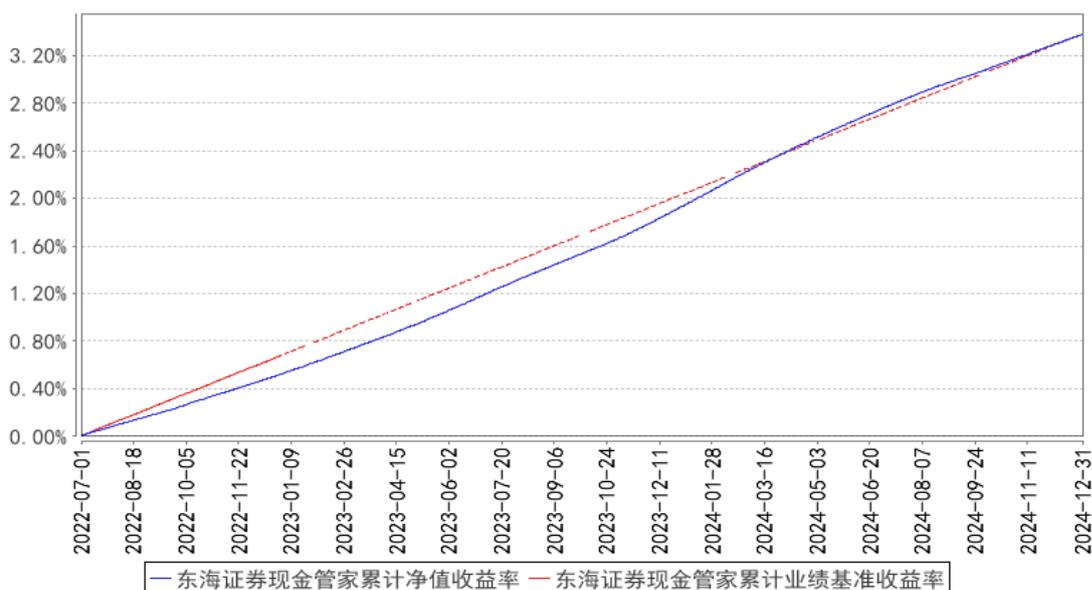
3.2 基金净值表现

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	净值收益率①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.3004%	0.0001%	0.3403%	0.0000%	-0.0399%	0.0001%
过去六个月	0.6118%	0.0003%	0.6805%	0.0000%	-0.0687%	0.0003%
过去一年	1.4217%	0.0006%	1.3537%	0.0000%	0.0680%	0.0006%
自基金合同 生效起至今	3.3784%	0.0007%	3.3842%	0.0000%	-0.0058%	0.0007%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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 12 月 31 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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，证券从业资格证书编号 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。
--	--	--	--	--	---------------------

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公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，不存在本投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，未发现本集合计划存在异常交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

央行公开市场操作方面，2024 年四季度逆回购投放 136,308.00 亿元，逆回购到期 146,727.00 亿元；MLF 投放 19,000.00 亿元，MLF 到期 36,890.00 亿元；央行票据互换发行 120.90 亿元，央行票据互换到期 147.50 亿元；开展国库现金定存操作 1200 亿元，国库现金定存到期 3600 亿元；发行互换便利票据 500 亿元，合计净回笼 31,209.00 亿元。银行间 1 天债券质押式回购利率加权平均值 1.5908%，银行间 7 天债券质押式回购利率加权平均值 1.8736%，资金面总体宽松。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。

4.5 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 0.3004%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	308,755,968.20	47.43
	其中：债券	308,755,968.20	47.43
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	270,070,443.19	41.49
	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	72,053,126.13	11.07
4	其他资产	47,799.87	0.01
5	合计	650,927,337.39	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	0.18	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	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。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	42
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	70
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	37

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。

5.3.2 报告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	64.81	1.56
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动 利率债	-	-

2	30 天（含）—60 天	3.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	8.52	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	11.17	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	12.52	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.83	1.56

5.4 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。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	5,404,457.09	0.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	55,364,889.27	8.67
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	43,679,200.05	6.84
5	企业短期融资券	70,679,895.25	11.06
6	中期票据	133,627,526.54	20.91
7	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	308,755,968.20	48.33
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	102000606	20 桂交投 MTN004	400,000	41,155,719.97	6.44
2	185280	22 国电 01	350,000	35,987,616.69	5.63
3	102280176	22 皖铁基金 MTN001	300,000	30,921,678.82	4.84
4	042480368	24 电网 CP010	300,000	30,255,244.50	4.74
5	102380761	23 湘高速 MTN001	200,000	20,501,928.56	3.21
6	042480259	24 贵州高速	200,000	20,287,978.07	3.18

		CP001			
7	012482561	24 皖铁基金 SCP001	200,000	20,136,672.68	3.15
8	138910	23 中证 G2	190,000	19,490,649.18	3.05
9	149852	22 申证 05	110,000	11,303,378.12	1.77
10	102000350	20 洪市政(疫情 防控债)MTN001	100,000	10,316,088.33	1.61

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”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	0.0316%
报告期内偏离度的最低值	-0.0636%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0174%

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。

5.8 报告期末按摊余成本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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 本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，报告编制日前一年内，中信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司存在被监管处罚的情形。

（1）中信证券股份有限公司

2024 年 1 月 5 日，因保荐的恒逸石化股份有限公司可转债项目，发行人证券发行上市当年即亏损、营业利润比上年下滑 50% 以上。被中国证监会采取出具警示函的行政监管措施。

2024 年 4 月 12 日及 4 月 19 日，公司及下属公司中信中证资本分别收到中国证监会《立案告知书》（证监立案字 03720240049 号、证监立案字 0032024018 号）及《行政处罚事先告知书》（处罚字〔2024〕56 号）。2024 年 4 月 30 日，公司收到中国证监会《行政处罚决定书》

((2024) 45 号)。行政处罚决定书认定，王泽龙和洪浩炜通过衍生品交易安排，实质参与上市公司“中核钛白”2023 年非公开发行，并以市价融券卖出，提前锁定与非公开发行股票折扣价之间的价差收益，变相规避限售期规定，违反《证券法》第三十六条、《上市公司证券发行管理办法》第三十八条第二项等规定，构成《证券法》第一百八十六条所述违法情形。中信中证资本为王泽龙、洪浩炜违反限制性规定转让股票行为制定套利方案、搭建交易架构、提供杠杆资金支持等；中信证券知悉客户融券目的是定增套利，配合其提供融券服务。上述行为与王泽龙、洪浩炜共同构成《证券法》第一百八十六条所述违法情形。公司被责令改正，给予警告，没收违法所得人民币 1,910,680.83 元，并处罚款人民币 23,250,000 元。中信中证资本被责令改正，给予警告，并处罚款人民币 46,500,000 元。

2024 年 5 月 7 日，中国证监会对公司出具了《关于对中信证券股份有限公司及保荐代表人秦国安、李天智采取出具警示函监管措施的决定》((2024) 15 号)。中国证监会指出，公司及两名保荐代表人在保荐江苏博涛智能热工股份有限公司首次公开发行股票并上市过程中，未勤勉尽责履行相关职责，对发行人存在内部控制制度未有效执行、财务会计核算不准确等问题的核查工作不到位。

2024 年 5 月 8 日，广东证监局对公司出具了《关于对中信证券股份有限公司、凌鹏、浦瑞航采取出具警示函措施的决定》((2024) 41 号)。公司作为广东泉为科技(11.430, 0.52, 4.77%)股份有限公司首次公开发行股票持续督导机构，在持续督导履职过程中存在以下违规行为：一是对二甲苯贸易业务客户和供应商之间的关联关系核查不充分。二是对二甲苯贸易业务真实性核查不充分。三是对二甲苯业务单据审核中未关注到运输合同与船舱计量报告对应的航运公司存在明显差异。四是对二甲苯业务单据审核中未关注到销售合同和租船合同约定的装货港存在明显异常。

2024 年 8 月 12 日，浙江证监局因员工屡次向客户提供开户知识测评或风险测评答案、提示客户提高风险承受等级向中信证券股份有限公司浙江分公司出具警示函，采取责令改正措施。

因员工向投资者推介风险等级高于其风险承受能力的私募基金产品，违反了相关适当性管理规定。中信证券陕西分公司于 2024 年 9 月 30 日被陕西证监局采取出具警示函的行政监管措施。

因在对皓吉达担任项目保荐人过程中存在未督促发行人准确、完整披露控股股东的重大股权转让情况、对发行人实际控制人认定和控制权稳定性的核查程序执行不到位等问题。于 2024 年 11 月 8 日被深圳证券交易所下发监管函。

因中信证券江苏分公司下辖分支机构存诸多问题。其中，中信证券镇江分公司未履行账户实名制管理等职责、员工管理不到位。另外，中信证券徐州建国西路证券营业部员工管理有缺陷且

未及时报告重大事件。于 2024 年 12 月 2 日被江苏证监局采取出具警示函的行政监管措施。

因在业务开展过程中，存在以下问题：一是经纪业务管理存在不足。如业务制度未及时修订完善；客户开户信息采集登记不规范，部分客户回访由客户经理负责；部分账户的可疑交易预警核查及实名制核查不充分；对分支机构员工的执业信息登记备案、手机号报备管理、违规信息报送不及时不到位；下属子公司微信公众号推送营销信息不当等。二是场外衍生品业务管理存在不足。在衍生品交易准入环节，对于部分交易对手的真实身份识别、关联关系的核查不深入，落实适当性管理要求不到位；在交易对手的持续管理环节，部分交易对手的年度复核资料及定期回访记录缺失；在交易风险监测监控环节，对于风险提示跟踪处理不及时不完善；在日常报送管理方面，存在报送场外衍生品季度报告内容不完整的情况。于 2024 年 12 月 20 日被深圳证监局采取出具警示函的行政监管措施。

（2）申万宏源证券有限公司

因承销尽调不规范，部分项目未对可能影响发行人偿债能力的事项进行充分关注和核查；且受托管理履职尽责不到位，个别项目未对存续期影响发行人偿债能力事项进行跟踪并及时分析影响，申万宏源证券有限公司被中国证券监督管理委员会于 2024 年 2 月 5 日依据《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第 180 号）第六十八条、《证券公司及基金管理公司子公司资产证券化业务管理规定》第四十六条 采取责令改正的行政监管措施。

因 1. 未有效建立覆盖境外子公司的决策事项落实跟踪制度，未明确境外子公司的关联交易管理制度，违反了《证券公司和证券投资基金管理公司境外设立、收购、参股经营机构管理办法》（证监会令第 150 号，经证监会令第 179 号修订，以下简称《境外经营机构管理办法》）第二十条、第二十四条第二款的规定。2. 未督促境外子公司有效处置风险指标超限额的情形，不符合《证券公司全面风险管理规范》（中证协发〔2016〕251 号）第三十条第二款的规定，违反了《境外经营机构管理办法》第十四条、第二十七条第一款的规定。3. 未对境外子公司部分董事、高级管理人员和重要岗位人员开展离任审计或离任审查，违反了《境外经营机构管理办法》第二十五条第二款的规定。申万宏源证券有限公司被中国证券监督管理委员会上海监管局于 2024 年 3 月 19 日依据《境外经营机构管理办法》第三十二条采取出具警示函的监督管理措施。

因针对信息系统相关功能，未进行技术和业务风险的充分评估，亦未制定有效的风险防控措施，违反了《证券期货业网络和信息安全管理办法》（证监会令第 218 号，以下简称《网络和信息安全管理办法》）第十五条第一款有关规定。（二）投资者个人信息处理、安全防护、审计监督等管理机制存在缺陷，导致个人信息使用过程中发生信息安全问题，违反了《网络和信息安全管理办法》第三十条、第三十二条和《证券投资基金经营机构信息技术管理办法》（证监会令第 179 号，以下

简称《信息技术管理办法》)第三十一条相关规定。(三)针对已发现的信息系统安全漏洞未进行及时整改,违反了《网络和信息安全管理办法》第三十六条相关规定。申万宏源证券有限公司被中国证券监督管理委员会上海监管局于 2024 年 5 月 6 日依据《网络和信息安全管理办法》第六十二条第二款,《信息技术管理办法》第五十七条采取出具警示函的监督管理措施。

因作为新疆中泰化学“23 新化 01”公司债券的主承销商,对发行人非经营性往来占款、贸易业务收入、前次募集资金使用情况核查不到位,尽职调查工作底稿不规范。于 2024 年 12 月 24 日被新疆证监局依据有关法律法规采取出具警示函的监督管理措施。

对上述证券的投资决策程序的说明:本集合计划投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	47,799.87
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	47,799.87

5.9.4 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	495,087,331.44
报告期期间基金总申购份额	5,297,290,000.00
报告期期间基金总赎回份额	5,153,467,130.22
报告期期末基金份额总额	638,910,201.22

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内集合计划管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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,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。

8.2 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 7 月 1 日变更生效。

§9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 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/>。

9.3 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
2025 年 1 月 22 日