

# 国海六个月滚动持有债券型集合资产管理 计划 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：国海证券股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。上会会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 6 月 7 日起至 2021 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	13
4.10 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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>13</b>
6.1 审计报告基本信息	13
6.2 审计报告的基本内容	14
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>16</b>
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	19

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>49</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	51
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	52
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	52
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	52
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	52
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
8.11 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>54</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	55
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	55
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>55</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>56</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
11.2 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 .....	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
11.4 基金投资策略的改变 .....	56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
11.8 其他重大事件 .....	57
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>60</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	60
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>60</b>
13.1 备查文件目录 .....	60
13.2 存放地点 .....	60
13.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划	
基金简称	国海六个月滚动持有债券型	
场内简称	-	
基金主代码	970027	
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	2021 年 6 月 7 日	
基金管理人	国海证券股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	420,912,988.81 份	
基金合同存续期	3 年，3 年后按监管规定执行	
下属分级基金的基金简称	国海六个月滚动持有债券型 A	国海六个月滚动持有债券型 C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	970027	970028
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	420,912,988.81 份	-份

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

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求实现计划资产的长期稳定增值，为投资者实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本资产管理计划采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，在货币市场工具、利率债、信用债等资产之间进行灵活配置，在严格控制风险的前提下，力争实现资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率*90%+中证可转换债券指数收益率*10%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金和混合型集合资产管理计划。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国海证券股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	欧阳琛	余宏伟
	联系电话	021-61018068	021-68089632
	电子邮箱	ouyc@ghzq.com.cn	yuhongwei@sh.icbc.com.cn
客户服务电话		95563	95588
传真		021-61018090	010-66105798
注册地址		广西桂林市辅星路 13 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市黄浦区福佑路 8 号人保大厦 11 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		何春梅	陈四清

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ghzq.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市静安区威海路 755 号 25 层
注册登记机构	国海证券股份有限公司	上海市黄浦区福佑路 8 号人保大厦 11 楼
-	-	-

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2021 年 6 月 7 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	
	国海六个月滚动持有债券型 A	国海六个月滚动持有债券型 C
本期已实现收益	9,572,265.19	-
本期利润	11,184,875.71	-
加权平均基金份额本期利润	0.0253	-
本期加权平均净值利润率	2.50%	-
本期基金份额净值增长率	2.40%	-
3.1.2 期末数据	2021 年末	

和指标		
期末可供分配利润	8,503,020.39	-
期末可供分配基金份额利润	0.0202	-
期末基金资产净值	431,018,376.00	-
期末基金份额净值	1.0240	-
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	
基金份额累计净值增长率	2.40%	-

注：1、本基金合同生效日为 2021 年 6 月 7 日，本基金分设两级基金份额：A 级基金份额和 C 级基金份额。详情请参阅相关公告。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国海六个月滚动持有债券型 A

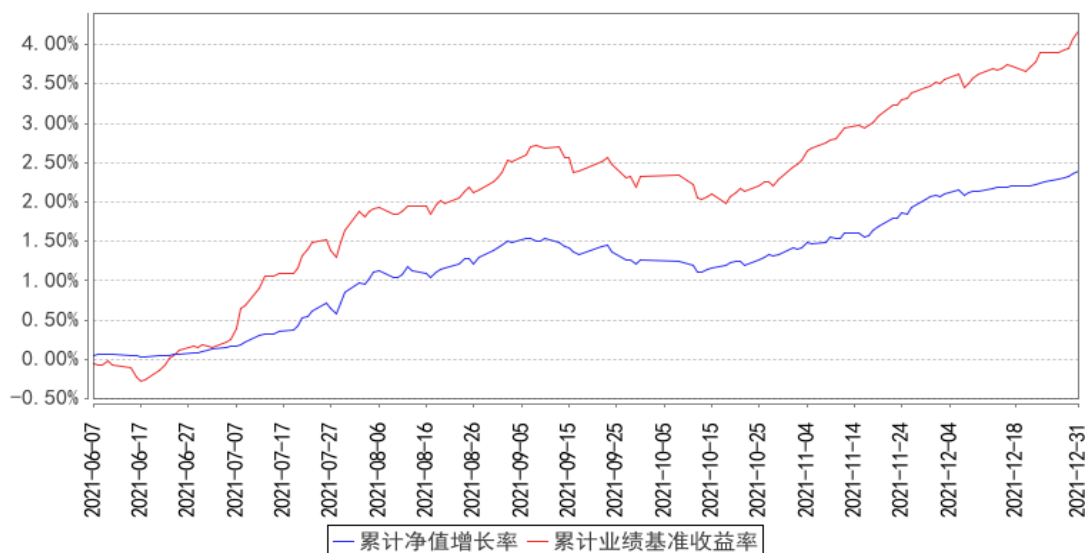
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.13%	0.04%	1.80%	0.06%	-0.67%	-0.02%
过去六个月	2.30%	0.05%	3.96%	0.08%	-1.66%	-0.03%
自基金合同生效起至今	2.40%	0.04%	4.17%	0.08%	-1.77%	-0.04%

注：本基金为由“国海金贝壳 5 号集合资产管理计划”公募化改造来的产品，于 2021 年 6 月 7 日正式变更生效。产品变更前采用摊余成本法估值，因此该产品 2021 年 6 月 4 日（变更前最后一个交易日）日终单位净值为 1.0000。产品变更后采用市值法估值。由于估值方法的改变，该产品

2021 年 6 月 7 日日终单位净值为 1.0005。2021 年 6 月 7 日本基金单位净值增长的 0.0005 并不完全由资产波动决定，当日估值方法的改变对单位净值产生了一定的影响。

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

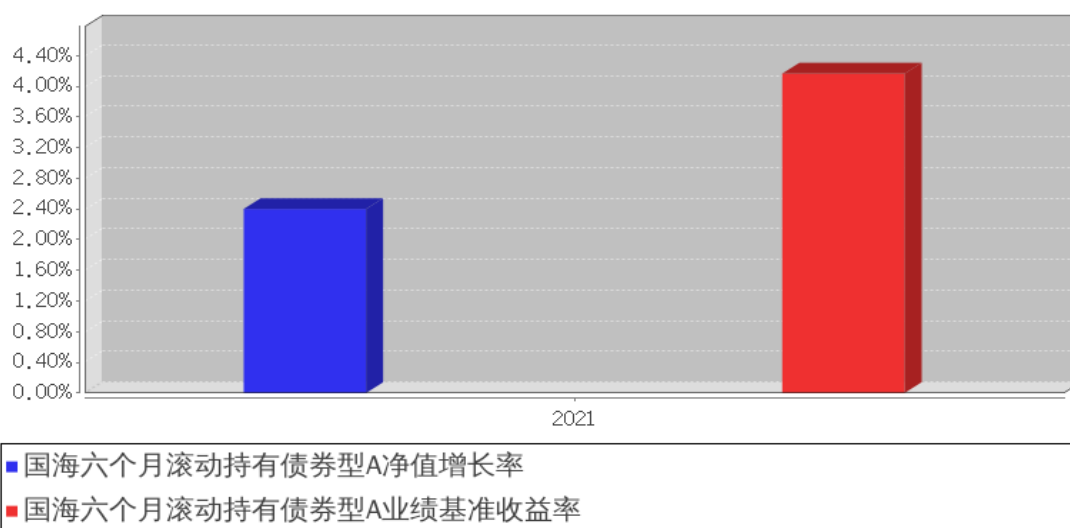
国海六个月滚动持有债券型A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同于 2021 年 6 月 7 日生效，自基金合同生效日起至本报告期末不满一年。截至报告期末，本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的要求。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国海六个月滚动持有债券型A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2021 年 6 月 7 日生效，2021 年度净值增长率的计算期间为 2021 年 6 月 7



日至 2021 年 12 月 31 日。

### 3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2021 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日）
-	-
其他指标	报告期末（2021 年 12 月 31 日）
-	-

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

国海六个月滚动持有债券型 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：报告期间无利润分配。

## § 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）。目前，公司在全国 21 个省级区域设有 25 家分公司、98 家营业部、4 家子公司（国海富兰克林基金管理有限公司、国海良时期货有限公司、国海创新资本投资管理有限公司、国海证券投资有限公司），形成了以零售财富、企业金融、机构服务与投资、资管管理、精品研究等为支撑的业务体系，为个人、企业、机构及政府客户提供多元化金融服务。

公司股东主要为实力雄厚的国有企业和上市公司。公司控股股东是广西投资集团，集团及其下属子公司桂东电力、中恒集团、广投金控等合计持有公司股份 33.11%。得益于自治区党委、政府和大股东的鼎力支持，公司法人治理完善，拥有明显的市场化基因，市场化机制成为公司核心优势之一，为公司快速发展奠定良好基础。近年来，特别是“十三五”以来，公司经营业绩、综合实力快速成长，公司各项指标位居行业前列。截至 2021 年 9 月，公司总资产 627 亿元，净资产 192 亿元，净资本 142 亿元。2021 年前三季度，公司实现合并营收 39.4 亿元、利润总额 11.74

亿元。

国海证券根据《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》的要求，截至 2021 年 12 月 31 日，旗下已有两只大集合产品完成公募化改造，为“国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划”、“国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划”。

#### 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	2021 年 6 月 7 日	-	6 年	现任国海证券资管分公司固定收益总部公募产品部负责人。国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划、国海金贝壳 9 号（债券增强）集合资产管理计划、国海证券金贝壳稳德利保证金现金管理集合资产管理计划投资经理。毕业于上海外国语大学，获得经济学学士学位。2015 年加入申万宏源证券股份有限公司，担任投资经理。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
王力	公募基金	-	-	-
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	2	1,685,150,019.66	2018 年 9 月 4 日
	合计	2	1,685,150,019.66	-

注：本基金基金经理兼任两只证券公司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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理，薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

## 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 公平交易制度和控制方法

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

### 4.3.2 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。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2021 年，我国债券市场整体运行平稳，一级市场整体来看债券发行量小幅增长，债券托管量稳步增长，交易结算量持续增长。从主要债券品种来看，收益率均下行，其中 10 年期国债收益率基本处在 2.77%至 3.28%之间，保持下行趋势，因此从收益率来看 2021 年属于债券牛市，十年国债和国开收益率均较上一年年底下行约 39BP 和 46BP。

总结全年债券市场走势，在 2020 年底的永煤事件爆发后，央行便进行宽货币行为对冲，直到 2021 年 1 月，信用债一级市场基本修复，1 月流动性相对偏紧，进入 3 月后，基本面保持强势，但地方债供给偏慢，资金面也回到平稳状态。此后直到年中，央行超预期降准，2021 年 7 月 9 日，央行宣布降准 0.5 个百分点，意味着新一轮宽松周期的开启，7 月随着降准拉开序幕，债市牛市

行情快速演绎。十月初期对于监管偏紧的预期在十月中下旬开始迅速缓解。一是发改委对于煤炭等资源品价格的暴涨，采取了强力举措，二是央行始终保持流动性充裕，在税期月末等关键时点在公开市场大额投放。2021 年 12 月 15 日，央行继续下调金融机构存款准备金率 0.5 个百分点，12 月 20 日全国银行间同业拆借中心发布，一年期 LPR 下调 5 个基点至 3.8%。就全年来看，2021 年债市是牛市走势，但也是结构性资产荒深刻演绎的一年，主要表现是较多的资金追逐少量优质资产。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 1.0240 元，本报告期基金 A 类份额净值增长率为 2.40%，同期业绩比较基准收益率为 4.17%。

#### 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 2022 年，当前政策稳增长主线不变，宽货币的路径也较为确定，不排除在当前已经较为宽松的货币环境下依旧存在降准降息的可能，一季度预计稳增长措施将陆续出台，可能导致市场对基本面企稳的预期抬升。相比之下，2022 年通胀及通胀预期可能不是主要矛盾，2021 年的高基数对 2022 年同比读数有影响，PPI 同比读数大概率回落，猪肉供需条件可能改善，但预计三四季度后才会出现猪价的回暖，2022 年 PPI 前高后低、CPI 温和回升是大概率事件，总体对货币政策影响不大。信用端，2022 年大概率逐渐企稳，结构性资产荒可能有所缓解，本管理人将坚持稳健的投资风格，以中短期的中高等级信用债为主要持仓，获取票息收益，积极把握利率机会，全面掌握转债标的的各项特征把握经济动能变动下的系统性机会。同时，警惕信用风险的扩散以及复杂环境下的价格波动。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，管理人内部监察稽核主要开展了如下措施：

依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章对产品的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时反馈，督促改进并跟踪改进效果，进一步完善公司内部控制管理机制。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立

了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括投资风险负责人、基金会计负责人等。该机构成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内未进行收益分配。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

#### 4.10 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，本托管人在托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在任何损害资产管理计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

### 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，托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同和托管协议的规定，对本资产管理计划管理人的投资运作进行了必要的监督，对资产净值的计算、份额参与与退出价格计算、以及费用开支等方面进行了认真地复核。

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

本报告期内，本托管人依法对国海证券股份有限公司编制和披露的国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划 2021 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告中账务数据内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	上会师报字(2022)第 2267 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	<p>我们审计了国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划(以下简称“国海六个月滚动持有债券型”)财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 6 月 7 日(集合计划合同变更生效日)至 2021 年 12 月 31 日止会计期间的利润表、所有者权益(集合计划净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附国海六个月滚动持有债券型的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了国海六个月滚动持有债券型 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 6 月 7 日(集合计划合同变更生效日)至 2021 年 12 月 31 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于国海六个月滚动持有债券型,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	<p>我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系国海六个月滚动持有债券型管理人(以下简称“管理人”)根据《国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》的规定为其基金份额持有人编制的,因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人提供国海六个月滚动持有债券型份额持有人和向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用,不得用于其他目的。</p>
其他信息	<p>管理人对其他信息负责。其他信息包括国海六个月滚动持有债券型 2021 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理人负责评估国海六个月滚动持有债券型的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</li> <li>2、了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</li> <li>3、评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</li> <li>4、对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对国海六个月滚动持有债券型持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国海六个月滚动持有债券型不能持续经营。</li> <li>5、评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</li> </ol> <p>我们与管理人就国海六个月滚动持有债券型的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>上会会计师事务所（特殊普通合伙）</p>

注册会计师的姓名	陈大愚	江嘉炜
会计师事务所的地址	上海市静安区威海路 755 号 25 层	
审计报告日期	2022 年 3 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	1,793,063.65
结算备付金		2,665,947.15
存出保证金		6,285.41
交易性金融资产	7.4.7.2	470,043,443.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		470,043,443.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	7,160,905.09
应收股利		-
应收申购款		911,952.82
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		482,581,597.12
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		50,119,434.82
应付证券清算款		1,012,680.55
应付赎回款		1,021.96
应付管理人报酬		255,777.37
应付托管费		21,314.80
应付销售服务费		-



应付交易费用	7.4.7.7	40,325.02
应交税费		83,653.65
应付利息		4,313.89
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	24,699.06
负债合计		51,563,221.12
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	420,912,988.81
未分配利润	7.4.7.10	10,105,387.19
所有者权益合计		431,018,376.00
负债和所有者权益总计		482,581,597.12

注：本基金合同生效日为 2021 年 06 月 07 日，本报告期自基金合同生效日 2021 年 06 月 07 日起至 2021 年 12 月 31 日止。报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 420,912,988.81 份，其中国海六个月滚动持有债券型 A 基金份额总额 420,912,988.81 份，基金份额净值 1.0240 人民币。国海六个月滚动持有债券型 C 基金份额总额-份，基金份额净值-人民币；本财务报表的实际编制期间为 2021 年 6 月 7 日（集合计划合同变更生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		13,794,268.56
1. 利息收入		8,727,631.17
其中：存款利息收入	7.4.7.11	82,271.31
债券利息收入		8,208,428.87
资产支持证券利息收入		93,097.41
买入返售金融资产收入		343,833.58
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,454,026.87
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-96,508.46
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,580,291.55
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-3,882.43
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-25,873.79
股利收益	7.4.7.16	-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,612,610.52
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-
减：二、费用		2,609,392.85
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,529,319.14
2. 托管费	7.4.10.2.2	127,443.23
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	61,262.33
5. 利息支出		810,133.86
其中：卖出回购金融资产支出		810,133.86
6. 税金及附加		34,345.94
7. 其他费用	7.4.7.20	46,888.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,184,875.71
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,184,875.71

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	78,954,569.92	-	78,954,569.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,184,875.71	11,184,875.71
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	341,958,418.89	-1,079,488.52	340,878,930.37
其中：1. 基金申购款	579,847,390.58	4,063,832.96	583,911,223.54
2. 基金赎回款	-237,888,971.69	-5,143,321.48	-243,032,293.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值	-	-	-

减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	420,912,988.81	10,105,387.19	431,018,376.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>何春梅</u>	<u>谭志华</u>	<u>韦海乐</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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)由国海金贝壳 5 号集合资产管理计划变更而来。国海金贝壳 5 号集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划,2011 年 6 月 9 日经中国证券监督管理委员会出具的证监许可[2011]932 号核准设立,自 2011 年 7 月 25 日起开始募集,于 2011 年 8 月 26 日结束募集工作,并于 2011 年 9 月 1 日募集成立。

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,《国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“集合计划合同”)自管理人公告的生效之日起生效,原《国海金贝壳 5 号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和集合计划合同的有关规定,本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种,管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本集合计划的投资组合比例为:债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本集合计划所持有现金或到期日在一年

以内的政府债券的比例合计不低于集合计划净资产的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本集合计划的业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数收益率\*90%+中证可转换债券指数收益率\*10%

本财务报表由本基金的管理人国海证券于 2022 年 3 月 31 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本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》、各项具体会计准则及相关规定(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<年度报告和半年度报告>》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》、《国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》和中国证监会、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。

#### 7.4.3 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 6 月 7 日（集合计划合同变更生效日）至 2021 年 12 月 31 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为自 2021 年 6 月 7 日（集合计划合同变更生效日）至 2021 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币，除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本集合计划对金融资产的持有意图和持有能力。本集合计划现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本集合计划目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类

为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本集合计划持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

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

本集合计划目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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，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，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)对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，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，才可以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集合计划资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本集合计划持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本集合计划具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行，且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的集合计划份额总额或对应的金额。每份集合计划份额面值为人民币 1.00 元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于集合计划申购确认日、赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回本集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占计划净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回本集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占计划净值比例计算的金额。损益平准金于本集合计划申购确认日或计划赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按集合计划合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值，即集合计划收益分配基准日的集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 由于本集合计划 A 类份额不收取销售服务费，而 C 类份额收取销售服务费，各份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本集合计划同一类别的每一集合计划份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

无。

#### 7.4.4.13 分部报告

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

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本集合计划的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本集合计划确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本集合计划根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本集合计划持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本集合计划持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关



税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

#### 1、增值税

根据财税[2016]140 号文件的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财税[2017]56 号文件的规定，自 2018 年 1 月 1 日(含)起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财税[2017]90 号文件的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：(1)提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；(2)转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价(2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

#### 2、印花税

比照《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》(财税字[1998]55 号)和《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税[2002]128 号)文件的规定，管理人运用资产管理计划买卖股票，出股票按 1‰的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	1,793,063.65
定期存款	-
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	-

合计	1,793,063.65
----	--------------

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	115,290,181.93	116,358,843.00	1,068,661.07
	银行间市场	353,140,650.55	353,684,600.00	543,949.45
	-	-	-	-
	合计	468,430,832.48	470,043,443.00	1,612,610.52
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	468,430,832.48	470,043,443.00	1,612,610.52	

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
其中：国债期货投资	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
其中：远期外汇投资	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其中：股指期货投资	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 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 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
-	-	-
合计	-	-

## 7.4.7.4.2 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 2021 年 12 月 31 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					-	-	-

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,272.61
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,429.34
应收债券利息	7,158,199.95
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	3.19
合计	7,160,905.09

## 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
其他应收款	-
待摊费用	-
-	-
合计	-

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	31,478.09
银行间市场应付交易费用	8,846.93
	-
合计	40,325.02

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	-
预提费用	24,699.06
合计	24,699.06

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

国海六个月滚动持有债券型 A

项目	本期 2021 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	78,954,569.92	78,954,569.92
本期申购	579,847,390.58	579,847,390.58
本期赎回（以“-”号填列）	-237,888,971.69	-237,888,971.69
-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	420,912,988.81	420,912,988.81

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

国海六个月滚动持有债券型 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	9,572,265.19	1,612,610.52	11,184,875.71
本期基金份额交易产生的变动数	-1,069,244.80	-10,243.72	-1,079,488.52
其中：基金申购款	3,371,314.64	692,518.32	4,063,832.96
基金赎回	-4,440,559.44	-702,762.04	-5,143,321.48

回款			
本期已分配利润			
本期末	8,503,020.39	1,602,366.80	10,105,387.19

## 国海六个月滚动持有债券型 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-	-	-
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	-	-	-
本期末	-	-	-

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	46,156.02
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	36,086.03
其他	29.26
合计	82,271.31

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-96,508.46
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-96,508.46

注：股票投资收益中扣除了增值税的影响。

## 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	1,716,586.58
减：卖出股票成本总额	1,813,095.04
买卖股票差价收入	-96,508.46

注：卖出股票成交总额中扣除了股票投资收益中增值税的影响。

## 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
出借证券现金清偿总额	-
减：出借证券成本总额	-
减：应收证券出借利息	-
证券出借差价收入	-

## 7.4.7.13 债券投资收益

## 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,580,291.55
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	3,580,291.55

注：卖出债券差价收入中扣除了债券投资收益中增值税的影响。

## 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交	597,667,928.64

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	589,030,353.76
减：应收利息总额	5,057,283.33
买卖债券差价收入	3,580,291.55

注：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额中扣除了债券投资收益中增值税的影响。

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31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：赎回债券应收利息总额	-
赎回差价收入	-

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31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：申购债券应收利息总额	-
-	-
申购差价收入	-

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	10,351,076.47
减：卖出资产支持证券成本总额	10,004,000.00
减：应收利息总额	350,958.90
资产支持证券投资收益	-3,882.43

注：卖出资产支持证券成交总额中扣除了资产支持证券投资收益中增值税的影响。

## 7.4.7.14 贵金属投资收益

## 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-

## 7.4.7.14.2 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
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出贵金属成交总额	-
减：卖出贵金属成本总额	-
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	-

## 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-
赎回差价收入	-

## 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-
-	-
申购差价收入	-



## 7.4.7.15 衍生工具收益

## 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出权证成交总额	-
减：卖出权证成本总额	-
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	-
买卖权证差价收入	-

## 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
国债期货投资收益	-25,873.79

注：卖出国债期货投资收益中扣除了增值税的影响。

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	1,612,610.52
股票投资	-
债券投资	1,612,610.52
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	-

期货投资	-
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	1,612,610.52

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年 12月31日
基金赎回费收入	-
-	-
合计	-

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	46,197.33
银行间市场交易费用	15,065.00
-	-
合计	61,262.33

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年 12月31日
审计费用	11,397.26
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	14,517.39
账户维护费	20,373.70
其他	600.00
合计	46,888.35

#### 7.4.7.21 分部报告

截至本期末，本资产管理计划无需作披露的分部报告。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本资产管理计划无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本资产管理计划无需作披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

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
广西投资集团有限公司	基金管理人的股东
广西融桂物流集团有限公司	基金管理人的股东
广西梧州中恒集团股份有限公司	基金管理人的股东
广西投资集团金融控股有限公司	基金管理人的股东
广西桂东电力股份有限公司	基金管理人的股东
广西永盛石油化工有限公司	基金管理人的股东
广西金融投资集团有限公司	基金管理人的股东
国海富兰克林基金管理(上海)有限公司	基金管理人的子公司
国海富兰克林资产管理(上海)有限公司	基金管理人的子公司
国海良时期货有限公司	基金管理人的子公司
国海良时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
国海创新资本投资管理有限公司	基金管理人的子公司
西安国海景恒创业投资有限公司	基金管理人的子公司
国海证券投资有限公司	基金管理人的子公司
中国工商银行股份有限公司	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
国海证券	1,713,691.33	100.00

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
国海证券	211,334,227.78	100.00

## 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
国海证券	1,921,453,000.00	100.00

## 7.4.10.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比例（%）
-	-	-

## 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国海证券	63,863.57	100.00	31,478.09	100.00

## 7.4.10.2 关联方报酬

## 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的0.6%年费率计提，计算方法如下：

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

G 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划管理费划付指令，经托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理

人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	127,443.23

注：本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.05%年费率计提，计算方法如下：

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

T 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划托管费划付指令，经托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.3 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		
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国海六个月滚动持有债券型 A	国海六个月滚动持有债券型 C	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-

#### 7.4.10.3 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期					
	2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日					
	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
-	-	-	-	-	-	-

## 7.4.10.4 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

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

单位：人民币元

本期 2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
	-	-	-	-

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

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

单位：人民币元

本期 2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(单位：张)	出借期限(单位：天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

## 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.5.1 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 2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日	本期 2021年6月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
	国海六个月滚动持有债券型 A	国海六个月滚动持有债券型 C
基金合同生效日（2021年6月7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	1,999,200.32	-
报告期间因拆分变动份额	-	-

减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	1,999,200.32	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.47%	-

#### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

##### 国海六个月滚动持有债券型 A

关联方名称	本期末 2021 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 (%)
-	-	-

份额单位：份

##### 国海六个月滚动持有债券型 C

关联方名称	本期末 2021 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 (%)
-	-	-

#### 7.4.10.6 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 2021 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,793,063.65	46,156.02

注：(1)本集合计划的银行存款由集合计划托管人保管，按银行同业利率计息。本集合计划用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

(2)本集合计划合同自 2021 年 6 月 7 日起生效，无上年度同期可比数据。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021 年 6 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内未在承销期内申购关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

国海六个月滚动持有债券型 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
-	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内无利润分配。

#### 7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	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
113052	兴业 转债	2021 年 12 月 28 日	-	新债未 上市	100.00	100.00	4,140	414,000.00	414,000.00	-
7.4.12.1.3 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	可流通 日	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.4 受限证券类别：权证										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

##### 7.4.12.2 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	股票名	停牌日	停牌原	期末	复牌日	复牌	数量	期末	期末	备注



代码	称	期	因	估值单价	期	开盘单价	(股)	成本总额	估值总 额	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金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 30,119,634.82 元，是以如下债券作为质押：

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
012102274	21 高速地 产 SCP008	2022 年 1 月 4 日	100.05	70,000	7,003,500.00
012104017	21 淮南产 业 SCP002	2022 年 1 月 4 日	100.40	100,000	10,040,000.00
042100248	21 如皋经 贸 CP001	2022 年 1 月 4 日	100.14	34,000	3,404,760.00
102000615	20 武清国 资 MTN002	2022 年 1 月 4 日	98.35	100,000	9,835,000.00
042100374	21 黄石国 资 CP001	2022 年 1 月 5 日	100.09	100,000	10,009,000.00
合计				404,000	40,292,260.00

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金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 19,999,800.00 元，于 2022 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金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。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券 代码	证券名 称	出借到期日	期末估 值 单价	数量（单位： 股）	期末估值 总额
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

### 7.4.13.2 信用风险

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

#### 7.4.13.2.1 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 2021年12月31日
A-1	20,023,000.00
A-1 以下	-
-	-
未评级	240,089,100.00
合计	260,112,100.00

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

#### 7.4.13.2.2 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 2021年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
-	-

未评级	-
合计	-

注：本期末基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

#### 7.4.13.2.3 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 2021年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

注：本期末基金未持有短期信用评级的同业存单。

#### 7.4.13.2.4 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 2021年12月31日
AAA	84,138,627.20
AAA 以下	52,329,215.80
-	-
未评级	5,000,500.00
合计	141,468,343.00

#### 7.4.13.2.5 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 2021年12月31日
AAA	-
AAA 以下	-
-	-
未评级	-
合计	-

注：本期末基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### 7.4.13.2.6 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
--------	-----

	2021 年 12 月 31 日
AAA	68,463,000.00
AAA 以下	-
-	-
未评级	-
合计	68,463,000.00

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。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
资产				
-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	-
负债				
-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-
流动性净额	-	-	-	-

##### 7.4.13.3.2 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

本集合计划管理人定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本集合计划投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,793,063.65	-	-	-	1,793,063.65
结算备付金	2,665,947.15	-	-	-	2,665,947.15
存出保证金	6,285.41	-	-	-	6,285.41
交易性金融资产	369,217,100.00	99,837,413.00	988,930.00	-	470,043,443.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	7,160,905.09	7,160,905.09
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	911,952.82	911,952.82
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	373,682,396.21	99,837,413.00	988,930.00	8,072,857.91	482,581,597.12
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,021.96	1,021.96
应付管理人报酬	-	-	-	255,777.37	255,777.37
应付托管费	-	-	-	21,314.80	21,314.80
应付证券清算款	-	-	-	1,012,680.55	1,012,680.55
卖出回购金融资产款	50,119,434.82	-	-	-	50,119,434.82

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	40,325.02	40,325.02
应付利息	-	-	-	4,313.89	4,313.89
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	83,653.65	83,653.65
其他负债	-	-	-	24,699.06	24,699.06
负债总计	50,119,434.82	-	-	1,443,786.30	51,563,221.12
利率敏感度缺口	323,562,961.39	99,837,413.00	988,930.00	6,629,071.61	431,018,376.00

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-1,396,500.89
	市场利率下降 25 个基点	1,403,758.36

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-

应收股利	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	-	-	-

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	-	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021年12月31日）
分析	-	-

#### 7.4.13.4.3 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。

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	-	-

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)
		本期末 (2021 年 12 月 31 日)
分析	-	-

## 7.4.13.4.4 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 (2021 年 12 月 31 日)
	-	-
	合计	-

## 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## 1、公允价值

## (1) 不以公允价值计量的金融工具

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，其账面价值接近于



公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

① 金融工具公允价值计量的方法

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债，其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是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。

第二层次输入值是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。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

② 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 5,286,843.00 元，属于第二层次的余额为人民币 464,756,600.00 元，无第三层次余额(无上年度同期可比数据)。

③ 公允价值所属层次间的重大变动

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

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	470,043,443.00	97.40
	其中：债券	470,043,443.00	97.40
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	4,459,010.80	0.92
-	-	-	-
8	其他各项资产	8,079,143.32	1.67
9	合计	482,581,597.12	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	-	-
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-

工业	-	-
信息科技	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末无港股通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	603606	东方电缆	1,813,095.04	0.42

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	603606	东方电缆	1,713,691.33	0.40

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,813,095.04
卖出股票收入（成交）总额	1,713,691.33

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	20,002,000.00	4.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,003,000.00	2.32
	其中：政策性金融债	10,003,000.00	2.32
4	企业债券	90,656,000.00	21.03
5	企业短期融资券	230,107,100.00	53.39
6	中期票据	14,835,500.00	3.44
7	可转债（可交换债）	5,700,843.00	1.32
8	同业存单	68,463,000.00	15.88
-	-	-	-

9	其他	30,276,000.00	7.02
10	合计	470,043,443.00	109.05

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	112118249	21 华夏银行 CD249	400,000	39,244,000.00	9.10
2	2128042	21 兴业银行 二级 02	300,000	30,276,000.00	7.02
3	012102153	21 鄂联投 SCP001	300,000	30,012,000.00	6.96
4	149356	21 长城 01	200,000	20,272,000.00	4.70
5	155438	19 远租 01	200,000	20,108,000.00	4.67

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

金额单位：人民币元

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

注：本基金本报告期末无资产支持证券投资。

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

金额单位：人民币元

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

注：本基金本报告期末无贵金属投资。

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

金额单位：人民币元

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

注：本基金本报告期末无权证投资。

### 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.10.1 本期国债期货投资政策

通过套期保值策略控制资产风险，在符合一定条件的市场环境中，采用流动性好、交易活跃的期货合约进行套期保值进而对冲系统性风险、降低投资组合波动性并提高资金管理效率。

#### 8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险指标说明
-	-	-	-	-	-

公允价值变动总额合计（元）	-
国债期货投资本期收益（元）	-25,873.79
国债期货投资本期公允价值变动（元）	-

### 8.10.3 本期国债期货投资评价

国债期货为组合的久期控制提供了更具有流动性的工具，通过套期保值，调整组合久期，同时在资金紧张时有效规避持券带来的潜在高资金成本，后续将继续把握高确定性，力争提升组合收益的同时，控制最大回撤。

### 8.11 投资组合报告附注

#### 8.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

无。

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

否。

#### 8.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,285.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,160,905.09
5	应收申购款	911,952.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	8,079,143.32

#### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132018	G 三峡 EB1	1,231,120.00	0.29
2	110079	杭银转债	722,158.00	0.17
3	113026	核能转债	561,591.20	0.13
4	113024	核建转债	505,758.00	0.12
5	127035	濮耐转债	487,483.20	0.11
6	113602	景 20 转债	369,739.80	0.09
7	128141	旺能转债	334,058.40	0.08
8	128075	远东转债	333,387.60	0.08

9	127036	三花转债	266,772.00	0.06
10	128035	大族转债	241,542.00	0.06
11	127020	中金转债	233,232.80	0.05

### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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

注：本基金本报告期内不存在股票流通受限情况。

### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
国海六个月滚动持有债券型 A	3,253	129,392.25	16,541,906.63	3.93	404,371,082.18	96.07
国海六个月滚动持有债券型 C	-	-	-	-	-	-
合计	3,253	129,392.25	16,541,906.63	3.93	404,371,082.18	96.07

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	国海六个月滚动持有债券型 A	10,962,258.98	2.60
	国海六个月滚动持有债券型 C	-	-

	合计	10,962,258.98	2.60
--	----	---------------	------

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国海六个月滚动持有债券型 A	0
	国海六个月滚动持有债券型 C	-
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国海六个月滚动持有债券型 A	10~50
	国海六个月滚动持有债券型 C	-
	合计	10~50

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
-	公募基金	-
	私募资产管理计划	-
	合计	-

注：本基金基金经理兼任两只证券公司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。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国海六个月滚动持有债券型 A	国海六个月滚动持有债券型 C
基金合同生效日 (2021年6月7日) 基金份额总额	78,954,569.92	-
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	579,847,390.58	-
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	237,888,971.69	-
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额（份额减少 以“-”填列）	-	-

本报告期末基金份额总额	420,912,988.81	-
-------------	----------------	---

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2021 年 10 月 28 日，燕文波先生因个人原因辞去公司副总裁职务。

报告期内，本基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给上会会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 15,699.06 元（含税）。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人或其高级管理人员、基金经理未因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人未因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比	



					例	
国海证券	2	1,713,691.33	100.00%	63,863.57	100.00%	-

### 11.7.2 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
国海证券	211,334,227.78	100.00%	1,921,453,000.00	100.00%	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划(A类份额)产品资料概要	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年6月4日
2	国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划(C类份额)产品资料概要	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年6月4日
3	国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划合同及招募说明书提示性公告	中国证监会规定报刊	2021年6月4日
4	国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书	中国证监会规定网站	2021年6月4日
5	国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同	中国证监会规定网站	2021年6月4日
6	国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产托管协议	中国证监会规定网站	2021年6月4日
7	国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划合同生效公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年6月7日
8	国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划产品开放日常申购(赎回、转换、定期定额投资)业务公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年6月7日
9	国海证券股份有限公司关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划参加国海证券销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年6月7日
10	国海证券股份有限公司关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划参加植信基金销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年6月7日
11	国海证券股份有限公司关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划参加奕丰基金销售机构申购费率优惠	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年6月7日

	活动的公告		
12	国海证券股份有限公司关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划参加兴业银行申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年6月7日
13	国海证券股份有限公司关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划参加通华财富销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年6月7日
14	国海证券股份有限公司关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划参加天天基金销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年6月7日
15	国海证券股份有限公司关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划参加南京苏宁基金销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年6月7日
16	国海证券股份有限公司关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划参加京东肯特瑞销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年6月7日
17	国海证券股份有限公司关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划参加同花顺基金销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年6月10日
18	国海证券股份有限公司关于增加国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划代销机构的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年6月10日
19	国海证券股份有限公司关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划参加植信基金销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年6月22日
20	国海证券股份有限公司关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划参加奕丰基金销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年6月22日
21	国海证券股份有限公司关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划参加兴业银行销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年6月22日
22	国海证券股份有限公司关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划参加同花顺基金销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021年6月22日

23	国海证券股份有限公司关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划参加通华财富销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 6 月 22 日
24	国海证券股份有限公司关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划参加天天基金销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 6 月 22 日
25	国海证券股份有限公司关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划参加南京苏宁基金销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 6 月 22 日
26	国海证券股份有限公司关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划参加京东肯特瑞销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 6 月 22 日
27	国海证券股份有限公司关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划参加国海证券销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 6 月 22 日
28	国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划暂停大额申购、大额转换转入公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 6 月 24 日
29	国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划恢复大额申购、大额转换转入公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 9 月 29 日
30	国海证券股份有限公司关于增加上海陆金所基金销售有限公司为国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划销售机构的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 10 月 8 日
31	国海证券股份有限公司关于国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划参加陆金所基金销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2021 年 10 月 8 日
32	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 2021 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2021 年 10 月 27 日
33	国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划 2021 年第 3 季度报告	中国证监会规定网站	2021 年 10 月 27 日
34	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	2021 年 11 月 2 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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							
-							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、《国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》；
- 3、《国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 5、法律法规及中国证监会规定的其他文件。

### 13.2 存放地点

上海市黄浦区福佑路 8 号人保寿险大厦 11 层。

### 13.3 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）查阅，或在营业时间内至集合计划管理人的办公场所免费查阅。

国海证券股份有限公司

2022 年 3 月 31 日