

东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:东证融汇证券资产管理有限公司

基金托管人:中国证券登记结算有限责任公司

报告送出日期:2023 年 08 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。本中期报告已经全部董事签字同意，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2023年8月25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2023年01月01日起至2023年06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.....	6
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.....	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产(基金净值)变动表.....	16
6.4 报表附注.....	19
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 债券回购融资情况.....	39
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	39
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.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	40
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.....	41
7.8 期末按公允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.....	42
7.9 投资组合报告附注.....	42
§ 8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	43

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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	43
§ 9 开放式基金份额变动	43
§ 10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	45
10.9 其他重大事件	46
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	47
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	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§ 12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划
基金简称	东证融汇现金管家货币
基金主代码	970174
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 06 月 17 日
基金管理人	东证融汇证券资产管理有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司
报告期末基金份额总额	1,457,726,476.63 份
基金合同存续期	自《东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划资产管理合同》生效日起不得超过 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定的收益。
投资策略	本集合计划主要采用：1、资产配置策略，集合计划根据宏观经济运行状况、政策形势、信用状况、利率走势、资金供求变化等的综合判断，并结合各类资产的流动性特征、风险收益、估值水平特征，决定集合计划资产在债券、银行存款等各类资产的配置比例，并适时进行动态调整；2、个券选择策略，在个券选择上，集合计划将综合运用收益率曲线分析、流动性分析、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值，发掘出具备相对价值的个券；3、利率策略，通过全面研究 GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量，分析宏观经济运行的可能情景，并预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构；4、利用短期市场机会的灵活策略，市场波动及市场资金供求发生短时的波动可能带来一定市场机会，通过分析短期市场机会发生的动因，研究其中的规律，据此调整组合配置，改进操作方法，积极利用市场机会争取获得超额收益。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本集合计划是一只货币型集合计划，其预期风险和预期收益低于债券型基金、债券型集合计划、混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、股票型集合计划。

本报告中所述的“基金”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。东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划简称“本集合计划”。

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		东证融汇证券资产管理有限公司	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露负责人	姓名	王钟	陈晨
	联系电话	021-20361199	010-50938723
	电子邮箱	dzrhyy@nesc.cn	zctg@chinaclear.com.cn
客户服务电话		021-20361067	4008-058-058
传真		021-20361084	-
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 255 号 540 室	北京市西城区太平桥大街 17 号
办公地址		上海市浦东新区杨高南路 729 号陆家嘴世纪金融广场 1 号楼 16 层	北京市西城区锦什坊街 26 号
邮政编码		200127	100033
法定代表人		李福春	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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.dzronghui.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区杨高南路 729 号陆家嘴世纪金融广场 1 号楼 16 层

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（2023 年 01 月 01 日-2023 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	9,751,138.94

本期利润	9,751,138.94
本期净值收益率	0.5660%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2023年06月30日）
期末基金资产净值	1,457,726,476.63
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2023年06月30日）
累计净值收益率	1.1252%

注：（1）所述集合计划业绩指标不包括持有人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。

（2）本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（3）本集合计划收益“每日分配、按月支付”，收益支付方式为现金分红。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.0863%	0.0002%	0.1110%	0.0000%	-0.0247%	0.0002%
过去三个月	0.2761%	0.0002%	0.3371%	0.0000%	-0.0610%	0.0002%
过去六个月	0.5660%	0.0003%	0.6717%	0.0000%	-0.1057%	0.0003%
过去一年	1.0874%	0.0005%	1.3591%	0.0000%	-0.2717%	0.0005%
自基金合同生效起至今	1.1252%	0.0005%	1.4116%	0.0000%	-0.2864%	0.0005%

注：本集合计划收益“每日分配、按月支付”，收益支付方式为现金分红。

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

东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年06月17日-2023年06月30日)



注：(1) 净值表现所取数据截至 2023 年 6 月 30 日。

(2) 本集合计划合同于 2022 年 06 月 17 日生效。本集合计划份额相关数据和指标按照实际存续期（2022 年 06 月 17 日至 2023 年 6 月 30 日）计算。

(3) 按照本集合计划合同的约定，管理人应自资产管理合同生效日起 6 个月内使集合计划的投资组合比例符合资产管理合同的有关约定。截至本报告期末，本集合计划已建仓完毕，建仓期结束时各项资产配置比例符合集合计划合同约定。

§ 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

东证融汇证券资产管理有限公司（以下简称“东证融汇”）是经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准东北证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可[2015]1565号）批准，于 2015 年 12 月 24 日成立，并于 2016 年 2 月 22 日正式开展证券资产管理业务。东证融汇注册地上海，注册资本 70000 万元人民币，系东北证券股份有限公司旗下全资子公司。

公司紧密围绕客户需求，并结合国内外资产管理业务发展现状和券商资产管理业务发展趋势，形成了财富管理全产业链产品体系，投资范围覆盖了固定收益类、固收+类、权益类、混合类、现金管理、场外衍生品等各种类型，涵盖了场内外各类投资标的，运作期限灵活，能够满足投资者多层次、多样化的资产配置需求。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日颁布的《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，并经中国证监会的批

准，截至报告期末，东证融汇已有 5 只大集合产品完成合同变更并参照公募基金持续运作，分别为：东证融汇成长优选混合型集合资产管理计划、东证融汇鑫享 30 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划、东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划、东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划、东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
应洁茜	本集合计划的投资经理、东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划投资经理、东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划投资经理、东证融汇鑫享 30 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划投资经理、公募投资管理部总经理	2022-06-17	-	9 年	浙江大学财务管理学士，美国北卡罗来纳州立大学会计管理学硕士，9 年以上固定收益领域交易投资及产品管理经验，4 年债券型公募基金产品投资经验，曾任浙江浙商证券资产管理有限公司基金经理。2021 年 1 月加入东证融汇证券资产管理有限公司，现任东证融汇公募投资管理部总经理、投资经理。
郑铮	本集合计划的投资经理、东证融汇鑫享 30 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划投资经理、东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划投资经理、东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划投资经理	2023-01-11	-	6 年	上海理工大学管理学学士，具有 6 年证券从业经历。曾任光大保德信基金管理有限公司债券交易员、金元顺安基金管理有限公司债券交易员。2022 年 1 月加入东证融汇证券资产管理有限公司，历任东证融汇证券资产管理有限公司公募投资管理部投资经理助理，现任公司公募投资管理部投资经理。
李卿睿	本集合计划的投资经理、东证融汇禧悦 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划投资经理、东证融汇	2023-01-11	-	3 年	深圳大学金融学学士。曾任上海国际货币经纪有限责任公司货币经纪人、华林证券股份有限公司高级交易员、平安信托有限责任公司

	添添益中短债债券型集合资产管理计划投资经理、东证融汇鑫享 30 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划投资经理			投资经理、太平养老保险股份有限公司投资经理。2022 年 3 月加入东证融汇证券资产管理有限公司，历任东证融汇证券资产管理有限公司投资经理、多策略研究员，现任公司公募投资管理部投资经理。
--	---	--	--	---

注：“任职日期”和“离任日期”均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的涵义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》以及行业协会的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、《中华人民共和国证券法》、本集合计划资产管理合同及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，为本集合计划份额持有人谋求最大利益，无损害本集合计划持有人利益的行为，本集合计划投资组合符合有关法规及合同的约定。

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集合计划和投资组合，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，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《东证融汇证券资产管理有限公司公平交易管理办法》等有关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，管理人管理的所有投资组合不存在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 5% 的情况，未发现本集合计划存在有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

复盘上半年，一季度经济数据出炉显示完成全年 GDP 增速目标的压力不大，而二季度的数据表明内需恢复暂不理想，PMI 位于收缩区间，基本面修复边际放缓确立，中央

政治局会议强调“高质量发展”。流动性方面，信贷明显趋缓，部分中小银行下调存款利率，银行间资金面持续宽松，收益率出现下行。

本报告期内，本集合计划秉持既定的投资思路，采用短久期策略，灵活参与波段交易，将防范信用和流动性风险放在产品运作的首位，力争在保证安全性和流动性的前提下增厚整体收益，报告期内本投资组合策略运行良好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末东证融汇现金管家货币基金份额净值为 1.000 元，本报告期内，基金份额净值收益率为 0.5660%，同期业绩比较基准收益率为 0.6717%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，目前经济依然面临一定的周期性压力，继续维持弱复苏态势，预计流动性会保持合理充裕，资金利率在政策利率附近波动；但是同时也需要关注相关刺激政策的落地情况对债券市场带来的影响。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本集合计划管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和集合计划合同关于估值的约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值。本集合计划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。

本集合计划管理人设有估值委员会，估值委员会负责对投资品种的估值政策、估值方法和估值模型进行评估、研究、决策，确定估值业务的操作流程和风险控制。估值委员会成员具有丰富的从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或产品估值运作等方面的专业胜任能力。集合计划投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本集合计划管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本集合计划合同约定，本集合计划根据每日计划收益情况，以每万份集合计划暂估净收益为基准，为投资人每日计算当日暂估收益，并在分红日根据实际净收益按月集中

支付。本报告期内分配利润 9,751,138.94 元，符合本集合计划资产管理合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或集合计划资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	387,794,267.63	557,246,805.34
结算备付金		704,760.83	1,510,065.53
存出保证金		9,531.73	69,368.91
交易性金融资产	6.4.7.2	1,071,172,510.67	967,078,832.97
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,071,172,510.67	967,078,832.97
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	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
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	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,459,681,070.86	1,525,905,072.75

负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,260,590.86	1,237,987.40
应付托管费		69,789.08	68,929.51
应付销售服务费		350,164.16	13,755.41
应付投资顾问费		-	-
应交税费		15,769.92	14,534.54
应付利润		166,512.05	316,964.70
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	91,768.16	38,907.62
负债合计		1,954,594.23	1,691,079.18
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,457,726,476.63	1,524,213,993.57
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		1,457,726,476.63	1,524,213,993.57
负债和净资产总计		1,459,681,070.86	1,525,905,072.75

报告截止日 2023 年 06 月 30 日，本集合计划份额净值 1.0000 元，本集合计划份额

总额 1,457,726,476.63 份。截止 2022 年 12 月 31 日,本集合计划份额净值 1.0000 元,本集合计划份额总额 1,524,213,993.57 份。

6.2 利润表

会计主体:东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划

本报告期:2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 06 月 17 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 06 月 30 日
一、营业总收入		19,560,043.27	733,481.84
1. 利息收入		6,836,119.47	302,866.61
其中:存款利息收入	6.4.7.9	6,167,382.85	203,995.12
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		668,736.62	98,871.49
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		12,723,923.80	430,615.23
其中:股票投资收益	6.4.7.10.1	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	12,723,923.80	430,615.23
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
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）	6.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、营业总支出		9,808,904.33	405,879.68
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,716,850.96	303,480.97
2. 托管费	6.4.10.2.2	428,622.85	16,850.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,539,700.42	84,300.26
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		6,145.24	-
其中：卖出回购金融资产支出		6,145.24	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		17,741.00	547.08
8. 其他费用	6.4.7.20	99,843.86	700.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,751,138.94	327,602.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,751,138.94	327,602.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,751,138.94	327,602.16

注：本集合计划合同生效日为 2022 年 06 月 17 日，上年度实际可比区间为 2022 年 06 月 17 日至 2022 年 06 月 30 日。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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（基金净值）	1,524,213,993.57	-	-	1,524,213,993.57
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,524,213,993.57	-	-	1,524,213,993.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-66,487,516.94	-	-	-66,487,516.94
（一）、综合收益总额	-	-	9,751,138.94	9,751,138.94
（二）、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）	-66,487,516.94	-	-	-66,487,516.94
其中：1. 基金申购款	20,859,173,704.38	-	-	20,859,173,704.38
2. 基金赎回款	-20,925,661,221.32	-	-	-20,925,661,221.32
（三）、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）	-	-	-9,751,138.94	-9,751,138.94
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,457,726,476.63	-	-	1,457,726,476.63
项 目	上年度可比期间 2022 年 06 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

		收 益		
一、上期期末净资产（基金净值）	847,549,163.45	-	-	847,549,163.45
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	847,549,163.45	-	-	847,549,163.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,623,482.23	-	-	-6,623,482.23
（一）、综合收益总额	-	-	327,602.16	327,602.16
（二）、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）	-6,623,482.23	-	-	-6,623,482.23
其中：1. 基金申购款	787,929,272.66	-	-	787,929,272.66
2. 基金赎回款	-794,552,754.89	-	-	-794,552,754.89
（三）、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）	-	-	-327,602.16	-327,602.16
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	840,925,681.22	-	-	840,925,681.22

注：本集合计划合同生效日为 2022 年 06 月 17 日，上年度实际可比区间为 2022 年 06 月 17 日至 2022 年 06 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王钟

陶丽

邵辉

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

东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）原为东北证券现金管家集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）。原集合计划于 2013 年 1 月 18 日起开始募集并于 2013 年 2 月 1 日结束募集，于 2013 年 2 月 4 日成立，并于 2013 年 3 月 14 日获中国证券业协会中证协函〔2013〕200 号文备案确认。

原集合计划在募集期间收到客户有效净参与资金为人民币 295750000.00 元，折合认购份额 295750000.00 份；以上实收资金共计人民币 295750000.00 元，折合 295750000.00 份集合计划份额。上述出资业经中准会计师事务所（特殊普通合伙）审验。原集合计划的管理人为东北证券股份有限公司（以下简称“东北证券”），后变更为东证融汇证券资产管理有限公司（以下简称“东证融汇”），托管人为中国证券登记结算有限责任公司。

根据中国证券监督管理委员会（以下简称“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》（证监会公告[2018]39 号）规定，中国证监会已完成对本集合计划的规范验收并批准了合同变更。

经中国证监会批准，自 2022 年 6 月 17 日起，“东北证券现金管家集合资产管理计划”正式更名为“东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划”，《东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《东北证券现金管家集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。本集合计划为大集合产品，系管理人依据《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》进行规范并经中国证监会备案的投资者人数不受 200 人限制的集合资产管理计划。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划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。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本集合计划的业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

本集合计划为货币型集合资产管理计划，自本集合计划合同生效日起存续期不超过 3 年。本集合计划自资产管理合同生效日起 3 年内，按照中国证监会有关规定执行。东证融汇是本集合计划的管理人，中国证券登记结算有限责任公司是本集合计划的托管人，东北证券及其他符合条件的代销机构是本集合计划的销售机构。

本财务报表由本集合计划的管理人东证融汇于 2023 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本集合计划 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日间经营成果和净资产变动情况及 2023 年 6 月 30 日的财务状况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

集合计划目前比照公开募集证券投资基金所依据的相关财税法规和实务操作及其

他相关国内财税法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

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

(2) 对集合计划从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，从基金分配中取得的收入，债券的利息收入及其他收入，暂不计缴企业所得税。

(3) 集合计划卖出股票按 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。

(4) 集合计划的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日
活期存款	387,794,267.63
等于：本金	387,517,448.69
加：应计利息	276,818.94
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	387,794,267.63

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 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	82,751,054.06	82,738,441.10	-12,612.96	-0.0009
	银行间市场	988,421,456.61	988,700,779.58	279,322.97	0.0192
	合计	1,071,172,510.67	1,071,439,220.68	266,710.01	0.0183
资产支持证券		-	-	-	-
合计		1,071,172,510.67	1,071,439,220.68	266,710.01	0.0183

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

本集合计划本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本集合计划本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 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	12,425.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	12,425.00
应付利息	-
预提费用	79,343.16
合计	91,768.16

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,524,213,993.57	1,524,213,993.57
本期申购	20,859,173,704.38	20,859,173,704.38
本期赎回（以“-”号填列）	-20,925,661,221.32	-20,925,661,221.32
本期末	1,457,726,476.63	1,457,726,476.63

6.4.7.8 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	-	-	-
本期利润	9,751,138.94	-	9,751,138.94
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	-9,751,138.94	-	-9,751,138.94
本期末	-	-	-

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	5,929,792.38
定期存款利息收入	202,300.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	34,859.97
其他	430.50
合计	6,167,382.85

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本集合计划本报告期无股票投资收益——买卖股票差价收入。

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本集合计划本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.11 基金投资收益

本集合计划本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	12,729,170.70
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-5,246.90
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	12,723,923.80

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,708,395,171.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,689,337,577.77
减：应计利息总额	19,062,841.10
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-5,246.90

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本集合计划本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本集合计划本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本集合计划本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本集合计划本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

本集合计划本报告期无其他收入。

6.4.7.19 信用减值损失

本集合计划本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,900.70
账户维护费	18,600.00
合计	99,843.86

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本集合计划无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本集合计划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
东证融汇证券资产管理有限公司	集合计划管理人
东北证券股份有限公司	集合计划管理人的控股股东、集合计划销售机构、集合计划份额持有人
中国证券登记结算有限责任公司	集合计划托管人、集合计划注册登记机构

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

本集合计划本报告期及上年度可比期间内未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间内未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月 30日		上年度可比期间 2022年06月17日 (基金合同生效日)至2022年06 月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交 总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交 总额的比例
东北证券股份有限公司	80,128,600.00	100.00%	40,168,800.00	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 06 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东北证券股份有限公司	4,320,000,000.00	100.00%	12,188,000,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 基金交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本集合计划本报告期及上年度可比期间内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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 06 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,716,850.96	303,480.97
其中：支付销售机构的客户维护费	3,722,886.81	109,101.99

注：（1）本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.90% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.90\% \div \text{当年天数}$$

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

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

（2）上年度可比期间取合同生效日（2022 年 6 月 17 日）至 2022 年 6 月 30 日的的数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 06 月 17 日（基金合同生效日） 至 2022 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的 托管费	428,622.85	16,850.95

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% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

（2）上年度可比期间取合同生效日（2022 年 6 月 17 日）至 2022 年 6 月 30 日的数据。

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
东北证券股份有限公司	1,539,700.42
合计	1,539,700.42
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 06 月 17 日（基金 合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
东北证券股份有限公司	60,692.77
合计	60,692.77

注：（1）销售服务费用于支付销售机构佣金、营销费用以及集合计划份额持有人服务费等。销售服务费用于支付销售机构佣金、营销费用以及集合计划份额持有人服务费等。本集合计划销售服务费按前一日集合计划资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

（2）根据本集合资产管理计划管理人发布的《关于东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划销售服务费率优惠活动的公告》，从 2022 年 7 月 5 日（含）至 2023 年 2 月 23 日（含）将投资者持有本集合计划份额的销售服务费年费率从 0.25% 降至 0.01%。

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

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本集合计划管理人本报告期及上年度可比期间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 2023 年 06 月 30 日		上年度末 2022 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
东北证券股份有限公司	24,438,964	1.68%	11,801,369.00	0.77%

注：本报告期内，上述关联方投资本集合计划的适用费率符合本集合计划招募说明书和相关公告的规定。

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 06 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 06 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	6,646,477.66	1,747,160.58	34,842,554.25	66,404.37

注：本集合计划上述银行存款由本集合计划托管人中国证券登记结算有限责任公司保管，存放在中国工商银行股份有限公司，按约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期及上年度可比期间内没有须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金

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
-	9,901,591.59	-150,452.65	9,751,138.94	-

本集合计划根据每日计划收益情况，以每万份集合计划暂估净收益为基准，为投资人每日计算当日暂估收益，并在分红日根据实际净收益按月集中支付。投资者解约情形下，管理人将按照当期年化暂估收益率与同期中国人民银行公布的活期存款基准利率孰低的原则对该投资人进行收益分配。本集合计划本报告期内利润分配为人民币 9,751,138.94 元（其中现金分配为 9,901,591.59 元，应付利润变动数为-150,452.65 元）。

6.4.12 期末（2023 年 06 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

本集合计划本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本集合计划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为 0 元，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本集合计划从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元，无质押债券。

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

管理人构建了由董事会及下设的专业决策机构、经理层、风险管理部门及风险管理相关职能部门、各业务部门和岗位构成的风险管理体系，并明确了管理人监事在全面风险管理中的职责。

董事会下设公募投资决策委员会，对董事会负责，在授权范围以会议的形式对相关事宜进行集体讨论和决策，发挥专业决策和风险控制作用。监事承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和经理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。经理层对全面风险管理承担主要责任，遵循风险管理总体目标，执行风险管理政策。管理人风险管理部门在首席风险官领导下负责推动和落实公司全面风险管理工作。风险管理相关职能部门按职能分工分别履行相应的风险管理职能。各业务部门负责全面识别、评估、应对与报告其相关业务的各类风险。各岗位负责自觉执行各项风险管理制度和流程。

管理人采取定性与定量相结合的方法，根据风险发生的可能性及其影响程度对识别的风险进行评估。管理人根据风险评估和监控预警的结果，权衡风险与收益，选择与公司风险偏好相适应的风险应对策略，建立合理、有效的应对机制；对于难以通过计量进行评估和预警的风险，管理人通过建立制度、标准化业务流程和信息系统等对相关风险进行有效管理和控制。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指本集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者本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。管理人通过严格的证券库制度、交易对手库制度和分散化投资方式防范信用风险。

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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	50,390,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	222,005,707.60	223,150,567.60
合计	222,005,707.60	273,540,567.60

注：未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券、短期证券公司债。债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
--------	----------------------	-----------------------

		日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	766,415,749.01	427,597,555.33
合计	766,415,749.01	427,597,555.33

注：同业存单投资以全价列示。

6.4.13.2.3 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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	82,751,054.06	265,940,710.04
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	82,751,054.06	265,940,710.04

注：债券投资以全价列示。

6.4.13.3 流动性风险

本集合计划流动性风险是指集合计划在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于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，另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。

管理人采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范投资品种的流动性风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，管理人每日对本集合计划的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持本集合计划投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。管理人在产品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模式带来的流动性风险，有效保障本集合计划持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

管理人在本集合计划运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本集合计划组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，部分集合计划资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见本报告“期末(2023年06月30日)本基金持有的流通受限证券”章节。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现能力较好。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1- 5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	387,794,267.63	-	-	-	-	-	387,794,267.63
结算备付金	704,760.83	-	-	-	-	-	704,760.83
存出保证金	9,531.73	-	-	-	-	-	9,531.73
交易性金融资产	382,908,208.42	390,856,922.84	297,407,379.41	-	-	-	1,071,172,510.67

资产总计	771,416,768 .61	390,856,922 .84	297,407,379 .41	-	-	-	1,459,681,07 0.86
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,260,590. 86	1,260,590.86
应付托管费	-	-	-	-	-	69,789.08	69,789.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-	350,164.16	350,164.16
应交税费	-	-	-	-	-	15,769.92	15,769.92
应付利润	-	-	-	-	-	166,512.05	166,512.05
其他负债	-	-	-	-	-	91,768.16	91,768.16
负债总计	-	-	-	-	-	1,954,594. 23	1,954,594.23
利率敏	771,416,768 .61	390,856,922 .84	297,407,379 .41	-	-	-1,954,594 .23	1,457,726,47 6.63

感度缺口							
上年度末 2022年 12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	557,246,805.34	-	-	-	-	-	557,246,805.34
结算备付金	1,510,065.53	-	-	-	-	-	1,510,065.53
存出保证金	69,368.91	-	-	-	-	-	69,368.91
交易性金融资产	131,825,968.93	402,466,183.28	432,786,680.76	-	-	-	967,078,832.97
资产总计	690,652,208.71	402,466,183.28	432,786,680.76	-	-	-	1,525,905,072.75
负债							

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,237,987.40	1,237,987.40
应付托管费	-	-	-	-	-	68,929.51	68,929.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13,755.41	13,755.41
应交税费	-	-	-	-	-	14,534.54	14,534.54
应付利润	-	-	-	-	-	316,964.70	316,964.70
其他负债	-	-	-	-	-	38,907.62	38,907.62
负债总计	-	-	-	-	-	1,691,079.18	1,691,079.18
利率敏感度缺口	690,652,208.71	402,466,183.28	432,786,680.76	-	-	-1,691,079.18	1,524,213,993.57

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	441,377.13	668,935.15
	市场利率上升 25 个基点	-439,967.35	-666,625.81

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，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本集合计划主要投资于固定收益类金融工具，主要风险为利率风险和信用风险，其他的市场因素对本集合计划资产净值无重大影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外，相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	1,071,172,510.67	967,078,832.97

第三层次	-	-
合计	1,071,172,510.67	967,078,832.97

于 2023 年 6 月 30 日，本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为 1,071,172,510.67 元，无属于第三层次的余额。（于 2022 年 12 月 31 日，本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为 967,078,832.97 元，无属于第三层次的余额。）

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	1,071,172,510.67	73.38
	其中：债券	1,071,172,510.67	73.38
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-

	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	388,499,028.46	26.62
4	其他各项资产	9,531.73	0.00
5	合计	1,459,681,070.86	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.05	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

在本报告期内本集合计划债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	45
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	61
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	20

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本集合计划投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限(天数)	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	52.92	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	20.67	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	6.15	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	17.02	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	3.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.13	-

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

本报告期内本集合计划投资组合平均剩余期限未超过 240 天。

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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	82,751,054.06	5.68
5	企业短期融资券	222,005,707.60	15.23
6	中期票据	-	-
7	同业存单	766,415,749.01	52.58
8	其他	-	-
9	合计	1,071,172,510.67	73.48
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)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	112208078	22 中信银行 CD078	1,000,000	99,833,307.57	6.85
2	112214170	22 江苏银行 CD170	1,000,000	99,238,645.15	6.81
3	163731	20 光证 G3	500,000	51,759,492.29	3.55
4	012284354	22 电网 SCP022	500,000	50,572,465.51	3.47
5	012381636	23 蓝星 SCP002	500,000	50,217,863.85	3.44
6	012381872	23 大唐租赁 SCP004	500,000	50,135,305.19	3.44
7	112210210	22 兴业银行 CD210	500,000	49,990,412.97	3.43
8	112216116	22 上海银行 CD116	500,000	49,980,264.78	3.43
9	112211096	22 平安银行 CD096	500,000	49,901,873.08	3.42
10	112204026	22 中国银行 CD026	500,000	49,894,720.56	3.42

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	0.0268%
报告期内偏离度的最低值	-0.0937%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0342%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本集合计划本报告期内未出现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

本集合计划本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按公允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

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

本集合计划采用摊余成本法计价。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本集合计划投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查的情况。在报告编制日前一年内，本集合计划投资的前十名证券的发行主体中：平安银行股份有限公司被中国人民银行处以行政处罚；上海银行股份有限公司被国家外汇管理局上海市分局处以行政处罚；中国银行股份有限公司被中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会重庆监管局处以行政处罚；江苏银行股份有限公司被中国人民银行处以行政处罚；兴业银行股份有限公司被中国银行保险监督管理委员会处以行政处罚。

本集合计划对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及集合计划合同的要求。除此以外，本集合计划投资的其他前十名证券的发行主体在报告编制日前一年内未有受到公开谴责、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	9,531.73
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	9,531.73

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		其他投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
21,574	67,568.67	48,053,614.17	3.30%	1,323,129,024.73	90.77%	86,543,837.73	5.94%

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	其他机构	79,587,116.78	5.46%
2	个人	53,720,434.07	3.69%
3	券商类机构	24,438,964.00	1.68%
4	个人	9,677,385.08	0.66%
5	个人	8,193,931.38	0.56%
6	个人	7,398,616.43	0.51%
7	个人	6,696,015.94	0.46%
8	个人	6,594,734.06	0.45%
9	个人	6,331,396.27	0.43%
10	个人	6,011,573.15	0.41%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末集合计划管理人的从业人员未持有本集合计划。

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022年06月17日）基金份额总额	847,549,163.45
本报告期期初基金份额总额	1,524,213,993.57

本报告期基金总申购份额	20,859,173,704.38
减：本报告期基金总赎回份额	20,925,661,221.32
本报告期期末基金份额总额	1,457,726,476.63

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本集合计划未召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本集合计划管理人、托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本集合计划未发生对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的涉及集合计划财产、集合计划管理业务、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无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本集合计划本报告期内未改聘为其提供审计服务的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本集合计划管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本集合计划托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东北证券股份有限公司	80,128,600.00	100.00%	4,320,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本集合计划本报告期内未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划投资经理变更公告	规定报刊、网站	2023-01-11
2	东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划招募说明书及产品资料概要更新的提示性公告	规定报刊	2023-01-13
3	东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划更新招募说明书（2023 年第 1 号）	规定网站	2023-01-13
4	东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划基金产品资料概要更新（2023 年第 1 号）	规定网站	2023-01-13
5	东证融汇证券资产管理有限公司关于旗下集合资产管理计划风险等级划分的公告	规定报刊、网站	2023-01-14
6	东证融汇证券资产管理有限公司旗下集合资产管理计划 2022 年第四季度报告提示性公告	规定报刊	2023-01-19
7	东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划 2022 年第四季度报告	规定网站	2023-01-19
8	关于东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划销售服务费率优惠活动的公告	规定报刊、网站	2023-01-20
9	东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定报刊、网站	2023-01-30
10	东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定报刊、网站	2023-02-23
11	东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定报刊、网站	2023-03-23
12	东证融汇证券资产管理有限公司	规定报刊	2023-03-30

	限公司旗下集合资产管理计划 2022 年年度报告提示性公告		
13	东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划 2022 年年度报告	规定网站	2023-03-30
14	东证融汇证券资产管理有限公司旗下集合资产管理计划 2023 年第一季度报告提示性公告	规定报刊	2023-04-21
15	东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划 2023 年第一季度报告	规定网站	2023-04-21
16	东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定报刊、网站	2023-04-24
17	东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定报刊、网站	2023-05-23
18	东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划招募说明书及产品资料概要更新的提示性公告	规定报刊	2023-06-13
19	东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划更新招募说明书（2023 年第 2 号）	规定网站	2023-06-13
20	东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划基金产品资料概要更新（2023 年第 2 号）	规定网站	2023-06-13
21	东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定报刊、网站	2023-06-26

§ 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

本集合计划本报告期内未出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本集合计划未有影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意变更的文件。
- 2、东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划资产管理合同。
- 3、东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划托管协议。
- 4、东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划招募说明书。
- 5、管理人业务资格批件、营业执照。
- 6、托管人业务资格批件、营业执照。
- 7、东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

上海市浦东新区杨高南路 729 号陆家嘴世纪金融广场 1 号楼 16 层。

12.3 查阅方式

投资者可到管理人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

如有疑问，可咨询本管理人。

东证融汇证券资产管理有限公司
二〇二三年八月三十日