

东海证券现金管家现金管理型集合资产管理计划  
2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：东海证券股份有限公司

基金托管人：中国证券登记结算有限责任公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 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 2023 年 10 月 24 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 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 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	181,315,433.89 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（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	937,086.42
2. 本期利润	937,086.42
3. 期末基金资产净值	181,315,433.89

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）。

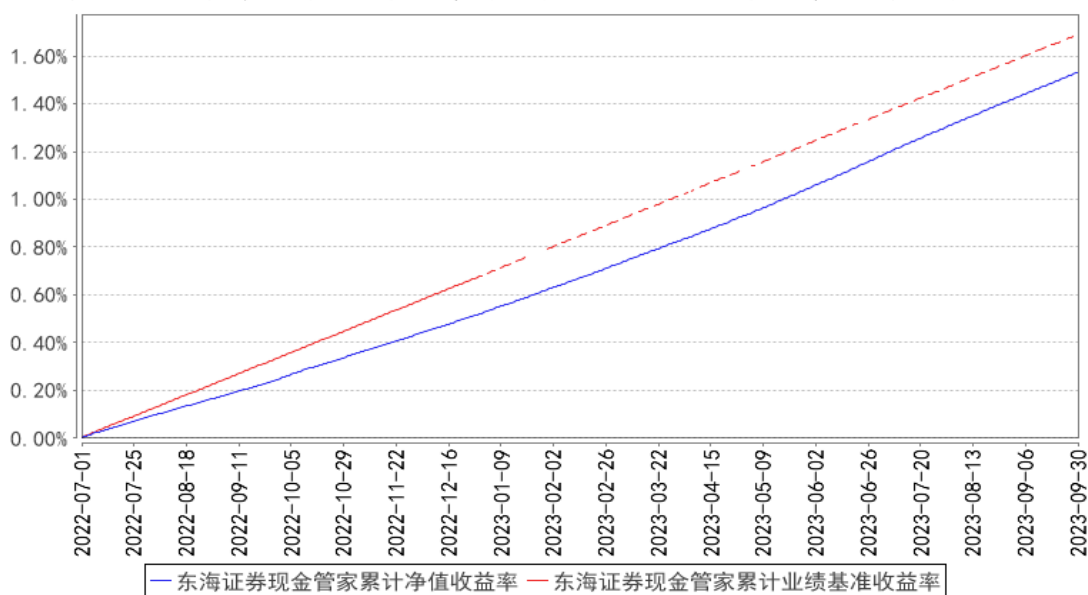
### 3.2 基金净值表现

#### 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	0.3532%	0.0002%	0.3403%	0.0000%	0.0129%	0.0002%
过去六个月	0.7010%	0.0003%	0.6768%	0.0000%	0.0242%	0.0003%
过去一年	1.2788%	0.0005%	1.3500%	0.0000%	-0.0712%	0.0005%
自基金合同 生效起至今	1.5310%	0.0005%	1.6903%	0.0000%	-0.1593%	0.0005%

#### 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：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 2023 年 9 月 30 日；

(2) 本集合计划投资于以下金融工具：1、现金；2、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、中央银行票据、同业存单；3、期限在 1 个月以内的债券回购；4、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券；5、中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本集合计划投资于前款第 4 项的，其中企业债、公司债、短期融资券、中期票据的主体信用评级和债项信用评级均应当为最高级；超短期融资券的主体信用评级应当为最高级。信用评级主要参照最近一个会计年度的信用评级，发行人同时有两家以上境内评级机构评级的，按照孰低原则确定评级。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（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	东海证券股份有限公司资产管理部投资经理	2022 年 7 月 1 日	-	10 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，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

## 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，2023 年三季度逆回购投放 81420 亿元，逆回购到期 68640 亿元；MLF 投放 10950 亿元，MLF 到期 9000 亿元；央行票据互换发行 150 亿元，央行票据互换到期 150 亿元；开展国库现金定存操作 1600 亿元，国库现金定存到期 1100 亿元；合计净投放 15230 亿元。银行间 1 天债券质押式回购利率加权平均值 1.7119%，银行间 7 天债券质押式回购利率加权平均值 2.0140%，资金面总体较为宽松。报告期内，本组合在保持流动性的基础上，通过操作积极增厚组合收益。

## 4.5 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 0.3532%，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	185,709,315.81	94.05
	其中：债券	185,709,315.81	94.05
	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	10,248,911.02	5.19
4	其他资产	1,509,660.83	0.76
5	合计	197,467,887.66	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	0.53	
	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	14,476,182.70	7.98
	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	118
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	120
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	67

#### 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	23.02	7.98
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动 利率债	-	-

2	30 天（含）—60 天	7.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	6.04	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	13.82	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	57.15	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	107.74	7.98

#### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	17,383,136.57	9.59
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	7,128,363.25	3.93
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	71,882,359.30	39.64
7	同业存单	89,315,456.69	49.26
8	其他	-	-
9	合计	185,709,315.81	102.42
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	101900070	19 陕延油 MTN001	100,000	10,318,172.52	5.69
2	102102079	21 国电 MTN005	100,000	10,301,577.93	5.68
3	102100286	21 陕延油 MTN002	100,000	10,290,946.85	5.68
4	101900451	19 华电股 MTN001	100,000	10,289,172.83	5.67
5	102102129	21 中石集 MTN004	100,000	10,267,124.78	5.66

6	102100672	21 广核电力 MTN001	100,000	10,224,770.76	5.64
7	102280139	22 华电 MTN001A	100,000	10,190,593.63	5.62
8	112204041	22 中国银行 CD041	100,000	9,987,024.34	5.51
9	112320040	23 广发银行 CD040	100,000	9,972,586.03	5.50
10	112318076	23 华夏银行 CD076	100,000	9,949,658.33	5.49

### 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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0769%
报告期内偏离度的最低值	-0.0735%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0502%

#### 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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	9,660.83
2	应收证券清算款	1,500,000.00
3	应收利息	-



4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	1,509,660.83

#### 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	257,637,239.73
报告期期间基金总申购份额	1,515,037,000.00
报告期期间基金总赎回份额	1,591,358,805.84
报告期期末基金份额总额	181,315,433.89

### §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  
2023 年 10 月 25 日