

海通现金宝货币型集合资产管理计划 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：上海海通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

送出日期：2024 年 3 月 31 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。本年度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 2024 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本集合计划出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期为 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§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遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.9 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.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	12
§6 审计报告	12
6.1 审计报告基本信息.....	12
6.2 审计报告的基本内容.....	12
§7 年度财务报表	13
7.1 资产负债表.....	13
7.2 利润表.....	15
7.3 净资产变动表.....	16
7.4 报表附注.....	18
§8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 债券回购融资情况.....	40

8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	41
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	41
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
8.6 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	42
8.7 “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	42
8.8 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资产支持证券投资明 细.....	43
8.9 投资组合报告附注.....	43
§9 基金份额持有人信息.....	44
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	44
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
9.4 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	45
§10 开放式基金份额变动.....	45
§11 重大事件揭示.....	45
11.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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	45
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
11.4 基金投资策略的改变.....	46
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	47
11.9 其他重大事件.....	47
§12 影响投资者决策的其他重要信息	47
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	47
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
§13 备查文件目录.....	48
13.1 备查文件目录.....	48
13.2 存放地点.....	48
13.3 查阅方式.....	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海通现金宝货币型集合资产管理计划
基金简称	海通现金宝货币
基金主代码	850011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 5 月 31 日
基金管理人	上海海通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	5,879,680,563.78 份
基金合同存续期	三年

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	本集合计划主要投资策略有：利率策略、骑乘策略、回购策略、个券选择策略。
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型集合计划，其预期风险和预期收益低于债券型基金、债券型集合计划、混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、股票型集合计划。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海海通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	吴文然	周诗晨
	联系电话	021-23154762	010-59378972
	电子邮箱	htam@haitong.com	myu@chinaclear.com.cn
客户服务电话		95553、4008888001	010-59378888
传真		021-63410460	010-59378771
注册地址		上海市广东路 689 号海通证券大厦 32 楼	北京市西城区太平桥大街 17 号
办公地址		上海市广东路 689 号海通证券大厦 32 楼	北京市西城区太平桥大街 17 号
邮政编码		200001	100033
法定代表人		裴长江	周明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.htsamc.com
基金年度报告备置地点	集合计划管理人及集合计划托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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、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	2023 年	2022 年 5 月 31 日 (基金合同生效日) -2022 年 12 月 31 日
本期已实现收益	111,647,818.29	50,407,762.69
本期利润	111,647,818.29	50,407,762.69
本期净值收益率	1.5148%	0.7071%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末
期末基金资产净值	5,879,680,563.78	6,133,343,803.81
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末
累计净值收益率	2.2322%	0.7071%

注：1、本集合计划无持有人认购或交易集合计划的各项费用。

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，由于本集合计划采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本集合计划的利润分配按月结转为对应份额。

3.2 基金净值表现

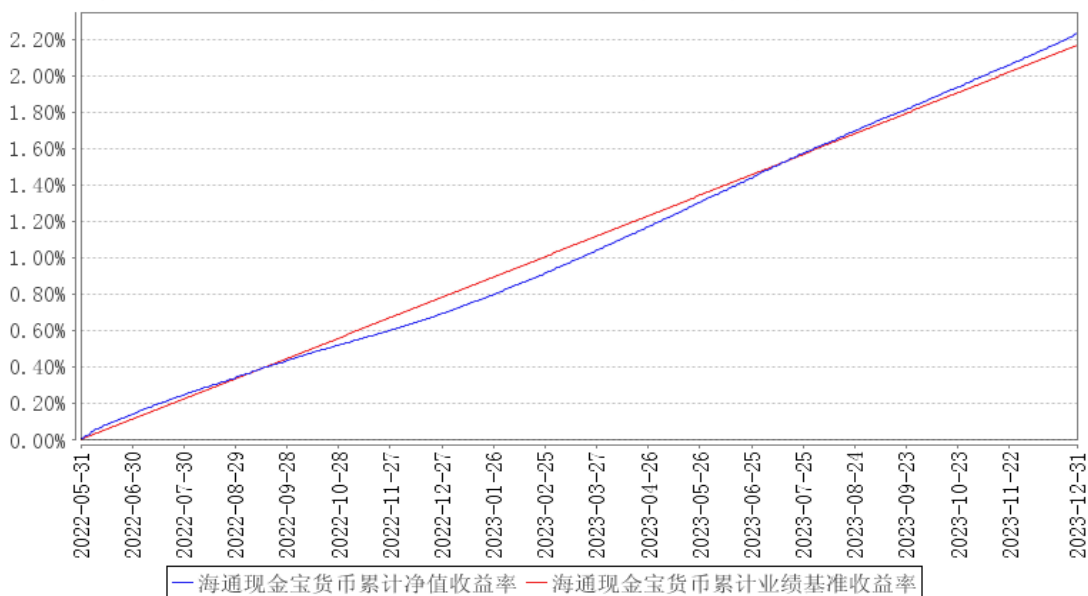
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.3812%	0.0005%	0.3408%	0.0000%	0.0404%	0.0005%

过去六个月	0.7557%	0.0004%	0.6829%	0.0000%	0.0728%	0.0004%
过去一年	1.5148%	0.0005%	1.3591%	0.0000%	0.1557%	0.0005%
自基金合同生效起至今	2.2322%	0.0008%	2.1683%	0.0000%	0.0639%	0.0008%

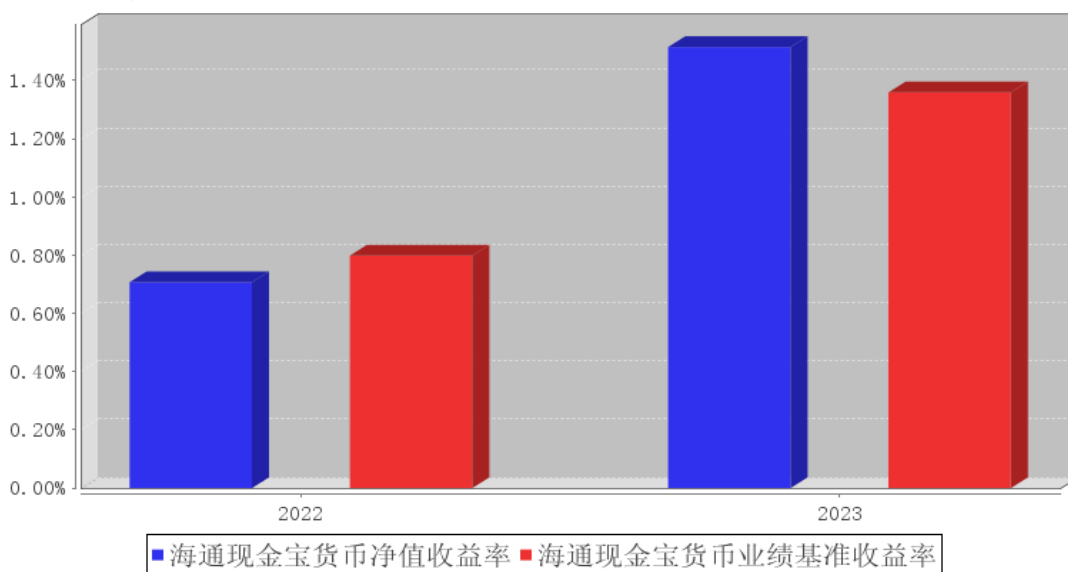
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海通现金宝货币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



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

海通现金宝货币基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2023 年	110,967,532.15	91,301.96	588,984.18	111,647,818.29	-
2022 年	46,690,899.50	42,946.03	3,673,917.16	50,407,762.69	-
合计	157,658,431.65	134,247.99	4,262,901.34	162,055,580.98	-

注：1、本财务报表的上年度实际编制期间为 2022 年 5 月 31 日（集合计划合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日。

2、投资者解约情形下，按照当期收益分配期间收益率与解约日银行活期存款利率孰低的原则计付收益，并于解约日后一工作日直接通过应付赎回款转出。

3、本集合计划每日计算投资人账户当日所产生的收益，每月将投资人账户累计的收益结转为集合计划份额，计入该投资人账户的集合计划份额中。

§ 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

本集合资产管理计划管理人上海海通证券资产管理有限公司前身为海通证券客户资产管理部，2002 年开始从事持牌受托投资管理业务（证监机构字【2001】265 号），2012 年 6 月经核准成为资管子公司，秉承海通证券资产管理牌照和业务，注册资本 10 亿元，注册地上海市。经过多次增资，目前注册资本为 22 亿元人民币整。公司的经营范围为证券资产管理业务，包括：单一业务、集合业务、专项业务、QDII 业务和创新业务，覆盖主动权益、固收、量化、现金管理、另类投资、ABS、QDII 等全业务产品线。

截至 2023 年 12 月 31 日，集合资产管理计划管理人共管理 17 只公募集合资产管理计划。

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		
李夏	投资经理	2022 年 5 月 31 日	-	8 年	李夏，女，西安交通大学金融学和曼彻斯特大学统计学双硕士，8 年证券从业经验，2015 年加入上海海通证券资产管理有限公司，历任固定收益部研究员和投资经理，历任海通现金赢家，年年鑫，增益系列，慧享系列等产品投资经理。
李佳闻	投资经理	2022 年 5 月 31 日	-	7 年	李佳闻，女，香港科技大学经济学硕士。历任上海海通证券资产管理有限公司固定收益部研究员、投资经理助理，现任上海海通证券资产管理有限公司公募固收部投

					资经理。
--	--	--	--	--	------

4.1.3 基金经理薪酬机制

公司以《上海海通证券资产管理有限公司薪酬管理办法》为核心建立薪酬管理体系，根据员工不同的工作内容及工作职责，设立不同序列、不同职级。基金经理薪酬严格按照《上海海通证券资产管理有限公司薪酬管理办法》进行管理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本管理人认真遵循《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》等相关法律法规的具体要求，建立了与公平交易相关的管理制度，通过集中交易和公平的交易分配制度，确保管理的各产品享有公平的交易执行机会，同时定期对同向交易、反向交易等进行监控和分析，通过对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，确保公司在投资管理活动中公平对待各投资组合，避免利益冲突、切实防范利益输送行为。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关规定，通过各项内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有投资组合，切实防范利益输送行为。

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

本集合计划的管理人严格按照《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等有关规定要求加强对兼任私募资产管理计划的投资经理的投资交易行为管理和公平交易监控，确保公平对待所管理的公私募投资组合，防范利益输送行为，避免利益冲突。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本集合计划进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2023 年债券收益率整体下行。年初市场对于经济修复预期较强，债券收益率震荡上行。3 月两会经济增长目标低于预期，市场对于强刺激的担忧缓解，叠加降准与海外银行风险事件，利率震荡下行。4 月以来，地产数据走弱、经济数据回落、刺激政策不及预期、银行存款利率下调，利率继续下行。8 月央行降息，利率快速下行至年内低点。8 月下旬开始，基本面边际好转，资金面阶段性收紧，地产政策陆续出台，利率震荡上行。10 月以来特殊再融资债发行提速，资金面趋紧，利率震荡上行。12 月中央经济工作会议要求坚持高质量发展，银行存款利率下调，机构配置压力仍大，利率震荡下行。资金与存单方面，1-2 月受银行信贷投放、缴税压力等因素扰动，资金利率偏紧，存单上行。3 月后随着降准资金释放、财政投放，资金面有所转松，存单转为下行。5 月以来，受到经济活动放缓引起的货币需求萎缩影响，资金面呈现自发式宽松，存单收益率震荡下行，8 月降息后存单下行至年内低点。10 月以来特殊再融资债发行提速，银行间资金面趋紧，银行负债压力加大，存单收益率震荡上行。12 月下旬存款利率下调、跨年资金面转松，存单收益率迅速下行。本产品在报告期内坚持均衡配置，灵活调整各类资产比例，把握资金紧张时的配置机会，灵活调整组合久期，在收益率高位时拉长久期，保持组合的流动性和稳健性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期集合计划上述份额净值增长率为 1.5148%。业绩比较基准收益率为 1.3591%。

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 2024 年，经济面临内需不足的压力，房地产为经济的主要拖累项。中央经济工作会议更强调高质量发展，政策基调保持定力，预计今年强刺激政策出台的概率不大。在经济修复偏弱的背景下，货币政策仍有放松空间。央行四季度货币政策报告重提资金利率围绕政策利率波动，预计资金面由去年四季度中性偏紧的状态转为中性略偏松的状态。此外，在城投、地产等高息资产供给缩量背景下，市场仍面临比较严峻的“资产荒”格局，供需层面利好债市。在此背景下，债券收益率有望继续震荡下行。目前短端品种（如同业存单）相对于资金利率中枢的利差处于偏低水平，但相较于中长端品种仍具有性价比，后续关注资金利率能否打开存单下行的空间。

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，本管理人从合法合规运作、切实维护投资人合法利益的角度出发，持续推进全面风险管理理念，优化公司内部控制体系，更新完善相关内控制度和业务流程，强化员工合规和风险意识，不断推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。本管理人秉持客观、公正的原则，通过系统监控、合规审核、信息披露、现场检查等一系列方式开展监察稽核工作，加

强了风险控制与合规管理的力度，推动了内控管理体系的落实。

本集合计划管理人将继续本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理集合计划资产，加强风险控制与合规管理，确保集合计划份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本集合计划管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及集合计划合同对估值程序的相关约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、集合计划份额净值的计算由集合计划管理人独立完成，并与集合计划托管人进行账务核对，经集合计划托管人复核无误后，由集合计划管理人对外公布。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

集合计划收益分配原则：每一集合计划份额享有同等分配权。申购的集合计划份额享有确认当日的分红权益，而赎回的集合计划份额不享有确认当日的分红权益。本集合计划以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每月以红利再投资方式集中支付累计收益。

一、本集合计划本报告期内应分配 111,647,818.29 元。二、已实施的利润分配 107,384,916.95 元。三、应分配但尚未实施的利润 4,262,901.34 元，将于资产负债表日后首次分红日按 1.0000 元的份额面值结转为集合计划份额。以上符合相关法规及集合计划合同的规定。

4.9 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

本集合计划本报告期无需要说明的情形。

§ 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，本托管人在对本集合计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的有关规定，不存在损害集合计划份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了集合计划托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本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 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	普华永道中天审字(2024)第 28041 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	海通现金宝货币型集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了海通现金宝货币型集合资产管理计划(以下简称“海通现金宝”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了海通现金宝 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</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。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> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于海通现金宝,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>海通现金宝的集合计划管理人上海海通证券资产管理有限公司(以下简称“集合计划管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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,集合计划管理人管理层负责评估海通现金宝的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非集合计划管理人管理层计划清算</p>

	海通现金宝、终止运营或别无其他现实的选择。 集合计划管理人治理层负责监督海通现金宝的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	<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> <p>(一) 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。</p> <p>(二) 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。</p> <p>(三) 评价集合计划管理人管理层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。</p> <p>(四) 对集合计划管理人管理层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，就可能对海通现金宝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海通现金宝不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与集合计划管理人治理层就计划的审计范围、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>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	许康玮 王振华
会计师事务所的地址	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2024 年 3 月 28 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海通现金宝货币型集合资产管理计划

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	2,917,453,201.79	1,563,964,963.60
结算备付金		13,188,572.53	27,567,316.06
存出保证金		548,603.15	235,013.36
交易性金融资产	7.4.7.2	3,641,520,584.27	4,408,318,095.97
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,641,520,584.27	4,408,318,095.97
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	18,805,077.32	142,561,678.40
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		6,591,516,039.06	6,142,647,067.39
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		452,195,094.33	-
应付清算款		250,084,986.24	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,251,132.98	3,439,486.42
应付托管费		295,557.52	312,680.56
应付销售服务费		1,477,787.71	1,563,402.94
应付投资顾问费		-	-
应交税费		88,128.10	149,837.49

应付利润		4,262,901.34	3,673,917.16
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	179,887.06	163,939.01
负债合计		711,835,475.28	9,303,263.58
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	5,879,680,563.78	6,133,343,803.81
未分配利润	7.4.7.12	-	-
净资产合计		5,879,680,563.78	6,133,343,803.81
负债和净资产总计		6,591,516,039.06	6,142,647,067.39

注：1、报告截止日 2023 年 12 月 31 日，集合计划份额净值 1.0000 元，集合计划份额总额 5,879,680,563.78 份。

7.2 利润表

会计主体：海通现金宝货币型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 31 日（基金 合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		176,847,798.90	86,148,933.62
1. 利息收入		68,836,156.77	40,321,501.63
其中：存款利息收入	7.4.7.13	58,903,820.27	33,157,813.50
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		9,932,336.50	7,163,688.13
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		108,011,642.13	45,827,431.99
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	108,011,642.13	45,827,431.99
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.20	-	-

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		65,199,980.61	35,741,170.93
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	40,857,143.50	23,278,196.60
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,714,285.62	2,116,199.65
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	18,571,428.95	10,037,358.20
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,573,484.47	13,194.52
其中：卖出回购金融资产支出		1,573,484.47	13,194.52
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		203,594.17	103,273.45
8. 其他费用	7.4.7.23	280,043.90	192,948.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		111,647,818.29	50,407,762.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		111,647,818.29	50,407,762.69
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		111,647,818.29	50,407,762.69

注：比较财务报表的实际编制期间为 2022 年 5 月 31 日（集合计划合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日。

7.3 净资产变动表

会计主体：海通现金宝货币型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	6,133,343,803.81	-	6,133,343,803.81
二、本期期初净资产	6,133,343,803.81	-	6,133,343,803.81
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-253,663,240.03	-	-253,663,240.03
（一）、综合收益总额	-	111,647,818.29	111,647,818.29
（二）、本期基金份额交易产生的净资	-253,663,240.03	-	-253,663,240.03

产变动数 (净资产减少以“-” 号填列)			
其中: 1. 基金申购款	162,255,256,993.15	-	162,255,256,993.15
2. 基金赎回款	-162,508,920,233.18	-	-162,508,920,233.18
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-111,647,818.29	-111,647,818.29
四、本期期末净资产	5,879,680,563.78	-	5,879,680,563.78
项目	上年度可比期间 2022年5月31日(基金合同生效日)至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	6,342,810,619.93	-	6,342,810,619.93
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-209,466,816.12	-	-209,466,816.12
(一)、综合收益总额	-	50,407,762.69	50,407,762.69
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-209,466,816.12	-	-209,466,816.12
其中: 1. 基金申购款	76,804,924,527.50	-	76,804,924,527.50
2. 基金赎回款	-77,014,391,343.62	-	-77,014,391,343.62
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-50,407,762.69	-50,407,762.69
四、本期期末净资产	6,133,343,803.81	-	6,133,343,803.81

注: 比较财务报表的实际编制期间为 2022 年 5 月 31 日(集合计划合同生效日)至 2022 年 12 月

31 日。

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>王岗</u>	<u>陈颖</u>	<u>刘雯</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

海通现金宝货币型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）变更自原大集合“海通现金赢家集合资产管理计划”（以下简称“原集合计划”）。原集合计划为现金管理产品，于 2012 年 9 月 27 日经中国证监会证监许可（2012）1301 号核准设立，自 2012 年 10 月 18 日起开始募集并于 2012 年 11 月 28 日结束募集，于 2012 年 11 月 29 日成立。本集合计划于 2022 年 3 月 29 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予海通现金赢家集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2022]575 号）批准，《海通现金宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”）于 2022 年 5 月 31 日起正式变更生效。本集合计划为契约型开放式，自合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本集合计划的管理人为上海海通证券资产管理有限公司，托管人为中国证券登记结算有限责任公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海通现金宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划的投资范围为：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，若无债项信用评级，按主体信用评级；超短期融资券的主体信用评级应当为最高级。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，具体以监管要求为准。

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）。

本财务报表由本集合计划的管理人上海海通证券资产管理有限公司于 2024 年 3 月 28 日批准

报出。

7.4.2 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》、《海通现金宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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 2023 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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。比较财务报表的实际编制期间为 2022 年 5 月 31 日(集合计划合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本集合计划成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本集合计划管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本集合计划现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本集合计划持有的金融资产主要为债务工具,是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工

具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本集合计划管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本集合计划持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本集合计划将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本集合计划持有的以摊余成本计量的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在初始确认时，以公允价值计量。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资的账面价值中。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。

债券投资按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率每日计提应计利息，同时在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致集合计划资产净值发生重大偏离。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。

本集合计划对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本集合计划考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本集合计划对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本集合计划按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减

值的，处于第二阶段，本集合计划按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本集合计划按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本集合计划假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本集合计划对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本集合计划将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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；或者(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

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致集合计划净资产发生重大偏离，从而对集合计划持有人的利益产生稀释或不公平的结果，集合计划管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的集合计划净资产与摊余成本法计算的集合计划净资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，集合计划管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使集合计划净资产更能公允地反映集合计划投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，集

合计划管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场, 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。采用估值技术时, 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金融工具价格的重大事件, 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 1) 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的; 且 2) 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基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

无。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额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集合计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额扣除在适用情况下由本集合计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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、托管费和销售服务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。

以摊余成本计量的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

每一集合计划份额享有同等分配权。申购的集合计划份额享有确认当日的分红权益, 而赎回

的集合计划份额不享有确认当日的分红权益。本集合计划以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每月以红利再投资方式集中支付累计收益。

7.4.4.12 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本集合计划内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本集合计划管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本集合计划能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 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，本集合计划计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于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债金融估值中心有限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

本集合计划本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 本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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	1,914,128,160.08	911,487,158.22
等于：本金	1,912,925,109.95	910,543,980.81
加：应计利息	1,203,050.13	943,177.41
减：坏账准备	-	-
定期存款	1,003,325,041.71	652,477,805.38
等于：本金	1,000,000,000.00	650,000,000.00
加：应计利息	3,325,041.71	2,477,805.38
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	1,003,325,041.71	652,477,805.38
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	2,917,453,201.79	1,563,964,963.60

注：定期存款的存款期限为定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 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	403,012,685.13	403,086,539.73	73,854.60	0.0013
	银行间市场	3,238,507,899.14	3,238,944,613.67	436,714.53	0.0074
	合计	3,641,520,584.27	3,642,031,153.40	510,569.13	0.0087
资产支持证券		-	-	-	-
合计		3,641,520,584.27	3,642,031,153.40	510,569.13	0.0087
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 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	634,713,966.56	634,097,070.14	-616,896.42	-0.0101
	银行间市场	3,773,604,129.41	3,771,522,741.09	-2,081,388.32	-0.0339
	合计	4,408,318,095.97	4,405,619,811.23	-2,698,284.74	-0.0440
资产支持证券		-	-	-	-
合计		4,408,318,095.97	4,405,619,811.23	-2,698,284.74	-0.0440

注：1、偏离金额=影子定价-按实际利率计算的账面价值。

2、偏离度=偏离金额/通过按实际利率计算账面价值确定的集合计划资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本集合计划本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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 2023 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	18,805,077.32	-
合计	18,805,077.32	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	142,561,678.40	-
银行间市场	-	-
合计	142,561,678.40	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本集合计划本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

7.4.7.8 其他资产

注：本集合计划本报告期末及上年度末其他资产均无余额。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022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	-	-
应付交易费用	32,587.06	16,639.01
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	32,587.06	16,639.01
应付利息	-	-
预提费用	147,300.00	147,300.00
合计	179,887.06	163,939.01

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,133,343,803.81	6,133,343,803.81

本期申购	162,255,256,993.15	162,255,256,993.15
本期赎回（以“-”号填列）	-162,508,920,233.18	-162,508,920,233.18
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	5,879,680,563.78	5,879,680,563.78

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

7.4.7.11 其他综合收益

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	111,647,818.29	-	111,647,818.29
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-111,647,818.29	-	-111,647,818.29
本期末	-	-	-

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年5月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	34,281,551.75	29,214,746.62
定期存款利息收入	24,461,014.11	3,850,902.59
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	154,201.93	90,491.99
其他	7,052.48	1,672.30
合计	58,903,820.27	33,157,813.50

注：其他包含结算保证金利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年5月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	105,359,218.62	42,953,880.43
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,652,423.51	2,873,551.56
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	108,011,642.13	45,827,431.99

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年5月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	15,980,738,829.48	8,484,342,060.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,804,599,951.26	8,389,718,962.11

减：应计利息总额	173,486,244.71	91,749,547.23
减：交易费用	210.00	-
买卖债券差价收入	2,652,423.51	2,873,551.56

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

7.4.7.19 股利收益

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

7.4.7.20 公允价值变动收益

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

7.4.7.21 其他收入

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

7.4.7.22 信用减值损失

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年5月31日（基金合同生效日）
----	-----------------------------	--------------------------------

	月 31 日	至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	18,000.00	10,602.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	104,843.90	34,446.51
账户维护费	37,200.00	27,900.00
合计	280,043.90	192,948.51

7.4.7.24 分部报告

本集合计划本报告期无分部报告。

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，本集合计划并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本集合计划并无须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
上海海通证券资产管理有限公司（“海通资管”）	基金管理人、基金销售机构
中国证券登记结算有限责任公司	基金托管人
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

本集合计划合同生效日为 2022 年 5 月 31 日，上年度同期对比数据为 2022 年 5 月 31 日至 2022 年 12 月 31 日。

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

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	40,857,143.50	23,278,196.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	40,857,143.50	23,278,196.60

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.55% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.55\% \div \text{当年天数}$$

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

当以 0.55% 的年管理费率计算的七日年化暂估收益率小于或等于 2 倍活期存款利率，管理人将调整年管理费率为 0.30%，以降低每万份集合计划暂估净收益为负并引发销售机构交收透支的风险，直至该类风险消除，管理人方可恢复按 0.55% 年费率计提管理费。管理人应在费率调整后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,714,285.62	2,116,199.65

注：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。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

海通现金宝货币	
海通资管	18,571,428.95
合计	18,571,428.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年5月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	海通现金宝货币
海通资管	10,037,358.20
合计	10,037,358.20

注：本集合计划的销售服务费按前一日集合计划资产净值的0.25%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

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

注：本集合计划本报告期与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

注：本集合计划本报告期与上年度可比期间均未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。

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

注：本集合计划本报告期与上年度可比期间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 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年5月31日（基金合 同生效日）至2022年12月 31日
基金合同生效日（2022年5月31日）持有的基金份额	-	30,000,000.00

报告期初持有的基金份额	30,196,912.04	-
报告期内申购/买入总份额	454,339.97	196,912.04
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	30,651,252.01	30,196,912.04
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.52%	0.49%

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

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

注：本报告期末除集合计划管理人之外的其他关联方未投资及持有本集合计划份额。

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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年5月31日（基金合同生效日）至2022年12月31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	360,156,433.56	1,221,488.01	172,461,633.72	6,276,950.74

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本集合计划均无其他关联交易事项的说明。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
110,967,532.15	91,301.96	588,984.18	111,647,818.29	-

7.4.12 期末（2023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

注：本集合计划无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本集合计划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 2023 年 12 月 31 日止，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 452,216,340.89 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
112303122	23 农业银行 CD122	2024 年 1 月 2 日	98.99	1,000,000	98,992,489.86
112303179	23 农业银行 CD179	2024 年 1 月 2 日	98.65	1,000,000	98,653,446.52
112308131	23 中信银行 CD131	2024 年 1 月 2 日	98.99	1,000,000	98,994,920.75
112308237	23 中信银行 CD237	2024 年 1 月 2 日	99.28	624,000	61,948,001.73
112399021	23 杭州银行 CD131	2024 年 1 月 2 日	99.04	140,000	13,865,430.82
210012	21 付息国债 12	2024 年 1 月 2 日	101.17	500,000	50,584,337.99
210207	21 国开 07	2024 年 1 月 2 日	102.04	180,000	18,367,418.50
220013	22 付息国债 13	2024 年 1 月 2 日	101.27	200,000	20,253,395.60
230211	23 国开 11	2024 年 1 月 2 日	100.28	100,000	10,027,739.81
230216	23 国开 16	2024 年 1 月 2 日	100.16	30,000	3,004,915.04
合计				4,774,000	474,692,096.62

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，集合计划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-21,246.56 元。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本集合计划本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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。

本计划管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、经营层及其下设的合规与风险控制委员会、合规与法务部和风控与稽核部、各业务部门和职能部门构成的风险管理架构体系。

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。

本集合计划投资于一家上市公司发行的证券市值不超过集合计划资产净值的 10%，且本集合计划与由本集合计划管理人管理的其他全部公开募集性质的集合计划共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。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。

本集合计划的管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。其中单一机构发行的金融工具占集合计划资产净值的比例合计不得超过 2%。且本集合计划与由本集合计划的集合计划管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净资产的 10%。

由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不在下表进行列示。

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	1,060,231,681.13	1,930,471,275.59
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	1,060,231,681.13	1,930,471,275.59

注：本集合计划本报告期末的债券投资按照剩余期限（考虑回售情况）计算，一年以内列为短期；无债项评级则取主体评级，AAA 列入 A-1 计算。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	2,417,781,565.96	2,186,479,140.11
A-1 以下	-	-

未评级	-	-
合计	2,417,781,565.96	2,186,479,140.11

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

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、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。

本集合计划所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在 7.4.12 中列示的部分集合计划资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过资产净值的 15%。此外，本集合计划可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过集合计划持有的债券资产的公允价值。

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。

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。

本集合计划主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本集合计划的管理人每日通过“影子定价”对本集合计划面临的市场风险进行监控，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
货币资金	2,917,453,201.79	-	-	-	2,917,453,201.79
结算备付金	13,188,572.53	-	-	-	13,188,572.53
存出保证金	548,603.15	-	-	-	548,603.15
交易性金融资产	3,034,957,037.85	606,563,546.42	-	-	3,641,520,584.27
买入返售金融资产	18,805,077.32	-	-	-	18,805,077.32
资产总计	5,984,952,492.64	606,563,546.42	-	-	6,591,516,039.06
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	3,251,132.98	3,251,132.98
应付托管费	-	-	-	295,557.52	295,557.52
应付清算款	-	-	-	-250,084,986.24	250,084,986.24
卖出回购金融资产款	452,195,094.33	-	-	-	452,195,094.33
应付销售服务费	-	-	-	1,477,787.71	1,477,787.71
应付利润	-	-	-	4,262,901.34	4,262,901.34
应交税费	-	-	-	88,128.10	88,128.10
其他负债	-	-	-	179,887.06	179,887.06
负债总计	452,195,094.33	-	-	-259,640,380.95	711,835,475.28
利率敏感度缺口	5,532,757,398.31	606,563,546.42	-	-259,640,380.95	5,879,680,563.78
上年度末	6个月以内	6个月	1-5年	不计息	合计

2022 年 12 月 31 日		-1 年			
资产					
银行存款	1,563,964,963.60				1,563,964,963.60
结算备付金	27,567,316.06				27,567,316.06
存出保证金	235,013.36				235,013.36
交易性金融资产	2,936,052,376.99	1,472,265,718.98			4,408,318,095.97
买入返售金融资产	142,561,678.40				142,561,678.40
资产总计	4,670,381,348.41	1,472,265,718.98			6,142,647,067.39
负债					
应付管理人报酬				3,439,486.42	3,439,486.42
应付托管费				312,680.56	312,680.56
应付销售服务费				1,563,402.94	1,563,402.94
应付利润				3,673,917.16	3,673,917.16
应交税费				149,837.49	149,837.49
其他负债				163,939.01	163,939.01
负债总计				9,303,263.58	9,303,263.58
利率敏感度缺口	4,670,381,348.41	1,472,265,718.98		-9,303,263.58	6,133,343,803.81

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		
	利率曲线平行移动		
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 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-3,479,252.73	-3,694,602.60
市场利率下降 25 个基点	3,486,779.36	3,704,914.92	

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。本集合计划未持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此不存在相应的外汇风险。

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债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，本集合计划各类资产的投资比例范围为：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。本集合计划通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本集合计划的管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	3,641,520,584.27	4,408,318,095.97
第三层次	-	-
合计	3,641,520,584.27	4,408,318,095.97

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划本期及上年度可比期间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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 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(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 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	固定收益投资	3,641,520,584.27	55.25
	其中：债券	3,641,520,584.27	55.25
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	18,805,077.32	0.29
	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	2,930,641,774.32	44.46
4	其他各项资产	548,603.15	0.01
5	合计	6,591,516,039.06	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.91	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的 比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	452,195,094.33	7.69

其中：买断式回购融资	-	-
------------	---	---

注：报告期内债券回购融资余额占集合计划资产净值的比例为报告期内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

注：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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	96
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	68

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投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	34.11	11.94
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	2.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	17.67	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	14.88	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	42.72	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	111.77	11.94

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期末未发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况

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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	132,107,263.83	2.25

2	央行票据	-	-
3	金融债券	205,071,612.97	3.49
	其中：政策性金融债	31,400,073.35	0.53
4	企业债券	168,071,615.27	2.86
5	企业短期融资券	605,706,029.21	10.30
6	中期票据	112,782,497.03	1.92
7	同业存单	2,417,781,565.96	41.12
8	其他	-	-
9	合计	3,641,520,584.27	61.93
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	按实际利率计算的账面价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112308129	23 中信银行 CD129	1,000,000	99,572,118.19	1.69
2	112310294	23 兴业银行 CD294	1,000,000	99,273,038.89	1.69
3	112309107	23 浦发银行 CD107	1,000,000	99,012,956.35	1.68
4	112308131	23 中信银行 CD131	1,000,000	98,994,920.75	1.68
5	112303122	23 农业银行 CD122	1,000,000	98,992,489.86	1.68
6	112303179	23 农业银行 CD179	1,000,000	98,653,446.52	1.68
7	112308237	23 中信银行 CD237	700,000	69,492,950.66	1.18
8	112388420	23 广州银行 CD095	700,000	69,491,413.23	1.18
9	112388584	23 广州银行 CD096	700,000	69,484,642.89	1.18
10	188282	21 华泰 09	600,000	61,374,032.80	1.04

8.7 “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	0.0524%
报告期内偏离度的最低值	-0.0786%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0353%

注：以上数据根据报告期内交易日数据统计。

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未发生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未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

鉴于货币市场基金的特性，本集合计划采用摊余成本法计算集合计划资产净值，即本集合计划按持有债券投资的票面利率或商定利率每日计提应收利息，并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价，以摊余的成本计算集合计划资产净值。为了避免采用摊余成本法计算的集合计划资产净值与按市场利率或交易市价计算的集合计划资产净值发生重大偏离，从而对持有人的利益产生稀释或不公平的结果，集合计划管理人采用“影子定价”，即于每一计价日采用市场利率和交易价格对集合计划持有的计价对象进行重新评估，当集合计划资产净值与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，应按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整，调整差额确认为“公允价值变动损益”，并按其他公允价值指标进行后续计量。如集合计划份额净值恢复至 1.00 元，可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，集合计划管理人可根据具体情况，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

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

本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、证监会、中国人民银行、国家外汇管理局、税务局、工商局的处罚；兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、证监会、国家外汇管理局、交易商协会、安监局的处罚；上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年

内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行、国家外汇管理局、税务局、安监局、住建部的处罚；中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行、国家外汇管理局、税务局、工商局、安监局、环保部、住建部的处罚；广州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行、工商局的处罚；华泰证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到证监会、中国人民银行、国家外汇管理局的处罚。

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产品合同的要求。

8.9.3 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	548,603.15
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	548,603.15

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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

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（%）
70,942	82,880.11	1,023,171,608.41	17.40	4,856,508,955.37	82.60

9.2 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	券商类机构	665,614,608.82	11.32
2	其他机构	45,882,065.43	0.78
3	个人	39,886,791.73	0.68
4	基金类机构	37,702,583.06	0.64

5	券商类机构	30,651,252.01	0.52
6	个人	27,793,149.00	0.47
7	个人	27,702,271.13	0.47
8	个人	20,749,636.25	0.35
9	其他机构	18,121,778.12	0.31
10	个人	17,563,285.63	0.30

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	67,537.58	0.0011

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022年5月31日） 基金份额总额	6,342,810,619.93
本报告期期初基金份额总额	6,133,343,803.81
本报告期基金总申购份额	162,255,256,993.15
减：本报告期基金总赎回份额	162,508,920,233.18
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,879,680,563.78

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无集合计划份额持有人大会决议。

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

1. 2023年8月21日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司第四届第五十六次董事会审议通过，左秀海先生自2023年8月21日担任公司副总经理。

2. 2023年11月3日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司第四届第六十二次董事会审议通过，胡倩女士自2023年11月3日代任公司总经理。

3. 2023年12月26日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司第四届第六十二次董事会审议通过，王岗先生自2023年12月26日担任公司总经理。

4. 本报告期内，集合计划托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

1. 因金融委托理财合同纠纷，四川信托有限公司向四川省成都市中级人民法院起诉，要求上海海通证券资产管理有限公司等多个被告返还或赔偿原告委托财产 51,455 万元及相应利息。2023 年 9 月 27 日法院作出一审判决，判决驳回原告对海通资管的所有诉讼请求。上诉期内原告提起上诉，目前案件正在二审程序中。

2. 本报告期内无涉及本集合计划托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内没有发生投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内集合计划管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本报告期内应支付的审计费用是 18,000.00 元，目前事务所已提供审计服务的连续年限是 2 年。

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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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 (%)	
海通证券	2	-	-	-	-	-

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 (%)

海通证 券	3,334,758,8 79.50	100.00	17,111,494,0 00.00	100.00	-	-
----------	----------------------	--------	-----------------------	--------	---	---

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本报告期内未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况

11.9 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	海通现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定披露媒介	2023 年 12 月 19 日
2	海通现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定披露媒介	2023 年 11 月 17 日
3	海通现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定披露媒介	2023 年 10 月 18 日
4	海通现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定披露媒介	2023 年 9 月 19 日
5	海通现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定披露媒介	2023 年 8 月 17 日
6	上海海通证券资产管理有限公司关于海通现金宝货币型集合资产管理计划调整最低交易限额的公告	规定披露媒介	2023 年 7 月 21 日
7	海通现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定披露媒介	2023 年 7 月 19 日
8	海通现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定披露媒介	2023 年 6 月 16 日
9	海通现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定披露媒介	2023 年 5 月 17 日
10	海通现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定披露媒介	2023 年 4 月 19 日
11	海通现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定披露媒介	2023 年 3 月 17 日
12	海通现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定披露媒介	2023 年 2 月 17 日
13	海通现金宝货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定披露媒介	2023 年 1 月 18 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

注：本集合计划本报告期内无单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，未发现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予海通现金赢家集合资产管理计划变更的文件
- (二) 《海通现金宝货币型集合资产管理计划资产管理合同》
- (三) 《海通现金宝货币型集合资产管理计划托管协议》
- (四) 管理人业务资格批件、营业执照
- (五) 托管人业务资格批件、营业执照
- (六) 关于申请《海通现金赢家集合资产管理计划资产管理合同变更》的法律意见
- (七) 中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人网站(www.htsamc.com)查阅,或在营业时间内至集合计划管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本集合计划管理人:上海海通证券资产管理有限公司

客户服务中心电话:95553

上海海通证券资产管理有限公司

2024年3月31日