

# 国海证券安盈债券型集合资产管理计划 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：国海证券股份有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 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。本中期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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 7 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现</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
<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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
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.....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>52</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	52
7.3 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.....	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
7.6 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.....	54

7.7 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.....	55
7.8 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.....	55
7.9 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.....	55
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.11 投资组合报告附注.....	55
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
8.3 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.....	57
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>57</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>61</b>
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.....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国海证券安盈债券型集合资产管理计划	
基金简称	国海安盈债券	
场内简称	-	
基金主代码	970130	
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	2022 年 4 月 8 日	
基金管理人	国海证券股份有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	126,351,110.54 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	国海安盈债券 A	国海安盈债券 C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	970130	970131
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	38,429,142.32 份	87,921,968.22 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。国海证券安盈债券型集合资产管理计划以下简称“本集合计划”、“本基金”或“国海安盈债券”。

### 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	本集合计划将结合经济发展趋势、国家政策安排、行业变迁逻辑、企业自身管理情况，在货币市场工具、利率债、信用债、国债期货、股票等资产之间进行灵活配置，确定各类资产、投资策略比重，构建风险收益均衡投资组合，依托丰富的投资经验和优秀的风险控制能力在控制组合回撤风险的基础上增厚组合收益，力争获取持续稳定的收益。

业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率*90%+1 年期定期存款利率（税后）*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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈嘉斌
	联系电话	010-88576333
	电子邮箱	chenjb02@ghzq.com.cn
客户服务电话	95563	95566
传真	021-60338151	010-66594942
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 1 号
办公地址	上海市黄浦区中山南路 988 号绿地外滩中心 C1 栋国海证券大厦 9 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200010	100818
法定代表人	何春梅	葛海蛟

## 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ghzq.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国海证券股份有限公司	上海市黄浦区中山南路 988 号绿地外滩中心 C1 栋国海证券大厦 9 层
-	-	-

## § 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	国海安盈债券 A	国海安盈债券 C
本期已实现收益	-1,175,212.83	-3,021,161.60
本期利润	-1,410,196.95	-3,488,454.79

加权平均基金份额本期利润	-0.0314	-0.0316
本期加权平均净值利润率	-2.93%	-2.97%
本期基金份额净值增长率	-2.79%	-2.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	2,082,973.48	4,353,456.21
期末可供分配基金份额利润	0.0542	0.0495
期末基金资产净值	40,552,019.67	92,369,728.11
期末基金份额净值	1.0552	1.0506
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	4.53%	4.07%

注：1、本基金合同生效日为 2022 年 4 月 8 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

国海安盈债券 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
过去一个月	-1.62%	0.31%	0.79%	0.03%	-2.41%	0.28%
过去三个月	-1.70%	0.28%	1.60%	0.06%	-3.30%	0.22%

过去六个月	-2.79%	0.29%	3.46%	0.06%	-6.25%	0.23%
过去一年	-2.04%	0.25%	5.48%	0.05%	-7.52%	0.20%
自基金合同生效起至今	4.53%	0.22%	10.35%	0.05%	-5.82%	0.17%

国海安盈债券 C

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
过去一个月	-1.63%	0.31%	0.79%	0.03%	-2.42%	0.28%
过去三个月	-1.74%	0.28%	1.60%	0.06%	-3.34%	0.22%
过去六个月	-2.88%	0.29%	3.46%	0.06%	-6.34%	0.23%
过去一年	-2.23%	0.25%	5.48%	0.05%	-7.71%	0.20%
自基金合同生效起至今	4.07%	0.22%	10.35%	0.05%	-6.28%	0.17%

注：本基金为由“国海金贝壳 9 号（债券增强）集合资产管理计划”公募化改造来的产品，于 2022 年 4 月 8 日正式变更生效。

### 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

国海安盈债券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



国海安盈债券C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



### 3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2024年1月1日至2024年6月30日）
-	-
其他指标	报告期末（2024年6月30日）
-	-

## § 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）。截至2024年6月末，公司在全国22个省级区域设有31家分公司、88家营业部，控股国海富兰克林基金管理有限公司、国海良时期货有限公司，全资设立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、资产管理、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。

公司控股股东、实际控制人广西投资集团为广西壮族自治区本级国有资本投资公司，同时位列世界500强和中国企业500强，公司其他重要股东为实力雄厚的国有企业和上市公司。依托多

元化的股权结构，公司建立了完善的法人治理体系和市场化的经营管理机制，将党的领导与公司治理有机融合，打造了市场化的选人用人机制和激励约束机制，使公司经营管理兼具稳健和市场化特点，为公司持续健康发展提供充足动力。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。

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 2024 年 6 月 30 日，旗下四只大集合产品均已完成公募化改造，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”、“国海证券安盈债券型集合资产管理计划”、“国海证券现金宝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		
王力	本基金的基金经理	2022 年 4 月 8 日	-	9 年	现任国海证券股份有限公司证券资产管理分公司固定收益总部公募产品部经理、国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划、国海证券现金宝货币型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。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。
张文浩	本基金的基金经理	2022 年 4 月 21 日	-	8 年	现任国海证券股份有限公司证券资产管理分公司固定收益总部公募产品部投资经理，金融学硕士。2015 年至 2021 年在长信基金管理有限责任公司，先后担任行业研究员与投资经理。2021 年 5 月加入国海证券资产管理分公司，历任资深研究员、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
-	公募基金	-	-	-
	私募资产管理计划	-	-	-

	其他组合	-	-	-
	合计	-	-	-

注：本基金基金经理王力兼任两只根据《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》变更而来的参公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。

## 4.2 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。

## 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，对公平交易的过程和结果进行监督。

### 4.3.2 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

回顾上半年度，国内经济持续复苏，债券市场表现亮眼，权益市场表现欠佳。海外选举与地缘风险事件频发，美联储降息预期逐渐升温，市场风险偏好回升。权益市场上半年行情以超跌反弹为主，各大宽基指数回落至前期低位且创下新低。可转债市场前 5 月表现相对较好，但后续随权益市场开启调整，波动加大。国内货币政策维持宽松，利率债收益率震荡走低，十年期国债最低下探至 2.20% 附近，下行幅度不小。信用债市场延续了去年底以来的反弹趋势，行情开始向短久期品种扩散。

本季度，国海安盈债券主要配置短久期高等级信用债，深入挖掘各类可转债标的，并在可转债持仓上做了进一步的配置。

本基金将继续以中短久期高等级信用债为主要配置，大力发掘利率波动与可转债投资机会，精选个券，努力控制组合波动与回撤风险，力争为持有人提供良好体验。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日,本基金 A 类份额净值为 1.0552 元,本报告期基金 A 类份额净值增长率为-2.79%,同期业绩比较基准收益率为 3.46%;本基金 C 类份额净值为 1.0506 元,本报告期基金 C 类份额净值增长率为-2.88%,同期业绩比较基准收益率为 3.46%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济持续复苏势头仍然有望延续,但复苏斜率仍然需要继续观察,特别是要跟踪地产行业的复苏力度,以及海外下半年旺季出口的韧性。债券市场方面预计利率维持低位运行,信用债市场中短端可能较为拥挤,可适当拉长久期;可转债市场前期调整充分,有更多投资机会待我们发掘。

#### 4.6 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,以及合同对估值程序的相关约定,对所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、份额净值的计算由管理人独立完成,并与托管人进行账务核对,经托管人复核无误后,由管理人对外公布。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未进行利润分配。

#### 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,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在国海证券安盈债券型集合资产管理计划(以下称“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,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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

的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：国海证券安盈债券型集合资产管理计划

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	7,663,711.28	7,114,731.10
结算备付金		780,869.65	912,981.46
存出保证金		11,438.77	21,821.35
交易性金融资产	6.4.7.2	116,160,481.94	178,651,815.89
其中：股票投资		5,110,768.44	7,548,435.48
基金投资		-	-
债券投资		111,049,713.50	171,103,380.41
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	8,000,080.00	15,012,544.59
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		2,020.82	5,002,567.12
应收股利		-	-
应收申购款		499,422.90	5,653,538.99
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		133,118,025.36	212,370,000.50
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		5,250.74	952,631.75
应付管理人报酬		44,111.86	62,810.63
应付托管费		11,027.96	15,702.67
应付销售服务费		15,389.94	21,455.13
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6,248.83	13,305.24
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	114,248.25	132,984.43
负债合计		196,277.58	1,198,889.85
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	126,351,110.54	195,021,425.22
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	6,570,637.24	16,149,685.43
净资产合计		132,921,747.78	211,171,110.65
负债和净资产总计		133,118,025.36	212,370,000.50

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 126,351,110.54 份，其中国海安盈债券 A 基金份额总额 38,429,142.32 份，基金份额净值 1.0552 元。国海安盈债券 C 基金份额总额 87,921,968.22 份，基金份额净值 1.0506 元。

## 6.2 利润表

会计主体：国海证券安盈债券型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024年 6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		-4,266,876.98	5,673,652.21
1. 利息收入		93,459.01	66,093.39
其中：存款利息收入	6.4.7.13	18,145.35	14,139.02
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		75,313.66	51,954.37
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,831,190.06	2,860,149.97
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,146,891.43	-288,624.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-2,713,586.83	3,090,197.74
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	29,288.20	58,576.40
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）	6.4.7.20	-702,277.31	2,467,493.77
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	173,131.38	279,915.08
<b>减：二、营业总支出</b>		631,774.76	418,991.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	329,795.82	210,884.65
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	82,449.02	52,721.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	117,031.52	64,121.73
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		812.61	855.00
其中：卖出回购金融资产支出		812.61	855.00
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		6,126.83	11,869.96
8. 其他费用	6.4.7.23	95,558.96	78,538.90
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-4,898,651.74	5,254,660.86
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-4,898,651.74	5,254,660.86
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-4,898,651.74	5,254,660.86

### 6.3 净资产变动表

会计主体：国海证券安盈债券型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 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	195,021,425.22	-	16,149,685.43	211,171,110.65
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	195,021,425.22	-	16,149,685.43	211,171,110.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-68,670,314.68	-	-9,579,048.19	-78,249,362.87
（一）、综合收益总额	-	-	-4,898,651.74	-4,898,651.74
（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）	-68,670,314.68	-	-4,680,396.45	-73,350,711.13
其中：1. 基金申购款	28,392,846.55	-	1,936,472.92	30,329,319.47
2. 基金赎回款	-97,063,161.23	-	-6,616,869.37	-103,680,030.60
（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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	126,351,110.54	-	6,570,637.24	132,921,747.78
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 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	62,341,058.45	-	248,336.67	62,589,395.12
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	62,341,058.45	-	248,336.67	62,589,395.12
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	74,054,825.16	-	10,051,700.23	84,106,525.39
(一)、综合收益总额	-	-	5,254,660.86	5,254,660.86
(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)	74,054,825.16	-	4,797,039.37	78,851,864.53
其中：1. 基金申购款	184,007,097.73	-	11,502,237.61	195,509,335.34
2. 基金赎回款	-109,952,272.57	-	-6,705,198.24	-116,657,470.81
(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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	136,395,883.61	-	10,300,036.90	146,695,920.51

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：

何春梅

谭志华

韦海乐

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

国海证券安盈债券型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)由原国海金贝壳 9 号(债券增强)集合资产管理计划变更而来。国海金贝壳 9 号(债券增强)集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划,自 2013 年 5 月 2 日开始募集并于 2013 年 5 月 28 日结束募集,于 2013 年 5 月 31 日成立,2013 年 7 月 8 日获得中国证券业协会备案函《关于国海证券股份有限公司发起设立国海金贝壳 9 号(债券增强)集合资产管理计划的备案确认函》(中证协函[2013]682 号)。

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,《国海证券安盈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 9 号(债券增强)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,存续期自本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股票(含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、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:本集合计划债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%,其中投资于可转换债券(含分离交易可转债)及可交换债券的比例合计不超过集合计划资产的 20%;股票资产的比例不高于集合计划资产的 5%;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资产净值的 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%+1 年期定期存款利率(税后)\*10%

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年半年度的经营成果和净值变动情况。

### 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

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	7,663,711.28
等于：本金	7,662,775.69
加：应计利息	935.59
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	7,663,711.28

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	6,206,752.22	-	5,110,768.44	-1,095,983.78	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	98,874,867.55	1,897,153.70	100,910,151.86	138,130.61
	银行间市场	10,093,890.00	47,561.64	10,139,561.64	-1,890.00
	-	-	-	-	-
	合计	108,968,757.55	1,944,715.34	111,049,713.50	136,240.61
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	115,175,509.77	1,944,715.34	116,160,481.94	-959,743.17	

## 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
-	-	-	-	-
合计				-
减：可抵销期货暂收款				-
净额				-

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	市值	公允价值变动
-	-	-	-	-
合计				-
减：可抵销期货暂收款				-
净额				-

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 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 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	8,000,080.00	-
银行间市场	-	-
-	-	-
合计	8,000,080.00	-

#### 6.4.7.4.2 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 2024年6月30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					-	-	-

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。
----

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

项目		本期末 2024年6月30日				
		初始成本	利息调整	应计利息	减：减值准备	账面价值
债券	交易所市场	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
	小计	-	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-	-
其他		-	-	-	-	-
合计		-	-	-	-	-

注：本基金本报告期期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来12个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
期初余额	-	-	-	-
本期从其他阶段转入	-	-	-	-
本期转出至其他阶段	-	-	-	-
本期新增	-	-	-	-
本期转回	-	-	-	-
其他变动	-	-	-	-
期末余额	-	-	-	-

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日					
	初始成本	利息调整	应计利息	公允价	账面价值	累计减

					值变动		值准备
债券	交易所市场	-	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-	-
	小计	-	-	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-	-	-
其他		-	-	-	-	-	-
合计		-	-	-	-	-	-

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
期初余额	-	-	-	-
本期从其他阶段转入	-	-	-	-
本期转出至其他阶段	-	-	-	-
本期新增	-	-	-	-
本期转回	-	-	-	-
其他变动	-	-	-	-
期末余额	-	-	-	-

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
-	-	-	-
合计	-	-	-

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日					
	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因	本期确认的股利收入	累计利得	累计损失	其他综合收益转入留存收益的金额	其他综合收益转入留存收益的原因
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

## 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	-
-	-
合计	-

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6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	24,631.43
其中：交易所市场	12,918.74
银行间市场	11,712.69

-	-
应付利息	-
预提费用	89,616.82
合计	114,248.25

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 国海安盈债券 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	55,394,672.41	55,394,672.41
本期申购	3,303,026.14	3,303,026.14
本期赎回（以“-”号填列）	-20,268,556.23	-20,268,556.23
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	38,429,142.32	38,429,142.32

## 国海安盈债券 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	139,626,752.81	139,626,752.81
本期申购	25,089,820.41	25,089,820.41
本期赎回（以“-”号填列）	-76,794,605.00	-76,794,605.00
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	87,921,968.22	87,921,968.22

## 6.4.7.11 其他综合收益

单位：人民币元

项目	期初余额	本期发生金额				期末余额
		本期所得 税前发生 额	减：前期计 入其他综 合收益当 期转入损 益	减：前期计 入其他综 合收益当 期转入留 存收益	减：所得税 费用	
一、不能重分 类进损益的 其他综合收 益	-	-	-	-	-	-

其中：其他权益工具投资公允价值变动	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
二、将重分类进损益的其他综合收益	-	-	-	-	-	-
其中：其他债权投资公允价值变动	-	-	-	-	-	-
其他债权投资信用减值准备	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 国海安盈债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,266,777.19	467,311.93	4,734,089.12
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,266,777.19	467,311.93	4,734,089.12
本期利润	-1,175,212.83	-234,984.12	-1,410,196.95
本期基金份额交易产生的变动数	-1,008,590.88	-192,423.94	-1,201,014.82
其中：基金申购款	207,662.65	28,188.68	235,851.33
基金赎回款	-1,216,253.53	-220,612.62	-1,436,866.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,082,973.48	39,903.87	2,122,877.35

## 国海安盈债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,238,192.32	1,177,403.99	11,415,596.31
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	10,238,192.32	1,177,403.99	11,415,596.31
本期利润	-3,021,161.60	-467,293.19	-3,488,454.79
本期基金份额交易产生的变动数	-2,863,574.51	-615,807.12	-3,479,381.63
其中：基金申购款	1,475,513.22	225,108.37	1,700,621.59

基金赎回款	-4,339,087.73	-840,915.49	-5,180,003.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,353,456.21	94,303.68	4,447,759.89

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		10,926.71
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		7,077.63
其他		141.01
合计		18,145.35

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-1,146,891.43
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		-1,146,891.43

注：股票投资收益中扣除了增值税的影响。

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		4,627,410.54
减：卖出股票成本总额		5,769,628.05
减：交易费用		4,673.92
买卖股票差价收入		-1,146,891.43

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。

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30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	-
减：交易费用	-
证券出借差价收入	-

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,901,268.39
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4,614,855.22
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	-2,713,586.83

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。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	174,050,199.88
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	173,888,120.28
减：应计利息总额	4,746,452.08
减：交易费用	30,482.74
买卖债券差价收入	-4,614,855.22

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。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30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：赎回债券应计利息总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30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：申购债券应计利息总额	-
减：交易费用	-
-	-
申购差价收入	-

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券 差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	-

注：本基金报告期内无资产支持证券投资收益。

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	-
减：卖出资产支持证券成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回资产支持证券成本总额	-
减：赎回资产支持证券应计利息总额	-

减：交易费用	-
赎回差价收入	-

#### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购资产支持证券成本总额	-
减：申购资产支持证券应计利息总额	-
减：交易费用	-
-	-
申购差价收入	-

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30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	-

注：本基金报告期内无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.2 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出贵金属成交总额	-
减：卖出贵金属成本总额	-
减：交易费用	-
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	-

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30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	-

减：交易费用	-
赎回差价收入	-

#### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30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	-
减：交易费用	-
-	-
申购差价收入	-

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出权证成交总额	-
减：卖出权证成本总额	-
减：交易费用	-
减：买卖权证差价收入应缴 纳增值税额	-
买卖权证差价收入	-

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
-	-

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	29,288.20
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	29,288.20

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-702,277.31
股票投资	-1,194,959.14
债券投资	492,681.83
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	-
-	-
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	-702,277.31

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	173,131.38
-	-
合计	173,131.38

#### 6.4.7.22 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
银行存款	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其他债权投资	-
其他	-
-	-
合计	-

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	9,944.48
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-

银行费用	7,342.14
账户维护费	18,600.00
合计	95,558.96

#### 6.4.7.24 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。

#### 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，本资产管理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。

#### 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

本报告期不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。

##### 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
国海证券股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司	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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

##### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
国海证券	4,627,410.54	100.00	4,860,596.72	100.00

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
国海证券	161,969,642.65	100.00	174,838,380.74	100.00

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6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 (%)
国海证券	848,000,000.00	100.00	605,461,000.00	100.00

#### 6.4.10.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例 (%)
国海证券	38,296.69	100.00	12,918.74	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例 (%)
国海证券	39,625.46	100.00	33,901.65	100.00

#### 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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	329,795.82	210,884.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	144,612.23	-
应支付基金管理人的净管理费	185,183.59	210,884.65

注：本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的 0.4% 年费率计提，计算方法如下：

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

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	82,449.02	52,721.11

注：本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的 0.1% 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。

#### 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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国海安盈债券 A	国海安盈债券 C	合计
国海证券	-	65,502.96	65,502.96

国海资管	-	893.38	893.38
合计	-	66,396.34	66,396.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国海安盈债券 A	国海安盈债券 C	合计
国海证券	-	62,170.70	62,170.70
国海资管	-	1,038.16	1,038.16
合计	-	63,208.86	63,208.86

注：本集合计划 A 类计划份额不收取销售服务费，C 类计划份额的销售服务费年费率为 0.2%。销售服务费主要用于本集合计划持续销售以及集合计划份额持有人服务等各项费用。销售服务费按前一日 C 类计划份额资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的 C 类计划份额销售服务费

E 为前一日的 C 类计划份额的资产净值

R 为销售服务年费率

销售服务费每日计提，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销售服务费划付指令，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划出。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
-	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期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 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

## 6.4.10.4.1 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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
-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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。

## 6.4.10.4.2 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	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。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	国海安盈债券 A	国海安盈债券 C
基金合同生效日 ( 2022 年 4	-	-

月 8 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	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	国海安盈债券 A	国海安盈债券 C
基金合同生效日 ( 2022 年 4 月 8 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	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

6.4.10.5.2 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

国海安盈债券 A

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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 (%)
-	-	-	-	-

份额单位: 份

国海安盈债券 C

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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 (%)
-	-	-	-	-

注: 报告期末除基金管理人之外无其他关联方投资本基金。

## 6.4.10.6 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	7,663,711.28	10,926.71	18,715,863.76	10,091.55

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行约定利率计息。

## 6.4.10.7 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 2024年1月1日至2024年6月30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：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30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：股/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。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

## 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

国海安盈债券 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	-	-	-	-	-	-	-	-
国海安盈债券 C								
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。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.3 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	受限期	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.4 受限证券类别：权证										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内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

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
-	-	-	-	-	-
合计				-	-

注：本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

### 6.4.12.4 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	-	-	-	-	-	-

### 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

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。

#### 6.4.13.2 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。

## 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	19,776,219.53
合计	-	19,776,219.53

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。

## 6.4.13.2.2 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有短期信用评级的资产支持证券。

## 6.4.13.2.3 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有短期信用评级的同业存单。

## 6.4.13.2.4 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	76,002,828.81	106,234,426.49
AAA 以下	25,821,988.52	43,043,982.61
-	-	-

未评级	9,224,896.17	2,048,751.78
合计	111,049,713.50	151,327,160.88

#### 6.4.13.2.5 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有长期信用评级的同业存单。

#### 6.4.13.3 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。

##### 6.4.13.3.1 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 2024年6月30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	-	-	-	-
上年度末 2023 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	-	-	-	-

#### 6.4.13.3.2 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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 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，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。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,663,711.28	-	-	-	7,663,711.28
结算备付金	780,869.65	-	-	-	780,869.65
存出保证金	11,438.77	-	-	-	11,438.77
交易性金融资产	91,246,167.68	19,803,545.82	-	5,110,768.44	116,160,481.94
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	8,000,080.00	-	-	-	8,000,080.00
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	499,422.90	499,422.90
应收清算款	-	-	-	2,020.82	2,020.82
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	107,702,267.38	19,803,545.82	-	5,612,212.16	133,118,025.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,250.74	5,250.74
应付管理人报酬	-	-	-	44,111.86	44,111.86
应付托管费	-	-	-	11,027.96	11,027.96
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	15,389.94	15,389.94
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	6,248.83	6,248.83
其他负债	-	-	-	114,248.25	114,248.25
负债总计	-	-	-	196,277.58	196,277.58
利率敏感度缺口	107,702,267.38	19,803,545.82	-	5,415,934.58	132,921,747.78
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,114,731.10	-	-	-	7,114,731.10
结算备付金	912,981.46	-	-	-	912,981.46
存出保证金	21,821.35	-	-	-	21,821.35
交易性金融资产	143,621,732.25	27,481,648.16	-	7,548,435.48	178,651,815.89
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	15,012,544.59	-	-	-	15,012,544.59
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,653,538.99	5,653,538.99
应收清算款	-	-	-	5,002,567.12	5,002,567.12

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	166,683,810.75	27,481,648.16	-	18,204,541.59	212,370,000.50
负债					
应付赎回款	-	-	-	952,631.75	952,631.75
应付管理人报酬	-	-	-	62,810.63	62,810.63
应付托管费	-	-	-	15,702.67	15,702.67
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	21,455.13	21,455.13
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	13,305.24	13,305.24
其他负债	-	-	-	132,984.43	132,984.43
负债总计	-	-	-	1,198,889.85	1,198,889.85
利率敏感度缺口	166,683,810.75	27,481,648.16	-	17,005,651.74	211,171,110.65

#### 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率下降25个基点	377,479.04	639,486.32
	市场利率上升25个基点	-377,248.95	-638,889.92

#### 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，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			合计
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	
以外币计价的资产				

货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的 负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报 酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务 费	-	-	-	-
应付投资顾问 费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	-	-	-
	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
项目	美元 折合人民 币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的 资产				
货币资金	-	-	-	-

结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	-		
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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	-	-	-

### 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	5,110,768.44	3.84	7,548,435.48	3.57
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	5,110,768.44	3.84	7,548,435.48	3.57

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
分析	相关风险变量的变 动	本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月 31日）
		-	-

注：截止 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 3.84%。因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.4 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 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	-	-	-
	合计	-	-

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

本集合计划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。

##### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	31,131,602.24	35,030,083.64
第二层次	85,028,879.70	143,621,732.25
第三层次	-	-
合计	116,160,481.94	178,651,815.89

注：在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，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，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，相关资产或负债的不可观察输入值。

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

每个资产负债表日，本集合计划对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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，本集合计划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，在各次之间无重大转换。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

无。

#### 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基金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	权益投资	5,110,768.44	3.84
	其中：股票	5,110,768.44	3.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	111,049,713.50	83.42
	其中：债券	111,049,713.50	83.42
	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	8,000,080.00	6.01
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,444,580.93	6.34
-	-	-	-
8	其他各项资产	512,882.49	0.39
9	合计	133,118,025.36	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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	1,841,108.64	1.39
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	3,269,659.80	2.46
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	5,110,768.44	3.84

### 7.2.2 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（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
可选消费	-	-
主要消费	-	-
医药卫生	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
通信服务	-	-
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。

### 7.3 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（%）
1	688590	新致软件	253,462	3,269,659.80	2.46
2	002615	哈尔斯	292,882	1,815,868.40	1.37
3	601127	赛力斯	277	25,240.24	0.02

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	688590	新致软件	4,526,920.15	2.14

##### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	603596	伯特利	3,616,786.40	1.71
2	603528	多伦科技	1,010,624.14	0.48

##### 7.4.3 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	4,526,920.15
卖出股票收入（成交）总额	4,627,410.54

#### 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	74,889,318.06	56.34
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	26,020,833.80	19.58
8	同业存单	-	-
-	-	-	-
9	其他	10,139,561.64	7.63
10	合计	111,049,713.50	83.55

#### 7.6 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	143167	17 光控 02	109,000	11,209,395.75	8.43
2	2028013	20 农业银行二级 01	100,000	10,139,561.64	7.63
3	188924	21 南网 04	80,000	8,206,226.85	6.17
4	110055	伊力转债	47,380	6,217,287.98	4.68
5	112962	19 深建 01	60,000	6,143,296.44	4.62

### 7.7 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。

### 7.8 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。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

#### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1 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。

#### 7.11.2 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。

## 7.11.3 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	11,438.77
2	应收清算款	2,020.82
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	499,422.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	512,882.49

## 7.11.4 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	110055	伊力转债	6,217,287.98	4.68
2	127045	牧原转债	5,075,027.16	3.82
3	118021	新致转债	4,049,218.94	3.05
4	127069	小熊转债	3,133,626.98	2.36
5	113623	凤 21 转债	2,477,104.11	1.86
6	128128	齐翔转 2	1,972,136.33	1.48
7	113619	世运转债	1,493,571.16	1.12
8	113634	珀莱转债	1,404,015.86	1.06
9	110085	通 22 转债	198,845.28	0.15

## 7.11.5 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。

## 7.11.6 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。

## § 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

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 (%)
国海安盈 债券 A	551	69,744.36	1,108,804.39	2.89	37,320,337.93	97.11
国海安盈 债券 C	1,294	67,945.88	21,648,777.95	24.62	66,273,190.27	75.38
合计	1,845	68,482.99	22,757,582.34	18.01	103,593,528.20	81.99

### 8.2 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	国海安盈债券 A	747,120.56	1.94
	国海安盈债券 C	1,754,972.51	2.00
	合计	2,502,093.07	1.98

### 8.3 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	国海安盈债券 A	-
	国海安盈债券 C	-
	合计	-
本基金基金 经理持有本 开放式基金	国海安盈债券 A	-
	国海安盈债券 C	-
	合计	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国海安盈债券 A	国海安盈债券 C
基金合同生效日 (2022 年 4 月 8 日)	57,578,688.38	-
基金份额总额		
本报告期期初基金 份额总额	55,394,672.41	139,626,752.81
本报告期基金总申 购份额	3,303,026.14	25,089,820.41
减:本报告期基金总 赎回份额	20,268,556.23	76,794,605.00
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	38,429,142.32	87,921,968.22

## § 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，本基金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

基金管理人本报告期基金管理人重大人事变动如下：

2024 年 2 月 1 日，公司召开第十届董事会第一次会议，聘任度万中先生为公司总裁，度万中先生自 2024 年 2 月 1 日起正式履行总裁职责；聘任汪成接先生为公司副总裁，汪成接先生自 2024 年 2 月 1 日起正式履行副总裁职责；聘任张宁先生为公司首席信息官，张宁先生自 2024 年 2 月 1 日起正式履行首席信息官职责；因任期届满，蒋健先生自 2024 年 2 月 1 日起不再担任公司副总裁，温力先生自 2024 年 2 月 1 日起不再担任公司首席信息官。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

### 10.4 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。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-
采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-
受到稽查或处罚等措施的原因	-
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-
采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-
受到稽查或处罚等措施的原因	-
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-

注：本报告期内，管理人及其高级管理人员未因资产管理业务受到稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-
采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-
受到稽查或处罚等措施的原因	-
托管人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-
采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-
受到稽查或处罚等措施的原因	-

托管人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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 (%)	
国海证券	2	4,627,410.54	100.00	38,296.69	100.00	-
-	-	-	-	-	-	-

### 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	
	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	161,969,642.65	100.00	848,000,000.00	100.00	-	-
-	-	-	-	-	-	-

## 10.8 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	2024年1月3日
2	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 2023 年第四季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2024年1月22日
3	国海证券安盈债券型集合资产管理计划 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定网站	2024年1月22日
4	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	2024年2月6日
5	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 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2024年3月29日
6	国海证券安盈债券型集合资产管理计划 2023 年年度报告	中国证监会规定网站	2024年3月29日

7	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 2024 年第一季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2024 年 4 月 22 日
8	国海证券安盈债券型集合资产管理计划 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定网站	2024 年 4 月 22 日
9	国海证券安盈债券型集合资产管理计划 (A 类份额) 基金产品资料概要更新 (2024 年 5 月)	中国证监会规定网站	2024 年 5 月 31 日
10	国海证券安盈债券型集合资产管理计划 (C 类份额) 基金产品资料概要更新 (2024 年 5 月)	中国证监会规定网站	2024 年 5 月 31 日
11	国海证券安盈债券型集合资产管理计划招募说明书更新 (2024 年 5 月)	中国证监会规定网站	2024 年 5 月 31 日

## § 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

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							
-							

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金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

无。
----

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《国海证券安盈债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《国海证券安盈债券型集合资产管理计划招募说明书》；
- 3、《国海证券安盈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。

## 12.2 存放地点

上海市黄浦区中山南路 988 号绿地外滩中心 C1 栋国海证券大厦 9 层。

广西南宁市滨湖路 46 号国海大厦。

## 12.3 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](http://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

2024 年 8 月 30 日