

# 海通现金宝货币型集合资产管理计划 2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 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

报告送出日期：2024 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 2024 年 10 月 23 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计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期为 2024 年 7 月 1 日起至 2024 年 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 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  |
| 报告期末基金份额总额 | 10,230,417,868.06 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。 |
| 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   |

## § 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（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日） |
|------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 29,240,223.70                       |

|             |                   |
|-------------|-------------------|
| 2. 本期利润     | 29,240,223.70     |
| 3. 期末基金资产净值 | 10,230,417,868.06 |

注：（1）所述集合计划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。

（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。

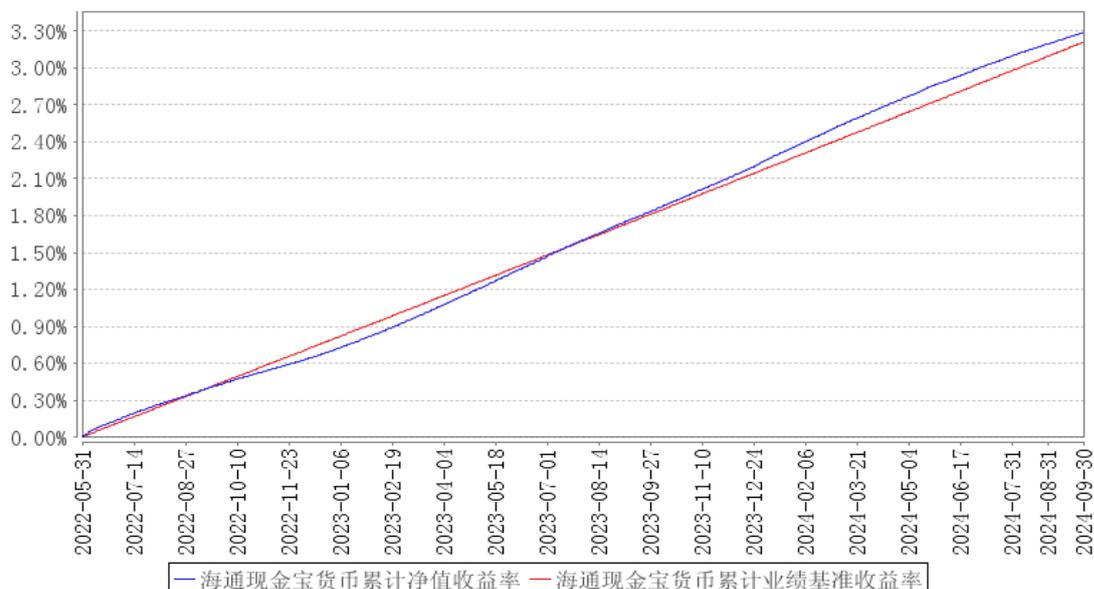
## 3.2 基金净值表现

### 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      | 0.2922% | 0.0003%   | 0.3408%    | 0.0000%       | -0.0486% | 0.0003% |
| 过去六个月      | 0.6392% | 0.0006%   | 0.6791%    | 0.0000%       | -0.0399% | 0.0006% |
| 过去一年       | 1.4175% | 0.0007%   | 1.3629%    | 0.0000%       | 0.0546%  | 0.0007% |
| 自基金合同生效起至今 | 3.2876% | 0.0008%   | 3.2090%    | 0.0000%       | 0.0786%  | 0.0008% |

### 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

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



## §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 |        |   |
| 李佳闻 | 投资经理 | 2022年5月31日  | -    | 8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。                              |
| 李夏  | 投资经理 | 2022年5月31日  | -    | 9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，9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。 |

### 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 公平交易专项说明

#### 4.3.1 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 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024年三季度，债市波动加剧。利率债收益率下行，期限利差走扩。信用债收益率上行，信用利差走扩。7月初，央行监管政策趋严，收益率小幅上行。7月中下旬，降息落地，叠加机构配置压力较大，10年国债下行至2.12%。8月初，受大行卖债及债券监管趋严影响，10年国债收益率上行至2.24%。8月中旬后，基本面再度走弱，债券收益率重回下行，10年国债利率下行至2.03%，创年内低点。9月底，一揽子政策出台，市场风险偏好提升，机构赎回压力显现，10年国债上行

至 2.22%。流动性方面，7 月资金面整体宽松，8-9 月政府债券供给放量后，资金面维持中性偏紧。回顾三季度操作，本产品积极把握配置时点以及交易性机会。

展望后市，货币政策大概率宽松不改，短端经历过调整以后配置价值提升，长期关注宽信用效果。本产品将根据基本面和政策面灵活调整久期，把握资金面收紧带来的配置机会，根据存款/存单/短债收益率灵活调整各类资产比例，平衡产品流动性和收益率。

#### 4.5 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 0.2922%。业绩比较基准收益率为 0.3408%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本集合计划本报告期无需要说明的情形。

## §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                | 4,621,591,988.39  | 45.13        |
|    | 其中：债券                 | 4,621,591,988.39  | 45.13        |
|    | 资产支持证券                | -                 | -            |
| 2  | 买入返售金融资产              | 805,801,066.53    | 7.87         |
|    | 其中：买断式回购的<br>买入返售金融资产 | -                 | -            |
| 3  | 银行存款和结算备<br>付金合计      | 4,813,543,855.85  | 47.00        |
| 4  | 其他资产                  | 183,417.00        | 0.00         |
| 5  | 合计                    | 10,241,120,327.77 | 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 | 0.47          |                   |
|    | 其中：买断式回购融资   | -             |                   |
| 序号 | 项目           | 金额（元）         | 占基金资产净值的<br>比例（%） |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | -             | -                 |
|    | 其中：买断式回购融资   | -             | -                 |

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每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：本报告期内，未发生债券正回购的资金余额超过集合计划资产净值的 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    | 97  |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 104 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 65  |

#### 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。

#### 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                 | 39.43               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 8.63                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 5.13                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天（含）—120 天          | 1.85                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）      | 44.81               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
|    | 合计                     | 99.86               | -                   |

#### 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，未发生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      | 8,181,299.66     | 0.08          |
|    | 其中：政策性金融债 | 3,057,840.48     | 0.03          |
| 4  | 企业债券      | -                | -             |
| 5  | 企业短期融资券   | 948,379,456.85   | 9.27          |
| 6  | 中期票据      | 61,308,901.49    | 0.60          |
| 7  | 同业存单      | 3,603,722,330.39 | 35.23         |
| 8  | 其他        | -                | -             |

|    |                      |                  |       |
|----|----------------------|------------------|-------|
| 9  | 合计                   | 4,621,591,988.39 | 45.18 |
| 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  | 112484653 | 24 上海农商银行 CD052   | 2,000,000 | 198,485,743.92 | 1.94         |
| 2  | 112499414 | 24 杭州银行 CD097     | 1,500,000 | 148,880,637.10 | 1.46         |
| 3  | 112497373 | 24 成都银行 CD089     | 1,000,000 | 99,412,361.15  | 0.97         |
| 4  | 112483873 | 24 广州农村商业银行 CD090 | 1,000,000 | 99,356,606.74  | 0.97         |
| 5  | 112484048 | 24 杭州银行 CD168     | 1,000,000 | 99,348,113.80  | 0.97         |
| 6  | 112498914 | 24 南京银行 CD129     | 1,000,000 | 99,288,614.17  | 0.97         |
| 7  | 112403121 | 24 农业银行 CD121     | 1,000,000 | 99,281,801.54  | 0.97         |
| 8  | 112403117 | 24 农业银行 CD117     | 1,000,000 | 99,257,143.29  | 0.97         |
| 9  | 112413077 | 24 浙商银行 CD077     | 1,000,000 | 99,257,048.84  | 0.97         |
| 10 | 112414037 | 24 江苏银行 CD037     | 1,000,000 | 99,256,744.94  | 0.97         |

### 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 | 0        |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.0165%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0126% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0082%  |

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。

### 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

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，按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

### 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

本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，杭州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到外汇管理局、金融监管总局的处罚；成都银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到金融监管总局的处罚；广州农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到金融监管总局的处罚；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央行、外汇管理局、税务局、金融监管总局、工商局、安监局的处罚；南京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到金融监管总局的处罚。

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。

### 5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 183,417.00 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收利息    | -          |
| 4  | 应收申购款   | -          |
| 5  | 其他应收款   | -          |
| 6  | 其他      | -          |
| 7  | 合计      | 183,417.00 |

### 5.9.4 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

|              |                   |
|--------------|-------------------|
| 报告期期初基金份额总额  | 9,174,140,276.53  |
| 报告期期间基金总申购份额 | 52,275,722,453.57 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 51,219,444,862.04 |
| 报告期期末基金份额总额  | 10,230,417,868.06 |

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 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式  | 交易日期 | 交易份额(份)   | 交易金额(元)   | 适用费率(%) |
|----|-------|------|-----------|-----------|---------|
| 1  | 红利再投资 | -    | 94,766.00 | 94,766.00 | -       |
| 合计 |       |      | 94,766.00 | 94,766.00 |         |

注：红利再投资区间为 2024 年 7 月 1 日至 9 月 30 日，未包含管理人提供快取功能产生的份额。

## §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：本集合计划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。

### 8.2 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。

## §9 备查文件目录

### 9.1 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

### 9.2 存放地点

集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所。

### 9.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人网站([www.htsamc.com](http://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 10 月 25 日