

国海证券安盈债券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：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 3 月 29 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。本年度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 3 月 21 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。

本报告中财务资料已经审计。上会会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 01 月 01 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	9
2.1 基金基本情况	9
2.2 基金产品说明	9
2.3 基金管理人和基金托管人	10
2.4 信息披露方式	10
2.5 其他相关资料	10
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	10
3.1 主要会计数据和财务指标	10
3.2 基金净值表现	11
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	11
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	12
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	13
3.3 其他指标	14
3.4 过去三年基金的利润分配情况	14
§ 4 管理人报告	15
4.1 基金管理人及基金经理情况	15
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验	15
4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介	15
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	16
4.1.4 基金经理薪酬机制	16
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	17
4.3.1 公平交易制度和控制方法	17
4.3.2 公平交易制度的执行情况	17
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	17
4.3.3 异常交易行为的专项说明	17
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	17
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析	17
4.4.2 报告期内基金的业绩表现	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	18
4.10 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	18
§ 5 托管人报告	18

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	18
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.....	19
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.....	19
§ 6 审计报告.....	19
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
§ 7 年度财务报表.....	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	23
7.3 净资产变动表.....	24
7.4 报表附注.....	26
7.4.1 基金基本情况.....	26
7.4.2 会计报表的编制基础.....	27
7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明.....	27
7.4.4 重要会计政策和会计估计.....	27
7.4.4.1 会计年度.....	27
7.4.4.2 记账本位币.....	27
7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类.....	27
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.....	28
7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则.....	31
7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销.....	32
7.4.4.7 实收基金.....	32
7.4.4.8 损益平准金.....	32
7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量.....	32
7.4.4.10 费用的确认和计量.....	33
7.4.4.11 基金的收益分配政策.....	33
7.4.4.12 外币交易.....	34
7.4.4.13 分部报告.....	34
7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计.....	34
7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明.....	34
7.4.5.1 会计政策变更的说明.....	34
7.4.5.2 会计估计变更的说明.....	34
7.4.5.3 差错更正的说明.....	34
7.4.6 税项.....	34
7.4.7 重要财务报表项目的说明.....	35
7.4.7.1 货币资金.....	35
7.4.7.2 交易性金融资产.....	36
7.4.7.3 衍生金融资产/负债.....	37
7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额.....	37
7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况.....	37
7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况.....	38
7.4.7.4 买入返售金融资产.....	38
7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额.....	38

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券.....	38
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.....	39
7.4.7.5 债权投资.....	39
7.4.7.5.1 债权投资情况.....	39
7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况.....	39
7.4.7.6 其他债权投资.....	40
7.4.7.6.1 其他债权投资情况.....	40
7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况.....	41
7.4.7.7 其他权益工具投资.....	41
7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况.....	41
7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况.....	42
7.4.7.8 其他资产.....	42
7.4.7.9 其他负债.....	42
7.4.7.10 实收基金.....	43
7.4.7.11 其他综合收益.....	43
7.4.7.12 未分配利润.....	44
7.4.7.13 存款利息收入.....	45
7.4.7.14 股票投资收益.....	45
7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成.....	45
7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入.....	45
7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入.....	46
7.4.7.15 债券投资收益.....	46
7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成.....	46
7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入.....	46
7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入.....	47
7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入.....	47
7.4.7.16 资产支持证券投资收益.....	47
7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成.....	47
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.....	48
7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入.....	48
7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入.....	48
7.4.7.17 贵金属投资收益.....	49
7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成.....	49
7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入.....	49
7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入.....	49
7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入.....	50
7.4.7.18 衍生工具收益.....	50
7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入.....	50
7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益.....	50
7.4.7.19 股利收益.....	51
7.4.7.20 公允价值变动收益.....	51
7.4.7.21 其他收入.....	51
7.4.7.22 信用减值损失.....	52
7.4.7.23 其他费用.....	52
7.4.7.24 分部报告.....	52

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明.....	52
7.4.8.1 或有事项.....	52
7.4.8.2 资产负债表日后事项.....	52
7.4.9 关联方关系.....	52
7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易.....	53
7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易.....	53
7.4.10.1.1 股票交易.....	53
7.4.10.1.2 债券交易.....	53
7.4.10.1.3 债券回购交易.....	54
7.4.10.1.4 权证交易.....	54
7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金.....	54
7.4.10.2 关联方报酬.....	54
7.4.10.2.1 基金管理费.....	54
7.4.10.2.2 基金托管费.....	55
7.4.10.2.3 销售服务费.....	55
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.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	57
7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况.....	57
7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况.....	57
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.....	58
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.....	58
7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况.....	59
7.4.10.8 其他关联交易事项的说明.....	59
7.4.11 利润分配情况.....	59
7.4.12 期末(2023年12月31日)本基金持有的流通受限证券.....	60
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.....	60
7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票.....	60
7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券.....	61
7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购.....	61
7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购.....	61
7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券.....	61
7.4.13 金融工具风险及管理.....	61
7.4.13.1 风险管理政策和组织架构.....	61
7.4.13.2 信用风险.....	61
7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资.....	62
7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资.....	62
7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资.....	62
7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资.....	62
7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资.....	63
7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资.....	63
7.4.13.3 流动性风险.....	63
7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析.....	63
7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析.....	64

7.4.13.4 市场风险.....	64
7.4.13.4.1 利率风险.....	64
7.4.13.4.1.1 利率风险敞口.....	65
7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析.....	66
7.4.13.4.2 外汇风险.....	66
7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口.....	66
7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析.....	68
7.4.13.4.3 其他价格风险.....	69
7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口.....	69
7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析.....	69
7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险.....	69
7.4.14 公允价值.....	70
7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法.....	70
7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具.....	70
7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值.....	70
7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动.....	70
7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况.....	71
7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况.....	71
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.....	72
7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明.....	72
7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明.....	72
7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项.....	72
§8 投资组合报告.....	72
8.1 期末基金资产组合情况.....	72
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	73
8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合.....	73
8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合.....	74
8.3 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.....	74
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	74
8.4.1 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.....	74
8.4.2 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.....	74
8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额.....	74
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	74
8.6 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.....	75
8.7 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.....	75
8.8 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.....	75
8.9 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.....	75
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	76
8.10.1 本期国债期货投资政策.....	76
8.10.2 本期国债期货投资评价.....	76
8.11 投资组合报告附注.....	76
8.11.1 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.....	76
8.11.2 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.....	76

8.11.3 期末其他各项资产构成.....	76
8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细.....	76
8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明.....	77
8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分.....	77
§ 9 基金份额持有人信息.....	77
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	77
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
9.3 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.....	78
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	78
§ 10 开放式基金份额变动.....	78
§ 11 重大事件揭示.....	79
11.1 基金份额持有人大会决议.....	79
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.....	79
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	79
11.4 基金投资策略的改变.....	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	79
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.....	79
11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	79
11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	80
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	80
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.....	80
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.....	81
11.8 其他重大事件.....	81
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
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.....	83
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
§ 13 备查文件目录.....	83
13.1 备查文件目录.....	83
13.2 存放地点.....	83
13.3 查阅方式.....	83

§ 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	195,021,425.22 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	55,394,672.41 份	139,626,752.81 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	许俊
	联系电话	010-88576333	010-66596688
	电子邮箱	chenjb02@ghzq.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ghzq.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市静安区威海路 755 号 25 层
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、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 4 月 8 日（基金合同生效日）-2022 年 12 月 31 日	
	国海安盈债券 A	国海安盈债券 C	国海安盈债券 A	国海安盈债券 C
本期已实现收益	2,365,593.59	3,350,303.19	435,009.89	407,457.09

本期利润	2,886,088.04	3,553,587.80	-94,931.98	-44,125.96
加权平均基金份额本期利润	0.0612	0.0409	-0.0018	-0.0009
本期加权平均净值利润率	5.72%	3.83%	-0.18%	-0.09%
本期基金份额净值增长率	8.04%	7.83%	-0.48%	-0.62%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	4,266,777.19	10,238,192.32	148,678.94	99,657.73
期末可供分配基金份额利润	0.0770	0.0733	0.0047	0.0032
期末基金资产净值	60,128,761.53	151,042,349.12	31,804,577.24	30,784,817.88
期末基金份额净值	1.0855	1.0818	1.0047	1.0032
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	7.53%	7.16%	-0.48%	-0.62%

注：1、本基金合同生效日为 2022 年 04 月 08 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
过去三个月	1.25%	0.22%	1.30%	0.04%	-0.05%	0.18%
过去六个月	0.77%	0.20%	1.95%	0.04%	-1.18%	0.16%
过去一年	8.04%	0.24%	4.45%	0.04%	3.59%	0.20%

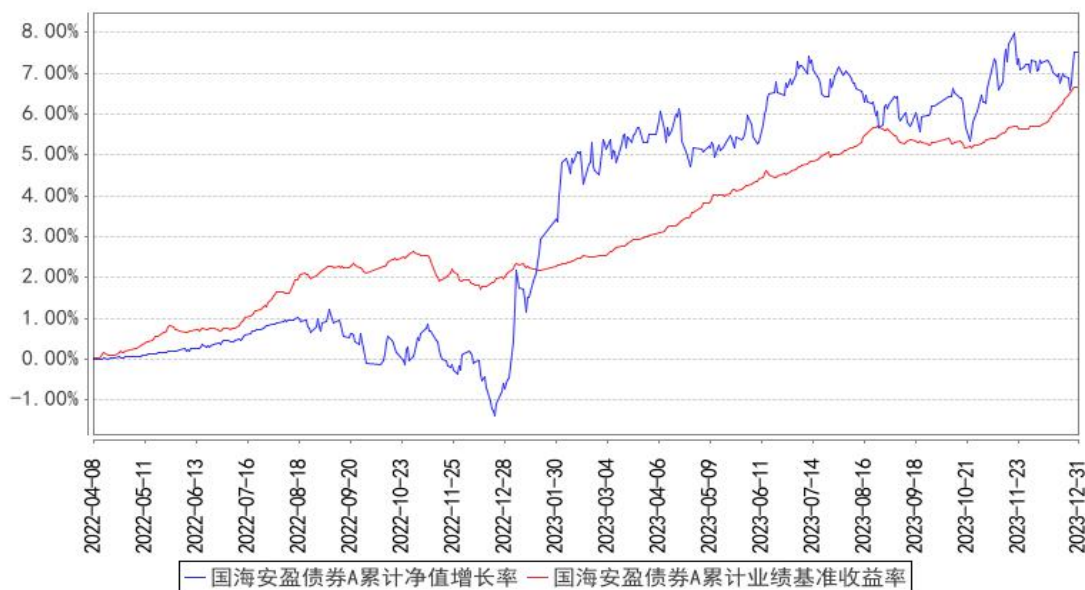
自基金合同生效起至今	7.53%	0.20%	6.67%	0.04%	0.86%	0.16%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

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
过去三个月	1.20%	0.22%	1.30%	0.04%	-0.10%	0.18%
过去六个月	0.67%	0.20%	1.95%	0.04%	-1.28%	0.16%
过去一年	7.83%	0.24%	4.45%	0.04%	3.38%	0.20%
自基金合同生效起至今	7.16%	0.20%	6.67%	0.04%	0.49%	0.16%

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

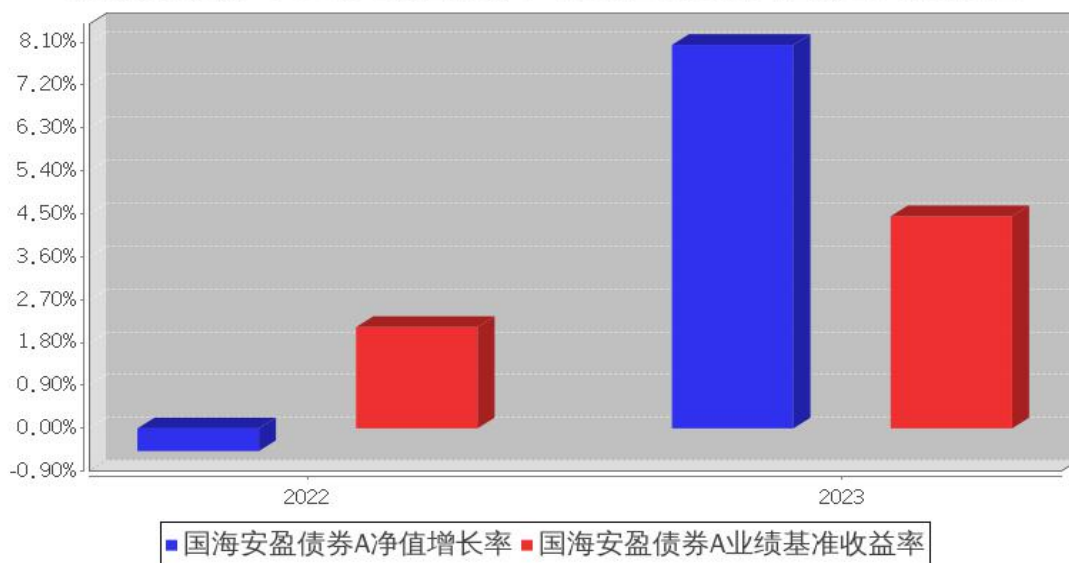


国海安盈债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

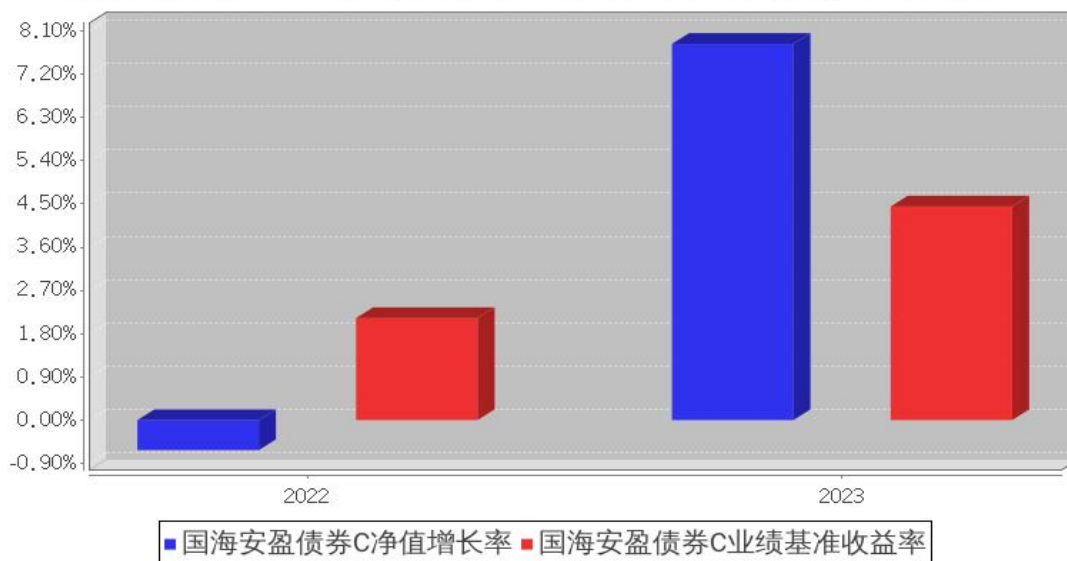


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国海安盈债券A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



国海安盈债券C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2023年1月1日至2023年12月31日）
-	-
其他指标	报告期末（2023年12月31日）
-	-

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

国海安盈债券 A

年度	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	年度利润分配合计	备注
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

国海安盈债券 C

年度	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	年度利润分配合计	备注
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本集合计划自基金合同生效以来未实施利润分配。

§ 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 2023 年 12 月 31 日，公司在全国 21 个省市区设有 30 家分公司、90 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 2023 年 12 月 31 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	-	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，8 年证券从业经验。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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理，薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

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，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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国海证券股份有限公司资产管理业务公平交易制度》的规定。

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

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.3.3 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 2023 年度，国内经济企稳，但复苏斜率未超市场预期，债券市场表现亮眼。权益市场前 5 个月强势反弹后持续下行，各大宽基指数持续创下新低。可转债市场受债市拉动影响，在 8 月份创下年内高点，但随后与权益市场走势类似，创下 2019 年以来新低。国内货币政策维持宽松，利率债收益率全年持续下行，仅在 9 月份有一轮上行，十年期国债最低下探至 2.35% 附近，下行幅度较大。信用债市场延续了 2022 年以来的收益率下行趋势，行情从长久期品种大幅下行后开始向短久期品种扩散。

报告期内，本基金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 2023 年 12 月 31 日，本基金 A 类份额净值为 1.0855 元，本报告期基金 A 类份额净值增

长率为 8.04%，同期业绩比较基准收益率为 4.45%；本基金 C 类份额净值为 1.0818 元，本报告期基金 C 类份额净值增长率为 7.83%，同期业绩比较基准收益率为 4.45%。

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，国内经济持续复苏势头仍然有望延续，复苏斜率有望向上抬升，但仍然需要继续观察，特别是要跟踪地产行业与制造业的复苏力度，以及海外出口的韧性。债券市场方面预计利率维持区间震荡，信用债市场可能整体较为拥挤，我们将关注中短期品种；可转债市场可能整体比较乐观，且不断有新增公司，更多投资机会待我们发掘。

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，管理人内部监察稽核主要开展了如下措施：

依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章对产品的投资、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时反馈，督促改进并跟踪改进效果，进一步完善公司内部控制管理机制。

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。

4.8 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。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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 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	上会师报字(2024)第 1712 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	国海证券安盈债券型集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	我们审计了国海证券安盈债券型集合资产管理计划(以下简称“国海安盈债券型集合计划”)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、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附国海安盈债券型集合计划的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《国海证券安盈债券型集合资产管理计划资产管理合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券业投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了国海安盈债券型集合计划 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于国海安盈债券型集合计划,并履行

	了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	无
其他事项	我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系国海安盈债券型集合计划管理人（以下简称“管理人”）根据《国海证券安盈债券型集合资产管理计划资产管理合同》的规定为其集合计划份额持有人编制的，因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人提供国海安盈债券型集合计划份额持有人和向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用，不得用于其他目的。
其他信息	<p>管理人对其他信息负责。其他信息包括国海安盈债券型集合计划 2023 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《国海证券安盈债券型集合资产管理计划资产管理合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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，管理人负责评估国海安盈债券型集合计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
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>1、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</p>

	<p>错误导致的重大错报的风险。</p> <p>2、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>3、评价管理人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>4、对管理人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，就可能导致对国海安盈债券型集合计划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国海安盈债券型集合计划不能持续经营。</p> <p>5、评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与管理人就国海安盈债券型集合计划的审计范围、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	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈大愚	江嘉炜
会计师事务所的地址	上海市静安区威海路 755 号 25 层	
审计报告日期	2024 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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：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	7,114,731.10	3,612,810.63
结算备付金		912,981.46	346,323.19
存出保证金		21,821.35	1,580.96
交易性金融资产	7.4.7.2	178,651,815.89	58,814,725.72
其中：股票投资		7,548,435.48	2,906,949.64
基金投资		-	-
债券投资		171,103,380.41	55,907,776.08
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	15,012,544.59	-
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		5,002,567.12	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,653,538.99	100.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		212,370,000.50	62,775,540.50
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		952,631.75	100,350.00
应付管理人报酬		62,810.63	23,015.84
应付托管费		15,702.67	5,753.97
应付销售服务费		21,455.13	5,510.94
应付投资顾问费		-	-
应交税费		13,305.24	4,659.47
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	132,984.43	46,855.16
负债合计		1,198,889.85	186,145.38
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	195,021,425.22	62,341,058.45
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	16,149,685.43	248,336.67
净资产合计		211,171,110.65	62,589,395.12
负债和净资产总计		212,370,000.50	62,775,540.50

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，集合计划份额总额 195,021,425.22 份，其中 A 类集合计划份额净值 1.0855 元，A 类集合计划份额总额 55,394,672.41 份；C 类集合计划份额净值 1.0818 元，C 类集合计划份额总额 139,626,752.81 份。

7.2 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：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 4 月 8 日（基金合 同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		7,516,886.11	379,662.88
1. 利息收入		227,531.76	174,323.99
其中：存款利息收入	7.4.7.13	41,514.32	32,566.28
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		186,017.44	141,757.71
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		5,947,458.09	892,246.74
其中：股票投资收益	7.4.7.14	1,813,292.25	-4,675.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	4,075,589.44	896,922.18
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	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）	7.4.7.20	723,779.06	-981,524.92
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	618,117.20	294,617.07
减：二、营业总支出		1,077,210.27	518,720.82
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	570,476.56	300,679.54
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	142,619.16	75,169.92
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	184,748.38	72,302.05
4. 投资顾问费		-	-

5. 利息支出		855.00	3,021.54
其中：卖出回购金融资产支出		855.00	3,021.54
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		20,427.30	5,102.95
8. 其他费用	7.4.7.23	158,083.87	62,444.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,439,675.84	-139,057.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,439,675.84	-139,057.94
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,439,675.84	-139,057.94

7.3 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：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	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）	132,680,366.77	-	15,901,348.76	148,581,715.53
（一）、综合收益总额	-	-	6,439,675.84	6,439,675.84
（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）	132,680,366.77	-	9,461,672.92	142,142,039.69
其中：1. 基金申购款	385,664,567.38	-	26,826,490.91	412,491,058.29
2. 基金赎回款	-252,984,200.61	-	-17,364,817.99	-270,349,018.60
（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	195,021,425.22	-	16,149,685.43	211,171,110.65
项目	上年度可比期间 2022年4月8日(基金合同生效日)至2022年12月31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	57,578,688.38	-	546,609.14	58,125,297.52
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	57,578,688.38	-	546,609.14	58,125,297.52
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,762,370.07	-	-298,272.47	4,464,097.60
(一)、综合收益总额	-	-	-139,057.94	-139,057.94
(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)	4,762,370.07	-	-159,214.53	4,603,155.54
其中: 1. 基金申购款	154,388,424.97	-	1,710,241.24	156,098,666.21
2. 基金赎回款	-149,626,054.90	-	-1,869,455.77	-151,495,510.67
(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	62,341,058.45	-	248,336.67	62,589,395.12

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:

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

7.4 报表附注

7.4.1 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%

本财务报表由本基金的管理人国海证券于 2024 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 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 2 号《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。

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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划报告期所采用的其他会计政策、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。

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。本会计期间为自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币，除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

本集合计划根据所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，将金融资产划分为以下三类：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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(2) 金融负债的分类

本集合计划根据所发行金融工具的合同条款及其所反映的经济实质而非仅以法律形式，结合金融负债和权益工具的定义，在初始确认时将该金融工具或其组成部分分类为金融负债或权益工具。金融负债在初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、其他金融负债、被指定为有效套期工具的衍生工具。金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，相关的交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

(1) 金融资产的初始确认与后续计量

① 分类为以摊余成本计量的金融资产

金融资产的合同条款规定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，且管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本集合计划将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。

本集合计划对此类金融资产采用实际利率法确认利息收入，按摊余成本进行后续计量，其发生减值时或终止确认、修改产生的利得或损失，计入当期损益。除下列情况外，本集合计划根据金融资产账面余额乘以实际利率计算确定利息收入：

1) 对于购入或源生的已发生信用减值的金融资产，本集合计划自初始确认起，按照该金融资产的摊余成本和经信用调整的实际利率计算确定其利息收入。

2) 对于购入或源生的未发生信用减值但在后续期间成为已发生信用减值的金融资产，本集合计划在后续期间，按照该金融资产的摊余成本和实际利率计算确定其利息收入。若该金融工具在后续期间因其信用风险有所改善而不再存在信用减值，本集合计划转按实际利率乘以该金融资产账面余额来计算确定利息收入。

② 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

金融资产的合同条款规定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，且管理该金融资产的业务模式既以收取合同现金流量为目标又以出售该金融资产为目标，则本集合计划将该金融资产分类为以公允价值计量其变动计入其他综合收益的金融资产。本集合计划对此类金融资产采用实际利率法确认利息收入。除利息收入、减值损失及汇兑差额确认为当期损益外，其余公允价值变动计入其他综合收益。当该金融资产终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。以公允价值计量且变动计入其他综合收益的应收票据及应收账款列报为应收款项融资，其他此类金融资产列报为其他债权投资，其中：自资产负债表日起一年内到期的其他债权投资列报为一年内到期的非流动资产，原

到期日在一年以内的其他债权投资列报为其他流动资产。

③ 指定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

在初始确认时，本集合计划可以单项金融资产为基础不可撤销地将非交易性权益工具投资指定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。此类金融资产的公允价值变动计入其他综合收益，不需计提减值准备。该金融资产终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。本集合计划持有该权益工具投资期间，在本集合计划收取股利的权利已经确立，与股利相关的经济利益很可能流入本集合计划，且股利的金额能够可靠计量时，确认股利收入并计入当期损益。本集合计划对此类金融资产在其他权益工具投资项目下列报。权益工具投资满足下列条件之一的，属于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：取得该金融资产的目的主要是为了近期出售；初始确认时属于集中管理的可辨认金融资产工具组合的一部分，且有客观证据表明近期实际存在短期获利模式；属于衍生工具（符合财务担保合同定义的以及被指定为有效套期工具的衍生工具除外）。

④ 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

不符合分类为以摊余成本计量或以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件、亦不指定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均分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本集合计划对此类金融资产采用公允价值进行后续计量，将公允价值变动形成的利得或损失以及与此类金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。本集合计划对此类金融资产根据其流动性在交易性金融资产其他非流动金融资产项目列报。

⑤ 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

在初始确认时，本集合计划为了消除或显著减少会计错配，可以单项金融资产为基础不可撤销地将金融资产指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。混合合同包含一项或多项嵌入衍生工具，且其主合同不属于以上金融资产的，本集合计划可以将其整体指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具。但下列情况除外：

1) 嵌入衍生工具不会对混合合同的现金流量产生重大改变。

2) 在初次确定类似的混合合同是否需要分拆时，几乎不需分析就能明确其包含的嵌入衍生工具不应分拆。如嵌入贷款的提前还款权，允许持有人以接近摊余成本的金额提前偿还贷款，该提前还款权不需要分拆。本集合计划对此类金融资产采用公允价值进行后续计量，将公允价值变动形成的利得或损失以及与此类金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。本集合计划对此类金融资产根据其流动性在交易性金融资产、其他非流动金融资产项目列报。

(2) 金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融负债的后续计量取决于其分类：

① 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

此类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

满足下列条件之一的，属于交易性金融负债：承担相关金融负债的目的主要是为了在近期内出售或回购；属于集中管理的可辨认金融工具组合的一部分，且有客观证据表明企业近期采用短期获利方式模式；属于衍生工具，但是，被指定且为有效套期工具的衍生工具、符合财务担保合同的衍生工具除外。交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，所有公允价值变动均计入当期损益。

在初始确认时，为了提供更相关的会计信息，本集合计划将满足下列条件之一的金融负债不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债：

1) 能够消除或显著减少会计错配。

2) 根据正式书面文件载明的企险风险管理或投资策略，以公允价值为基础对金融负债组合或金融资产和金融负债组合进行管理和业绩评价，并在本集合计划内部以此为基础向关键管理人员报告。

本集合计划对此类金融负债采用公允价值进行后续计量除由本集合计划自身信用风险变动引起的公允价值变动计入其他综合收益之外，其他公允价值变动计入当期损益。除非由本集合计划自身信用风险变动引起的公允价值变动计入其他综合收益会造成或扩大损益中的会计错配，本集合计划将所有公允价值变动（包括自身信用风险变动的影响金额）计入当期损益。

② 其他金融负债

除下列各项外，本集合计划将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债，对此类金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销产生的利得或损失计入当期损益：

1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

2) 金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债。

3) 不属于本条前两类情形的财务担保合同，以及不属于本条第 1) 类情形的以低于市场利率贷款的贷款承诺。财务担保合同是指当特定债务人到期不能按照最初或修改后的债务工具条款偿付债务时，要求发行方向蒙受损失的合同持有人赔付特定金额的合同。不属于指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同，在初始确认后按照损失准备金额以及初始确认金额扣除担保期内的累计摊销额后的余额孰高进行计量。

(3) 金融资产和和金融负债的终止确认

① 金融资产满足下列条件之一的,终止确认金融资产,即从其账户和资产负债表内予以转销:

- 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,且该转移满足金融资产终止确认的规定。

② 金融负债终止确认条件

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的,则终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。本集合计划与借出方之间签订协议,以承担新金融负债方式替换原金融负债,且新金融负债与原金融负债的合同条款实质上不同的,或对原金融负债(或其一部分)的合同条款做出实质性修改的,则终止确认原金融负债,同时确认一项新金融负债,账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的负债)之间的差额,计入当期损益。

本集合计划回购金融负债一部分的,按照继续确认部分和终止确认部分在回购日各自的公允价值占整体公允价值的比例,对该金融负债整体的账面价值进行分配。分配给终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的负债)之间的差额,应当计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种,在估值日有报价的,除会计准则规定的例外情况外,应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,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,管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 对不存在活跃市场的投资品种,应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。采用估值技术确定公允价值时,应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证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在 0.25%以上的,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，且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

实收资金为对外发行的集合计划份额总额或对应的金额。每份集合计划份额面值为人民币 1.00 元。由于申购、赎回引起的实收资金的变动分别于集合计划申购确认日、赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收资金增加和转出集合计划的实收资金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回本集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占计划净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回本集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占计划净值比例计算的金额。损益平准金于本集合计划申购确认日或计划赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣

除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务中，本集合计划保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本集合计划资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 本集合计划的管理人报酬和托管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。

(2) 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

(3) 其他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。

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期计划费用。如果影响计划份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 集合计划收益分配后各类集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的各类集合计划份额净值减去每单位该类集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 同一类别每一集合计划份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

无。

7.4.4.13 分部报告

截至本期末，本集合计划仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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，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，卖出股票按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。

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	7,114,731.10	3,612,810.63
等于：本金	7,113,688.60	3,612,418.50
加：应计利息	1,042.50	392.13
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	7,114,731.10	3,612,810.63

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				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	7,449,460.12	-	7,548,435.48	98,975.36	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	142,580,033.22	2,781,947.21	145,274,584.21	-87,396.22
	银行间市场	25,340,045.00	757,796.20	25,828,796.20	-269,045.00
	-	-	-	-	-
	合计	167,920,078.22	3,539,743.41	171,103,380.41	-356,441.22
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	175,369,538.34	3,539,743.41	178,651,815.89	-257,465.86	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	2,758,157.12	-	2,906,949.64	148,792.52	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	25,472,542.01	307,116.03	25,047,270.60	-732,387.44
	银行间市场	30,498,150.00	760,005.48	30,860,505.48	-397,650.00
	-	-	-	-	-
	合计	55,970,692.01	1,067,121.51	55,907,776.08	-1,130,037.44
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	58,728,849.13	1,067,121.51	58,814,725.72	-981,244.92

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		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	-	-	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		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。

7.4.7.3.2 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。

7.4.7.3.3 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。

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	15,012,544.59	-
银行间市场	-	-
-	-	-
合计	15,012,544.59	-
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	-	-
银行间市场	-	-
-	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 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 2023 年 12 月 31 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					-	-	-

项目	上年度末 2022 年 12 月 31 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。

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

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 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		-	-	-	-	-
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 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。

7.4.7.5.2 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	整个存续期预期信	整个存续期预期信	

	用损失	用损失(未发生信用减值)	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	-	-	-	-

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日					
	初始成本	利息调整	应计利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
债券	交易所市场	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
	小计	-	-	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日					
	初始成本	利息调整	应计利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
债券	交易所市场	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-

小计	-	-	-	-	-	-
资产支持证 券	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

7.4.7.6.2 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	-	-	-	-

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
-	-	-	-
合计	-	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动

-	-	-	-
合计	-	-	-

7.4.7.7.2 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 2023 年 12 月 31 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	-	-	-	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 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	-	-	-	-	-	-

7.4.7.8 其他资产

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
应收利息	-	-
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
-	-	-
合计	-	-

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	23,684.43	23,170.23
其中：交易所市场	21,296.74	19,892.54
银行间市场	2,387.69	3,277.69
-	-	-
应付利息	-	-
预提费用	109,300.00	23,684.93
合计	132,984.43	46,855.16

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国海安盈债券 A

项目	本期	
	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	31,655,898.30	31,655,898.30
本期申购	68,688,607.82	68,688,607.82
本期赎回（以“-”号填列）	-44,949,833.71	-44,949,833.71
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	55,394,672.41	55,394,672.41

国海安盈债券 C

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	30,685,160.15	30,685,160.15
本期申购	316,975,959.56	316,975,959.56
本期赎回（以“-”号填列）	-208,034,366.90	-208,034,366.90
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	139,626,752.81	139,626,752.81

7.4.7.11 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	-	-	-	-	-	-

7.4.7.12 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	528,357.79	-379,678.85	148,678.94
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	528,357.79	-379,678.85	148,678.94
本期利润	2,365,593.59	520,494.45	2,886,088.04
本期基金份额交易产生的变动数	1,372,825.81	326,496.33	1,699,322.14
其中：基金申购款	3,976,943.64	855,652.83	4,832,596.47
基金赎回款	-2,604,117.83	-529,156.50	-3,133,274.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,266,777.19	467,311.93	4,734,089.12

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	467,335.03	-367,677.30	99,657.73
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	467,335.03	-367,677.30	99,657.73
本期利润	3,350,303.19	203,284.61	3,553,587.80
本期基金份额交易产生的变动数	6,420,554.10	1,341,796.68	7,762,350.78
其中：基金申购款	18,596,370.65	3,397,523.79	21,993,894.44

基金赎回款	-12,175,816.55	-2,055,727.11	-14,231,543.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,238,192.32	1,177,403.99	11,415,596.31

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4月8日（基金合同生效日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	27,401.31	20,272.85
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	261.90	113.93
结算备付金利息收入	13,851.11	12,179.50
其他	-	-
合计	41,514.32	32,566.28

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

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4月8日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,813,292.25	-4,675.44
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	1,813,292.25	-4,675.44

注：股票投资收益中扣除了增值税的影响。

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	8,935,205.94	71,804.66

减：卖出股票成本总额	7,113,212.71	76,402.80
减：交易费用	8,700.98	77.30
买卖股票差价收入	1,813,292.25	-4,675.44

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。

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年12月31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	-	-

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4月8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	3,378,585.74	1,670,844.17
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	697,003.70	-773,921.99
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	4,075,589.44	896,922.18

注：债券投资收益中扣除了增值税的影响。

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4月8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	261,091,754.45	189,902,187.81
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	253,822,217.03	187,666,477.18
减：应计利息总额	6,498,246.80	2,973,484.85
减：交易费用	74,286.92	36,147.77
买卖债券差价收入	697,003.70	-773,921.99

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。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年4月8日（基金合同生效日）至 2022年12月31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	-	-

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年12月31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	-	-

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

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年12月31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。

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

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4月8日（基金合同生效日）至2022年12月31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	-	-

7.4.7.16.3 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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年12月31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	-	-

7.4.7.16.4 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	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年12月31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	-	-

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

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4月8日（基金合同生效日）至2022年12月31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。

7.4.7.17.2 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 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年12月31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	-	-

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 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	-	-

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 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	-	-

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

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 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 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	-	-

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
-	-	-

7.4.7.19 股利收益

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4月8日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	58,576.40	-
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	58,576.40	-

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	723,779.06	-981,524.92
股票投资	-49,817.16	148,792.52
债券投资	773,596.22	-1,130,317.44
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	723,779.06	-981,524.92

7.4.7.21 其他收入

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4月8日（基金合同生效日）至2022年12月31日
基金赎回费收入	618,117.20	294,617.07
-	-	-
合计	618,117.20	294,617.07

7.4.7.22 信用减值损失

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4月8日（基金合同 生效日）至2022年12月31 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	-	-

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4月8日（基金合同生效日） 至2022年12月31日
审计费用	20,000.00	14,684.93
信息披露费	80,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	20,583.87	12,329.89
账户维护费	37,500.00	35,430.00
合计	158,083.87	62,444.82

7.4.7.24 分部报告

截至本期末，本集合计划无需作披露的分部报告。

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

截至本财务报表批准报出日，本集合计划无需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
国海证券股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
广西投资集团有限公司	基金管理人的股东
广西产投资本运营集团有限公司（原名： 广西融桂物流集团有限公司）	基金管理人的股东
广西梧州中恒集团股份有限公司	基金管理人的股东

广西投资集团金融控股有限公司	基金管理人的股东
广西能源股份有限公司（原名：广西桂东电力股份有限公司）	基金管理人的股东
广西永盛石油化工有限公司	基金管理人的股东
广西金融投资集团有限公司	基金管理人的股东
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人的子公司
国海富兰克林资产管理（上海）有限公司	基金管理人的子公司
国海良时期货有限公司	基金管理人的子公司
国海良时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
国海创新资本投资管理有限公司	基金管理人的子公司
西安国海景恒创业投资有限公司	基金管理人的子公司
深圳市国海贰号投资发展合伙企业（有限合伙）	基金管理人的子公司
深圳市国海叁号投资发展合伙企业（有限合伙）	基金管理人的子公司
国海证券投资有限公司	基金管理人的子公司
中国银行股份有限公司	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

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

金额单位：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4月8日（基金合同生效日） 至2022年12月31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	8,989,865.72	100.00	71,666.72	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：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4月8日（基金合同生效日）至 2022年12月31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	358,840,643.17	100.00	150,972,945.02	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年4月8日（基金合同生效日）至 2022年12月31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	1,882,761,000.00	100.00	1,491,580,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

金额单位：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4月8日（基金合同生效日）至 2022年12月31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 （%）
-	-	-	-	-

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31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 总额的比例（%）
国海证券	90,057.28	100.00	21,296.74	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年12月31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 总额的比例（%）
国海证券	51,316.40	100.00	19,892.54	100.00

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4月8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	570,476.56	300,679.54
其中：应支付销售机构的客户维护费	239,460.58	-

应支付基金管理人的净管理费	331,015.98	300,679.54
---------------	------------	------------

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 4 月 8 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	142,619.16	75,169.92

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。

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		
	国海安盈债券 A	国海安盈债券 C	合计
国海证券	-	171,166.12	171,166.12
合计	-	171,166.12	171,166.12
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 4 月 8 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		

	国海安盈债券 A	国海安盈债券 C	合计
国海证券	-	72,295.51	72,295.51
合计	-	72,295.51	72,295.51

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。

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

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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 2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 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。

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

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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 2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 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。

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

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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 2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 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。

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	
	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 2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 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	-	-

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

份额单位：份

国海安盈债券 A

关联方名称	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
-	-	-	-	-

份额单位：份

国海安盈债券 C

关联方名称	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
-	-	-	-	-

注：报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

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 4 月 8 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
中国银行股份有限公司	7,114,731.10	27,401.31	3,612,810.63	20,272.85

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。

7.4.10.7 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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 2022 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 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。

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.3 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.4 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：本基金本报告期内不存在股票流通受限情况。

7.4.12.2 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。

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

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：本基金期末无银行间市场债券正回购余额。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

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。

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。

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	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	19,776,219.53	4,051,729.32
合计	19,776,219.53	4,051,729.32

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。

7.4.13.2.2 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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。

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	-	-
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。

7.4.13.2.4 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	106,234,426.49	26,078,822.09
AAA 以下	43,043,982.61	25,777,224.67
-	-	-

未评级	2,048,751.78	-
合计	151,327,160.88	51,856,046.76

7.4.13.2.5 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本期末基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本期末基金未持有长期信用评级的同业存单。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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 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	-	-	-	-
上年度末 2022 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	-	-	-	-

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、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。

7.4.13.4 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。

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。

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	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
上年度末 2022 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	3,612,810.63	-	-	-	3,612,810.63
结算备付金	346,323.19	-	-	-	346,323.19
存出保证金	1,580.96	-	-	-	1,580.96
交易性金融资产	24,727,896.71	27,867,174.99	3,312,704.38	2,906,949.64	58,814,725.72
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	100.00	100.00
应收清算款	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	28,688,611.49	27,867,174.99	3,312,704.38	2,907,049.64	62,775,540.50
负债					
应付赎回款	-	-	-	100,350.00	100,350.00
应付管理人报酬	-	-	-	23,015.84	23,015.84
应付托管费	-	-	-	5,753.97	5,753.97
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	5,510.94	5,510.94
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	4,659.47	4,659.47
其他负债	-	-	-	46,855.16	46,855.16
负债总计	-	-	-	186,145.38	186,145.38
利率敏感度缺口	28,688,611.49	27,867,174.99	3,312,704.38	2,720,904.26	62,589,395.12

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		
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）
	市场利率下降25个基点	639,486.32	372,460.78
	市场利率上升25个基点	-638,889.92	-372,035.67

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。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			合计
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	
以外币计价的资产				

银行存款	-	-	-	-
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 2022 年 12 月 31 日			
项目	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	-	-	-	-

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	-	-	-	-

7.4.13.4.2.2 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（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	-	-	-

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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022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	7,548,435.48	3.57	2,906,949.64	4.64
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	7,548,435.48	3.57	2,906,949.64	4.64

7.4.13.4.3.2 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（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月 31日）
		-	-

注：截止 2023 年 12 月 31 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 3.57%。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。

7.4.13.4.4 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 (2023 年 12 月 31 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	-	-	-
	合计	-	-

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

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	35,030,083.64	13,604,404.62
第二层次	143,621,732.25	45,210,321.10
第三层次	-	-
合计	178,651,815.89	58,814,725.72

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。

7.4.14.2.2 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。

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

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	-	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2022年4月8日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	-	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-

当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

无。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

至资产负债表日本基金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	权益投资	7,548,435.48	3.55
	其中：股票	7,548,435.48	3.55

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	171,103,380.41	80.57
	其中：债券	171,103,380.41	80.57
	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	15,012,544.59	7.07
	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	8,027,712.56	3.78
-	-	-	-
8	其他各项资产	10,677,927.46	5.03
9	合计	212,370,000.50	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	7,548,435.48	3.57
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	-	-
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	7,548,435.48	3.57

8.2.2 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（%）
	-	-
合计	-	-

注：本基金本报告期末无港股通投资股票。

8.3 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	603596	伯特利	60,003	4,158,207.90	1.97
2	002615	哈尔斯	292,882	2,146,825.06	1.02
3	603528	多伦科技	134,614	1,222,295.12	0.58
4	601127	赛力斯	277	21,107.40	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	603596	伯特利	5,222,223.49	8.34
2	002368	太极股份	4,045,292.31	6.46
3	603528	多伦科技	1,296,781.58	2.07
4	601127	赛力斯	1,240,218.33	1.98

8.4.2 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	601127	赛力斯	3,400,823.00	5.43
2	002368	太极股份	3,307,496.72	5.28
3	002615	哈尔斯	1,553,100.00	2.48
4	603596	伯特利	728,446.00	1.16

8.4.3 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	11,804,515.71
卖出股票收入（成交）总额	8,935,205.94

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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	14,670,345.21	6.95

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	103,122,590.84	48.83
5	企业短期融资券	5,105,874.32	2.42
6	中期票据	20,722,921.88	9.81
7	可转债（可交换债）	27,481,648.16	13.01
8	同业存单	-	-
-	-	-	-
9	其他	-	-
10	合计	171,103,380.41	81.03

8.6 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	019678	22 国债 13	145,000	14,670,345.21	6.95
2	149526	21 广金 01	130,000	13,302,609.73	6.30
3	175630	21 海通 01	122,000	12,626,060.77	5.98
4	149440	21 深铁 05	110,000	11,316,473.01	5.36
5	143167	17 光控 02	109,000	11,066,814.79	5.24

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

8.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	21,821.35
2	应收清算款	5,002,567.12
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,653,538.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	10,677,927.46

8.11.4 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	118021	新致转债	5,176,104.83	2.45
2	110085	通22转债	5,149,989.04	2.44
3	118012	微芯转债	4,437,560.77	2.10
4	118003	华兴转债	4,430,567.59	2.10
5	118025	奕瑞转债	2,349,362.67	1.11
6	123153	英力转债	2,089,157.01	0.99
7	123159	崧盛转债	1,729,537.60	0.82
8	113619	世运转债	1,666,277.26	0.79

9	113628	晨丰转债	254,017.81	0.12
10	123129	锦鸡转债	167,111.88	0.08
11	123054	思特转债	17,801.00	0.01
12	128143	锋龙转债	14,160.70	0.01

8.11.5 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。

8.11.6 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。

§ 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

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	835	66,340.93	1,108,804.39	2.00	54,285,868.02	98.00
国海安盈债券 C	2,089	66,839.04	14,433,048.03	10.34	125,193,704.78	89.66
合计	2,924	66,696.79	15,541,852.42	7.97	179,479,572.80	92.03

9.2 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	748,530.24	1.35
	国海安盈债券 C	5,221,325.65	3.74
	合计	5,969,855.89	3.06

9.3 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	-

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
-	公募基金	-
	私募资产管理计划	-
	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管产品计划投资主办，未兼任私募资产管理计划投资经理。

§ 10 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) 基金份额总额	57,578,688.38	-
本报告期期初基金份额总额	31,655,898.30	30,685,160.15
本报告期基金总申购份额	68,688,607.82	316,975,959.56
减：本报告期基金总赎回份额	44,949,833.71	208,034,366.90
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	55,394,672.41	139,626,752.81

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

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

基金管理人本报告期基金管理人重大人事变动如下：

1. 2023 年 12 月 28 日，卢凯先生因个人原因辞去公司总裁职务。
2. 2023 年 12 月 29 日，公司召开第九届董事会第二十七次会议，指定度万中先生代为履行总裁职责，度万中先生自 2023 年 12 月 29 日起代为履行总裁职责；聘任郎蒙先生为公司副总裁，郎蒙先生自 2023 年 12 月 29 日起正式履行副总裁职责。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给上会会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 20,000.00 元人民币。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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

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。

11.6.2 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。

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 (%)	
国海证券	2	8,989,865.72	100.00	90,057.28	100.00	-

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 (%)
国海证券	358,840,643.17	100.00	1,882,761,000.00	100.00	-	-

11.8 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关于增加蚂蚁基金为国海安盈债券型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023年1月18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 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2023年1月28日
3	国海证券安盈债券型集合资产管理计划 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定网站	2023年1月28日
4	国海证券股份有限公司关于旗下部分集合资产管理计划增加盈米基金销售有限公司为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023年2月27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 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2023年3月31日
6	国海证券安盈债券型集合资产管理计划 2022 年年度报告	中国证监会规定网站	2023年3月31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 2023 年第一季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2023年4月21日
8	国海证券安盈债券型集合资产管理计划 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定网站	2023年4月21日
9	国海证券股份有限公司关于增加东方财富证券股份有限公司为国海证券安盈债券型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023年5月23日
10	国海证券安盈债券型集合资产管理计划招募说明书更新（2023年5月）	中国证监会规定网站	2023年5月25日
11	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	中国证监会规定网站	2023年5月25日

	(2023 年 5 月)		
12	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(2023 年 5 月)	中国证监会规定网站	2023 年 5 月 25 日
13	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 年第二季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2023 年 7 月 21 日
14	国海证券安盈债券型集合资产管理计划 2023 年第 2 季度报告	中国证监会规定网站	2023 年 7 月 21 日
15	国海证券股份有限公司关于增加汇成基金为国海安盈债券型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 7 月 26 日
16	国海证券股份有限公司关于增加京东肯特瑞基金为国海安盈债券型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 8 月 1 日
17	国海证券股份有限公司关于增加兴业银行股份有限公司为国海证券安盈债券型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 8 月 10 日
18	国海证券股份有限公司关于增加广州银行股份有限公司为国海证券安盈债券型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 8 月 30 日
19	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 年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2023 年 8 月 31 日
20	国海证券安盈债券型集合资产管理计划 2023 年中期报告	中国证监会规定网站	2023 年 8 月 31 日
21	国海证券股份有限公司关于增加雪球基金为国海安盈债券型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 9 月 13 日
22	国海证券股份有限公司关于增加徽商期货有限责任公司为国海证券安盈债券型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 10 月 16 日
23	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 年第三季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2023 年 10 月 25 日
24	国海证券安盈债券型集合资产管理计划 2023 年第 3 季度报告	中国证监会规定网站	2023 年 10 月 25 日
25	国海证券股份有限公司关于增加上海	中国证监会规定报刊及	2023 年 11 月 24 日

	利得基金为国海安盈债券型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	规定网站	
--	---------------------------------------	------	--

§ 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

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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。

13.3 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）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 3 月 29 日