

华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理 计划

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:华鑫证券有限责任公司

基金托管人:上海银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 01 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会、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。

集合计划托管人上海银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2024年07月31日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告的财务资料未经审计。

本报告期自 2024年1月1日起至 2024年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
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	11
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
§5 托管人报告	12
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50

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.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
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.....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
§12 备查文件目录.....	53
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划	
基金简称	华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券	
基金主代码	970062	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年08月03日	
基金管理人	华鑫证券有限责任公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	63,996,117.97份	
基金合同存续期	本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过三年。管理人在此期间获得公募基金管理业务资格并将本计划变更注册为公募基金的除外	
下属分级基金的基金简称	华鑫证券乐享周周购 三个月滚动持有债券 A	华鑫证券乐享周周购 三个月滚动持有债券 C
下属分级基金的交易代码	970061	970062
报告期末下属分级基金的份额总额	47,113,624.47份	16,882,493.50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。

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，力求实现集合计划资产的长期稳定增值，力争为投资者实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	主要投资策略有利率债投资策略、信用债投资策略、国债期货投资策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略
业绩比较基准	中证全债指数收益率

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		华鑫证券有限责任公司	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张寅晟	周直毅
	联系电话	021-54967596	021-68475608
	电子邮箱	zhangys@cfsc.com.cn	custody@bosc.cn
客户服务电话		95323	95594
传真		021-54967280	021-68476901
注册地址		深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道7888号东海国际中心一期A栋2301A	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号
办公地址		上海市黄浦区福州路666号华鑫海欣大厦5层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号27层
邮政编码		200030	200120
法定代表人		俞洋	金煜

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://cfsc.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区福州路666号 华鑫海欣大厦5层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华鑫证券有限责任公司	上海市黄浦区福州路666号华鑫海欣大厦5楼

§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01月01日-2024年06月30日)	
	华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券A	华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券C
本期已实现收益	650,837.51	194,315.71
本期利润	910,483.55	282,473.66
加权平均基金份额本期利润	0.0198	0.0174
本期加权平均净值利润率	1.72%	1.54%
本期基金份额净值增长率	1.72%	1.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	7,169,053.74	2,163,336.06
期末可供分配基金份额利润	0.1522	0.1281
期末基金资产净值	54,870,023.76	19,195,387.45
期末基金份额净值	1.1646	1.1370
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	9.18%	8.23%

- 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。
- 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

华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券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	0.15%	0.03%	0.99%	0.04%	-0.84%	-0.01%
过去三个月	0.98%	0.03%	1.92%	0.08%	-0.94%	-0.05%
过去六个月	1.72%	0.03%	4.31%	0.08%	-2.59%	-0.05%
过去一年	3.23%	0.03%	6.59%	0.07%	-3.36%	-0.04%
自基金合同生效起至今	9.18%	0.04%	15.45%	0.06%	-6.27%	-0.02%

华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券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	0.12%	0.04%	0.99%	0.04%	-0.87%	0.00%
过去三个月	0.91%	0.03%	1.92%	0.08%	-1.01%	-0.05%
过去六个月	1.57%	0.03%	4.31%	0.08%	-2.74%	-0.05%
过去一年	2.92%	0.03%	6.59%	0.07%	-3.67%	-0.04%
自基金合同生效起至今	8.23%	0.04%	15.45%	0.06%	-7.22%	-0.02%

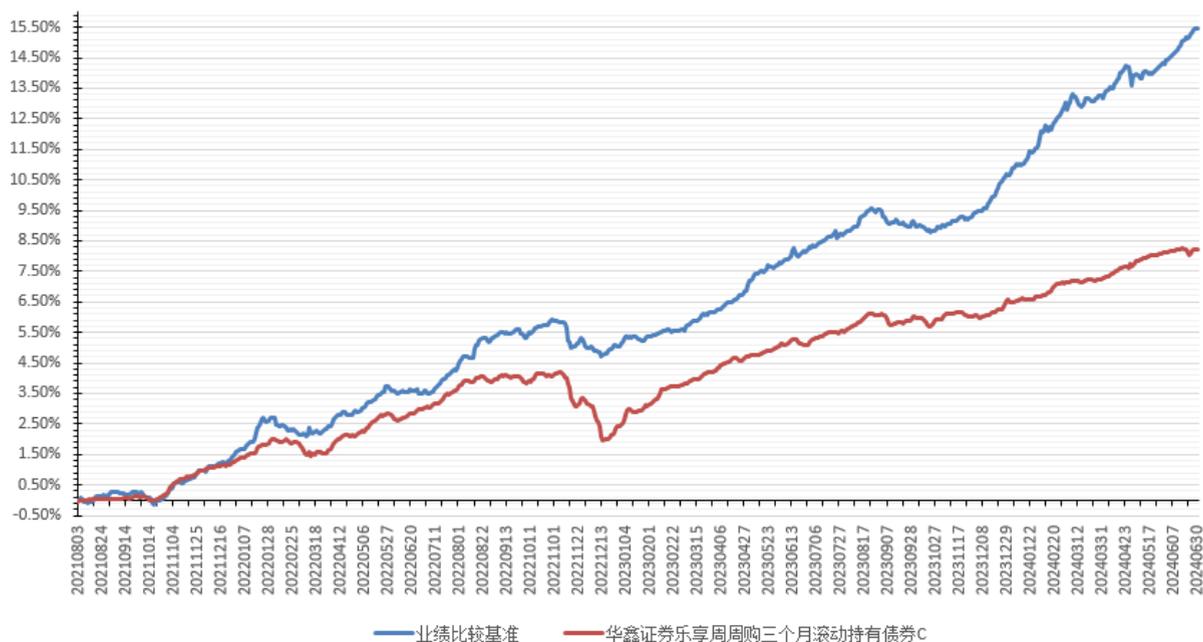
注：本基金基金合同生效日期为2021年8月3日。

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变动的比较

华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年08月03日-2024年6月30日)



华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年08月03日-2024年6月30日)



注：本基金基金合同生效日期为2021年8月3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

华鑫证券有限责任公司是经中国证券监督管理委员会批准于2001年3月在深圳市注册成立的全国性综合类证券经营机构。目前注册资本为36亿元，股东为上海华鑫股份有限公司(交易代码:600621)。

公司原股东为上海仪电、飞乐音响、华鑫股份和上海贝岭组成，其中，上海仪电是上海国有资产监督管理委员会所属的国有大型企业。2017年4月、经中国证监会核准，公司完成重大资产重组，成为华鑫股份全资子公司，公司实质性地跻身上市券商行列。2009年8月6日，中国证券监督管理委员会核发证监许可【2009】751号《关于核准华鑫证券有限责任公司证券资产管理业务资格的批复》，同意华鑫证券从事资产管理业务。2016年10月12日，华鑫证券获得受托管理保险资金资格。

华鑫证券根据《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，截至本报告期末，旗下共1只大集合产品完成公募化改造，即“华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券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		
王晗	投资经理	2021-11-15	-	9年	中国人民大学金融学硕士，现任华鑫证券有限责任公司资产管理部固定收益负责人，曾任兴证证券资产管理有限公司研究员、投资经理，中融国际信托有限公司高级经理，在固定收益领域具有丰富的投资和研究经验。

1、首任基金经理的“任职日期”为开始担任本基金基金经理的日期，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》等有关

法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金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 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

2024年以来，债市整体延续了去年四季度末开启的牛市行情，市场围绕“资产荒”、基本面预期、政策面变化，推动债市利率持续下行创新低。进入4月后，由于利率行至历史低位，同时基本面边际出现了一些积极的信号，外部受到美联储降息预期边际放缓影响，央行宽松货币态度有所收敛，并不断提醒债券市场的利率风险，债券市场开始进入如资金推动的“资产荒”和央行引导的利率之间互相“博弈”。

基本面方面，回顾上半年基本面走势，节奏上1-2月份较弱，后逐步走稳并缓步向上，需求方面呈现“外需较强，内需较弱”，在海外经济体需求较强的带动下，出口指标表现超过市场预期，但是影响债市走势最核心的变量房地产依旧处于收缩下行态势，在房地产企稳之前，基本面大环境对于债市依旧有利。

报告期末，产品杠杆比例103.68%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券A基金份额净值为1.1646元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.72%，同期业绩比较基准收益率为4.31%；截至报告期末华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券C基金份额净值为1.1370元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.57%，同期业绩比较基准收益率为4.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，从最新披露的3月PMI数据来看，经济复苏的迹象初步显现，但拖累经济的最主要因素房地产仍待观察，即使房地产销售企稳，鉴于前期累积的高库存也需要一定的时间进行消化，因此需要进一步观察经济复苏的斜率和持续性，基本面对债市仍旧有利。我们预计在基本面未实质企稳之前，央行大概率会继续维持偏宽松的货币政策环境，配合信贷和财政的进一步发力。

具体到投资策略，我们认为2024年三季度债市整体风险不大，短期内债市受到政策影响可能面临一定的震荡调整压力，但在经济复苏企稳之前尤其是以地产为核心的宏观经济变量企稳之前债市依然延续震荡的趋势。利率品种可以挖掘交易性的机会，信用债维持票息为主的策略，同时保持资产的高流动性以应对可能的市场变化。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本集合计划报告期内未进行利润分配。

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

本集合计划报告期内无需要说明的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,415,931.37	266,201.82
结算备付金		88,866.71	201,095.49
存出保证金		1,176.06	1,409.32
交易性金融资产	6.4.7.2	75,285,292.78	72,308,271.40
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		75,277,280.81	70,543,843.22
资产支持证券投资		8,011.97	1,764,428.18
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收清算款		-	-

应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		76,791,266.92	72,776,978.03
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		2,500,745.10	6,401,610.89
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		30,406.18	28,473.27
应付托管费		6,081.23	5,694.64
应付销售服务费		4,663.72	4,558.57
应付投资顾问费		-	-
应交税费		49,436.04	51,268.81
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.3	134,523.44	100,198.86
负债合计		2,725,855.71	6,591,805.04
净资产：			
实收基金	6.4.7.4	64,328,323.21	58,461,958.12
未分配利润	6.4.7.5	9,737,088.00	7,723,214.87
净资产合计		74,065,411.21	66,185,172.99
负债和净资产总计		76,791,266.92	72,776,978.03

注：

1、报告截止日2024年6月30日，基金份额净值1.1573元，基金份额总额63,996,117.97份

份；其中A类基金份额净值1.1646元，基金份额47,113,624.47份，C类基金份额净值1.1370元，基金份额16,882,493.50份。

6.2 利润表

会计主体：华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		1,519,581.85	4,225,725.60
1.利息收入		19,845.35	51,476.09
其中：存款利息收入	6.4.7.6	18,403.83	51,476.09
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		1,441.52	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		1,149,116.78	1,829,640.90
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.7	1,132,925.90	1,721,018.81
资产支持证券投资 收益	6.4.7.8	16,190.88	108,622.09
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.9	347,803.99	2,343,558.00

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.10	2,815.73	1,050.61
减：二、营业总支出		326,624.64	765,435.15
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	177,615.64	299,426.03
2.托管费	6.4.10.2.2	35,523.10	59,885.23
3.销售服务费	6.4.10.2.3	27,328.79	30,266.96
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		21,738.56	285,817.66
其中：卖出回购金融资产支出		21,738.56	285,817.66
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		3,738.39	6,887.20
8.其他费用	6.4.7.11	60,680.16	83,152.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,192,957.21	3,460,290.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,192,957.21	3,460,290.45
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,192,957.21	3,460,290.45

6.3 净资产变动表

会计主体：华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	58,461,958.12	7,723,214.87	66,185,172.99

产			
二、本期期初净资产	58,461,958.12	7,723,214.87	66,185,172.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,866,365.09	2,013,873.13	7,880,238.22
（一）、综合收益总额	-	1,192,957.21	1,192,957.21
（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）	5,866,365.09	820,915.92	6,687,281.01
其中：1.基金申购款	14,516,195.64	2,027,089.70	16,543,285.34
2.基金赎回款	-8,649,830.55	-1,206,173.78	-9,856,004.33
（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、本期期末净资产	64,328,323.21	9,737,088.00	74,065,411.21
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	142,236,110.86	12,533,003.87	154,769,114.73
二、本期期初净资产	142,236,110.86	12,533,003.87	154,769,114.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-82,271,483.73	-5,554,600.55	-87,826,084.28

（一）、综合收益总额	-	3,460,290.45	3,460,290.45
（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）	-82,271,483.73	-9,014,891.00	-91,286,374.73
其中：1.基金申购款	8,609,736.65	955,310.11	9,565,046.76
2.基金赎回款	-90,881,220.38	-9,970,201.11	-100,851,421.49
（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、本期期末净资产	59,964,627.13	6,978,403.32	66,943,030.45

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：

陈海东

吴云

罗文君

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

华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）系由华鑫证券鑫财富乐享2号集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来。原集合计划为非限定性集合资产管理计划，自2013年4月15日起开始募集，2013年5月17日成立，2013年5月31日取得《关于华鑫证券有限责任公司发起设立华鑫证券鑫财富乐享2号集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函[2013]524号）。

华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划于2021年6月23日经中国证监会《关于准予华鑫证券鑫财富乐享2号集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2021]1957号）批准，《华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》于2021年8月3日起正式变更生效。本集合计划为契约型开放式，

自合同变更生效日起存续期不得超过三年，管理人在此期间获得公募基金管理业务资格并将本计划变更注册为公募基金的除外。本集合计划的管理人为华鑫证券有限责任公司（以下简称“华鑫证券”），托管人为上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公开发行的次级债、政府机构债、地方政府债、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分））、国债期货、资产支持证券、债券回购、债券逆回购、同业存单、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款等）以及法律法规或中国证监会允许集合资产管理计划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资产管理计划投资其他品种，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：本集合计划投资于债券资产比例不低于集合计划资产的80%；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，本集合计划应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券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、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会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证全债指数收益率。

本财务报表由本集合计划的管理人华鑫证券有限责任公司于2024年8月1日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》和在财务报表附注四所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024年6月30日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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。

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 记账本位币

本集合计划采用人民币为记账本位币

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据其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，金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本集合计划现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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

本集合计划目前持有的债券投资和资产支持证券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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本集合计划持有的其他金融资产包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本集合计划目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本集合计划成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本集合计划将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者（3）该金融资产已转移，虽然本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。（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。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和负债基本为金融资产和金融负债。当本基金（1）具有抵消已确认金额的法定权力且该种法定权利现在是可以执行的；且（2）交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵消后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 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基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬、托管费和C类份额的销售服务费在费用涵盖期间按资产管理合同约定的费率和计算方法逐日确认。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。可以在集合计划财

产中列支的其他费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从集合计划财产中支付。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本集合计划的收益分配原则为：

- 1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《集合计划合同》生效不满3个月可不进行收益分配；
- 2、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的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；
- 3、集合计划收益分配后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集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值
- 4、同一类别每一集合计划份额享有同等分配权；由于本集合计划A类份额不收取销售服务费，C类份额收取销售服务费，各份额类别对应的可供分配利润将有所不同；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

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

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本集合计划的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本集合计划确定以下类别债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、证券交易所上市的有价证券的估值

- (1) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；
- (2) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；
- (3) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；
- (4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(5) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，按成本应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

2、首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值

5、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

6、国债期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

7、银行存款、回购等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。

8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

9、当发生大额申购或赎回情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性。

10、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。如管理人或托管人发现集合计划估值违反集合计划合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护集合计划份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，集合计划资产净值计算和集合计划会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的集合计划会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合计划净值的计算结果对外予以公布。

自2023年4月3日起，依据中基协发布的《关于固定收益品种的估值处理标准》，以公允价值计量的固定收益品种估值处理如下：

本节所称的固定收益品种，包括在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的国债、中央银行债、政策性银行债、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、商业银行金融债、可转换债券、可交换债券、私募债、证券公司短期债、资产支持证券、非公开定向债务融资工具、同业存单等债券投资品种，以及同业存款、债券回购等其他在活跃市场中没有报价但回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

1) 对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价，管理人应根据相关法律、法规的规定进行涉税处理（下同）。

2) 对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价。

对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

3) 对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券建议选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

4) 对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，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其公允价值。

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

根据《企业会计准则第22号--金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号--金融资产转移》、《企业会计准则第24号--套期会计》、《企业会计准则第37号--金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本集合计划自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于2022年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号》，自2022年1月1日起，本集合计划的管理人已采用上述准则及通知编制本集合计划年度财务报表及中期报告。

本集合计划本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

财政部、国家税务总局财税[2016]140号《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]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》对资产管理计划增值税做出相关规定。除增值税外，本集合计划比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，若遇政策法规调整，相关的税务问题将按照调整后的政策法规执行。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，2018年1月1日(含)以后，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。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：(一)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；(二)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，基金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。

3、所得税

根据《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税[2008]1号)的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，从基金分配中取得的收入，债券的利息收入以及其他收入，暂不征收企业所得税。

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06月30日
活期存款	1,415,931.37
等于：本金	1,415,483.96
加：应计利息	447.41
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	1,415,931.37

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债 交易所市场	48,198,821.28	1,169,155.61	49,566,016.41	198,039.52

券	银行间市场	25,186,420.00	320,264.40	25,711,264.40	204,580.00
	合计	73,385,241.28	1,489,420.01	75,277,280.81	402,619.52
资产支持证券		8,032.40	11.97	8,011.97	-32.40
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		73,393,273.68	1,489,431.98	75,285,292.78	402,587.12

6.4.7.3 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	3,203.28
其中：交易所市场	2,878.28
银行间市场	325.00
应付利息	-
预提费用-审计费	2,238.60
预提费用-信息披露费	119,781.56
预提费用-账户维护费	9,300.00
合计	134,523.44

6.4.7.4 实收基金

6.4.7.4.1 华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券A

金额单位：人民币元

项目 (华鑫证券乐享周周购三个月 滚动持有债券A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	42,121,975.11	42,418,739.66
本期申购	11,564,395.62	11,646,502.82
本期赎回(以“-”号填列)	-6,572,746.26	-6,619,412.77

本期末	47,113,624.47	47,445,829.71
-----	---------------	---------------

6.4.7.4.2 华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券C

金额单位：人民币元

项目 (华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,043,218.46	16,043,218.46
本期申购	2,869,692.82	2,869,692.82
本期赎回（以“-”号填列）	-2,030,417.78	-2,030,417.78
本期末	16,882,493.50	16,882,493.50

6.4.7.5 未分配利润

6.4.7.5.1 华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券A

单位：人民币元

项目 (华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,822,979.47	-15,655.00	5,807,324.47
本期期初	5,822,979.47	-15,655.00	5,807,324.47
本期利润	650,837.51	259,646.04	910,483.55
本期基金份额交易产生的变动数	695,236.76	11,149.27	706,386.03
其中：基金申购款	1,625,942.66	32,604.19	1,658,546.85
基金赎回款	-930,705.90	-21,454.92	-952,160.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,169,053.74	255,140.31	7,424,194.05

6.4.7.5.2 华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

(华鑫证券乐享周周购 三个月滚动持有债券 C)			
上年度末	1,864,514.61	51,375.79	1,915,890.40
本期期初	1,864,514.61	51,375.79	1,915,890.40
本期利润	194,315.71	88,157.95	282,473.66
本期基金份额交易产 生的变动数	104,505.74	10,024.15	114,529.89
其中：基金申购款	345,311.69	23,231.16	368,542.85
基金赎回款	-240,805.95	-13,207.01	-254,012.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,163,336.06	149,557.89	2,312,893.95

6.4.7.6 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	17,742.91
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	654.39
其他	6.53
合计	18,403.83

6.4.7.7 债券投资收益

6.4.7.7.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	1,210,230.11
债券投资收益——买卖债券（债转股 及债券到期兑付）差价收入	-77,304.21

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	1,132,925.90

6.4.7.7.2 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01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	16,032,005.95
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,368,965.92
减：应计利息总额	738,072.89
减：交易费用	2,271.35
买卖债券差价收入	-77,304.21

6.4.7.8 资产支持证券投资收益

6.4.7.8.1 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01月01日至2024年06月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	23,256.10
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-7,065.22
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	16,190.88

6.4.7.8.2 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01月01日至2024年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	1,771,870.00
减：卖出资产支持证券成本总额	1,751,565.22
减：应计利息总额	27,370.00
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-7,065.22

6.4.7.9 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	358,258.77
——股票投资	-
——债券投资	359,693.55
——资产支持证券投资	-1,434.78
——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	10,454.78
合计	347,803.99

6.4.7.10 其他收入

单位：人民币元

项目	本期

	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	2,815.73
合计	2,815.73

6.4.7.11 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	2,238.60
信息披露费	39,781.56
汇划手续费	60.00
帐户维护费	18,600.00
合计	60,680.16

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，本集合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

截至财务报表报出日，本集合计划并无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期内无。

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
华鑫证券有限责任公司("华鑫证券")	集合计划管理人、销售机构
上海银行股份有限公司("上海银行")	托管人、代销机构
华鑫证券鑫选多策略FOF1号单一资产管理计划	同一管理人管理的私募资产管理计划

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
华鑫证券	36,303,363.07	100.00%	191,481,599.02	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06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
华鑫证券	45,010,000.00	100.00%	563,250,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 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01月01日至2024年06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	占期末应付佣金总额的比例

华鑫证券	4,119.26	100.00%	2,878.28	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06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	占期末应付佣金总额的比例
华鑫证券	55,300.41	100.00%	1,783.18	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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 2024年01月01日至2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	177,615.64	299,426.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	177,615.64	299,426.03

注：

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div 365$$

H为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计算，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款指令，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。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024	上年度可比期间 2023年01月01日至2023
----	------------------------	-----------------------------

	年06月30日	年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	35,523.10	59,885.23

注：

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div 365$$

H为每日应计提的集合计划托管费

E为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计算，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款指令，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。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

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01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券A	华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券C	合计
华鑫证券	0.00	27,328.79	27,328.79
合计	0.00	27,328.79	27,328.79
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券A	华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券C	合计
华鑫证券	0.00	30,266.96	30,266.96
合计	0.00	30,266.96	30,266.96

注：

本集合计划A类份额不收取销售服务费，C类份额的销售服务费年费率为0.30%。本集合计划销售服务费将专门用于本集合计划的销售与集合计划份额持有人服务，管理人将在

年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div 365$$

H 为C类份额每日应计提的销售服务费

E 为C类份额前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由管理人向托管人发送销售服务费划款指令，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，并由管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，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

本基金本报告期未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券A

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	6,395,053.51
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	-	4,700,000.00
报告期末持有的基金份额	-	1,695,053.51
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	2.84%

华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券C

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	7,975,700.01	7,975,700.01
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	7,975,700.01	7,975,700.01
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.46%	13.37%

6.4.10.4.2 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

华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年06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
华鑫证券鑫选多策略FOF1号单一资产管理计划	12,715,857.47	19.87%	12,715,857.47	30.19%

6.4.10.5 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01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海银行股份有限公司	1,415,931.37	17,742.91	736,087.95	45,916.76

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期末在承销期内申购关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本集合计划本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年06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

本集合计划本报告期无因认购新发/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

本集合计划本报告期无持有的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

本集合计划本报告期无银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024年06月30日止，集合计划从事上海证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 2,500,745.10元，于 2024年07月02日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本集合计划管理人制定了相应的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。

本集合计划管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司以分层架构、集中管理模式进行全面风险管理，实行“董事会（董事会风险控制委员会）、监事会--经营管理层（包括经营管理层风险管理委员会）及首席风险官--公司风险管理职能部门--各风险管理责任单元（即各部门、分支机构及子公司）”的四级风险管理组织体系。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本集合计划的银行存款均存放于信用良好的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本集合计划在在交易所和银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。本集合计划管理人建立了信用风险管理流程，通过对发行人信用等级评估来控制投资标的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 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06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	32,399,569.38	37,787,221.02
AAA以下	18,213,522.92	23,553,771.52
未评级	24,664,188.51	9,202,850.68
合计	75,277,280.81	70,543,843.22

注：以上债券评级取自第三方评级机构的债项评级；其中未评级债券为上交所国债以及银行间中期票据【22闽能源MTN001、22京国资MTN001、22金禹水利MTN003、24景德镇陶MTN001】。

6.4.13.2.2 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06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	8,011.97	1,764,428.18
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	8,011.97	1,764,428.18

注：以上资产支持证券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合计划委托人于约定开放日要求退出集合计划，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。

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。

在日常运作中，本集合计划的流动性安排能够与集合计划合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。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。

在资产端，本集合计划主要投资于合同约定的具有良好流动性的金融工具。集合计划管理人持续监测本集合计划持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，集合计划管理人持续监测本集合计划开放期内投资者历史申购、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持集合计划资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，集合计划管理人将采用本集合计划合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。此外，本集合计划可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过集合计划持有的债券资产的公允价值。

本集合计划本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

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、结算备付金和存出保证金等利率敏感性资产，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06月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,415,483.96	-	-	-	-	447.41	1,415,931.37
结算备付金	88,826.71	-	-	-	-	40.00	88,866.71
存出保证金	1,175.56	-	-	-	-	0.50	1,176.06
交易性金融资产	-	5,018,000.00	29,358,200.00	39,419,660.80	-	1,489,431.98	75,285,292.78
资产总计	1,505,486.23	5,018,000.00	29,358,200.00	39,419,660.80	-	1,489,919.89	76,791,266.92
负债							
卖出回购金融资产款	2,499,875.00	-	-	-	-	870.10	2,500,745.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	30,406.18	30,406.18
应付托管费	-	-	-	-	-	6,081.23	6,081.23
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,663.72	4,663.72
应交税费	-	-	-	-	-	49,436.04	49,436.04
其他负债	-	-	-	-	-	134,523.44	134,523.44
负债总计	2,499,875.00	-	-	-	-	225,980.71	2,725,855.71
利率敏感度缺口	-994,388.77	5,018,000.00	29,358,200.00	39,419,660.80	-	1,263,939.18	74,065,411.21
上年度末 2023年12月31日							
资产							
货币资金	266,067.57	-	-	-	-	134.25	266,201.82
结算备付金	200,996.05	-	-	-	-	99.44	201,095.49
存出保证金	1,408.55	-	-	-	-	0.77	1,409.32
交易性金融资产	5,001,000.00	-	10,833,400.00	54,743,072.32	-	1,730,799.08	72,308,271.40
资产总计	5,469,472.17	-	10,833,400.00	54,743,072.32	-	1,731,033.54	72,776,978.03
负债							
卖出回购金融资产款	6,399,680.00	-	-	-	-	1,930.89	6,401,610.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,473.27	28,473.27
应付托管费	-	-	-	-	-	5,694.64	5,694.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,558.57	4,558.57
应交税费	-	-	-	-	-	51,268.81	51,268.81
其他负债	-	-	-	-	-	100,198.86	100,198.86
负债总计	6,399,680.00	-	-	-	-	192,125.04	6,591,805.04
利率敏感度缺口	-930,207.83	-	10,833,400.00	54,743,072.32	-	1,538,908.50	66,185,172.99

注：上表统计了本集合面临的利率风险敞口，表中所示为本集合资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

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06月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率上升25个基点	-244,071.66	-234,666.78
市场利率下降25个基点	245,825.65	236,408.21	

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。

6.4.13.4.3 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。本集合计划所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。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,所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险,因此无重大其他价格风险。

于2024年6月30日,本集合计划未持有交易性权益类投资,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集合计划资产净值无重大影响。

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06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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	75,277,280.81	101.64	70,543,843.22	106.59
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	75,277,280.81	101.64	70,543,843.22	106.59

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

2023年6月30日，本基金未持有交易性权益类投资，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。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

本集合计划在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

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 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06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	3,822,879.96	3,603,144.83
第二层次	71,462,412.82	68,705,126.57
第三层次	-	-
合计	75,285,292.78	72,308,271.40

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本计划以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售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。

本报告期内公允价值所属层次间未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截止2024年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值的披露

本集合计划在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

2、持续和非持续第一层次公允价值计量项目市价的确定依据

持续第一层次公允价值计量项目的公允价值是相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

3、持续和非持续第二层次公允价值计量项目，采用的估值技术和重要参数的定性及定量信息

对不存在活跃市场的投资品种，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，本集合计划采用中证估值和中债估值的估价净价作为不存在活跃市场的投资品种的估值依据。

4、截止2024年6月30日，本集合计划未持有按第三层次公允价值计量的金融工具。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	75,285,292.78	98.04
	其中：债券	75,277,280.81	98.03
	资产支持证券	8,011.97	0.01
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	1,504,798.08	1.96
8	其他各项资产	1,176.06	0.00
9	合计	76,791,266.92	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有股票。

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

本集合计划本报告期末未持有股票。

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

本集合计划本报告期末未持有股票。

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

本集合计划本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本集合计划本报告期末未持有股票。

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	4,042,922.74	5.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	41,700,213.71	56.30
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	25,711,264.40	34.71
7	可转债(可交换债)	3,822,879.96	5.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	75,277,280.81	101.64

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	175283	20昆交G2	50,000	5,335,150.69	7.20
2	188432	21国君G8	50,000	5,303,465.75	7.16
3	102282495	22金禹水利MTN 003	50,000	5,288,282.79	7.14
4	163185	20涪交02	50,000	5,259,828.77	7.10
5	188539	21淮安02	50,000	5,256,931.51	7.10

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	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净
---	------	------	-------	------	--------

号					值比例 (%)
1	183606	浙租1A2	50,000	8,011.97	0.01

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

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

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

本集合计划本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体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。

本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明。

报告期内，本集合计划未投资股票。

7.12.3 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	1,176.06
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,176.06

7.12.4 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	110081	闻泰转债	1,090,119.89	1.47
2	110076	华海转债	434,433.64	0.59
3	113052	兴业转债	432,862.36	0.58
4	127046	百润转债	432,826.10	0.58
5	113053	隆22转债	407,003.78	0.55
6	113050	南银转债	376,249.81	0.51
7	113616	韦尔转债	336,804.82	0.45
8	123035	利德转债	134,553.30	0.18
9	113633	科沃转债	106,750.56	0.14
10	113045	环旭转债	71,275.70	0.10

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期内本计划未持有股票。

§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
华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券A	206	228,706.91	12,715,857.47	26.99%	34,397,767.00	73.01%
华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券C	149	113,305.33	7,975,700.01	47.24%	8,906,793.49	52.76%

合计	355	180,270.75	20,691,557.48	32.33%	43,304,560.49	67.67%
----	-----	------------	---------------	--------	---------------	--------

其中A类机构户份额中含有产品户1户份额12,715,857.47份；分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额，对合计计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计计数（即期末基金份额总额）。

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	华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券A	1,668,529.93	3.54%
	华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券C	601,890.84	3.57%
	合计	2,270,420.77	3.55%

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	华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券A	0
	华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券A	0~10
	华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	华鑫证券乐享周周购三 个月滚动持有债券A	华鑫证券乐享周周购三 个月滚动持有债券C
基金合同生效日(2021年08月03日)基金份额总额	61,766,606.68	20,704,053.06
本报告期期初基金份额总额	42,121,975.11	16,043,218.46
本报告期基金总申购份额	11,564,395.62	2,869,692.82
减：本报告期基金总赎回份额	6,572,746.26	2,030,417.78
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	47,113,624.47	16,882,493.50

§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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。
报告期内未发生涉及基金托管业务的重大诉讼。

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

2024年6月27日，华鑫证券有限责任公司改聘众华会计师事务所（特殊普通合伙）为华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划进行审计服务。

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

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

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	
华鑫证券	2	-	-	4,119.26	100.00%	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华鑫证券	36,303,363.07	100.00%	45,010,000.00	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	华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划暂停申购业务公告	中国证监会指定报刊及网站、公司官网	2024-06-21
2	华鑫证券有限责任公司关于华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划改聘会计师事务所公告	中国证监会指定报刊及网站、公司官网	2024-06-28
3	华鑫证券有限责任公司关于华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划终止事宜的第一次提示性公告	中国证监会指定报刊及网站、公司官网	2024-06-28

§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

本集合计划报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2024年6月21日，华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划自2024年6月24日起暂停申购业务。

2024年6月28日，华鑫证券有限责任公司于2024年6月27日改聘华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划的会计师事务所。

2024年6月28日，华鑫证券有限责任公司出具关于华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划终止事宜的第一次提示性公告。

截至2024年6月30日，本公司及董事、监事、从业人员和其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合资产管理计划共计24,065,098.63份。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理招募说明书》；
- 3、《华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、集合计划管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

上海市黄浦区福州路666号华鑫海欣大厦5楼

12.3 查阅方式

投资者可与本集合计划管理人办公时间预约查询，或者登陆集合计划管理人网站 <http://cfsc.com.cn> 查阅，还可以拨打本公司客服电话（95323）查询相关信息。

华鑫证券有限责任公司

二〇二四年八月一日