

海通鑫逸债券型集合资产管理计划 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：上海海通证券资产管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经全部董事签字同意，并由董事长签发。

集合计划托管人上海银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期为 2021 年 9 月 7 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	19
§ 8 投资组合报告	42

8.1 期末基金资产组合情况	42
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
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	46
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	46
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	46
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
8.11 投资组合报告附注	47
§ 9 基金份额持有人信息	48
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	49
§ 10 开放式基金份额变动	49
§ 11 重大事件揭示	50
11.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
11.4 基金投资策略的改变	50
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	51
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
11.8 其他重大事件	51
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 13 备查文件目录	52
13.1 备查文件目录	52
13.2 存放地点	53
13.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海通鑫逸债券型集合资产管理计划	
基金简称	海通鑫逸	
基金主代码	851860	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 9 月 7 日	
基金管理人	上海海通证券资产管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	141,695,722.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海通鑫逸 A	海通鑫逸 C
下属分级基金的交易代码	851860	851880
报告期末下属分级基金的份额总额	128,945,784.38 份	12,749,937.84 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划采取稳健的资产配置策略,主要投资于固定收益类品种,严格管理权益类品种的投资比例,把握相对确定的股票二级市场投资机会,在控制风险的基础上,追求集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	管理人通过对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断,形成对未来市场利率变动方向和收益率曲线形状变化的预期,主动地调整债券投资组合的久期,提高债券投资组合的收益水平。具体债券选择上,信用债配置中高等级品种,利率债采用动态调整策略,通过长短期债券的不同配置比例调整久期。可转债筛选正股优良、估值合理及具备明显条款博弈价值的个券。股票策略均衡配置,选取经营稳健、政策导向的赛道进行分散配置。
业绩比较基准	<p>中债-综合全价(总值)指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+银行活期存款利率(税后)×5%。</p> <p>中债-综合全价(总值)指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的综合反映银行间和交易所市场债券整体走势的跨市场债券指数。沪深 300 指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数,是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好,同时公信力较好的股票指数。本集合计划的业绩比较基准根据本集合计划投资风格和策略特点设置,能够准确反映产品的风险收益特征,便于管理人合理衡量比较本集合计划的业绩表现。</p> <p>若未来法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本集合计划的业绩基准的指数,或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适</p>

	用或本业绩比较基准停止发布时，本集合计划管理人在与托管人协商一致并在按照监管部门要求履行适当程序后，可调整或变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开集合计划份额持有人大会。
风险收益特征	本集合计划属于债券型集合资产管理计划，预期风险和收益水平低于股票型集合资产管理计划、股票型基金、混合型集合资产管理计划和混合型基金、高于货币型集合资产管理计划和货币市场基金。本集合计划可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海海通证券资产管理有限公司	上海银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周陶	周直毅
	联系电话	021-23154762	021-68475608
	电子邮箱	htam@htsec.com	custody@bosscn.com
客户服务电话		95553、4008888001	95594
传真		021-63410460	021-68476936
注册地址		上海市广东路 689 号海通证券大厦 32 楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号
办公地址		上海市广东路 689 号海通证券大厦 32 楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 27 层
邮政编码		200001	200120
法定代表人		裴长江	金煜

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区南京东路 61 号 4 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年 9 月 7 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日	
	海通鑫逸 A	海通鑫逸 C
本期已实现收	1,925,352.36	146,788.69

益		
本期利润	2,241,857.55	139,659.09
加权平均基金份额本期利润	0.0310	0.0275
本期加权平均净值利润率	2.95%	2.60%
本期基金份额净值增长率	2.71%	2.61%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	
期末可供分配利润	5,401,493.86	755,813.66
期末可供分配基金份额利润	0.0419	0.0593
期末基金资产净值	137,433,467.97	13,576,153.81
期末基金份额净值	1.0658	1.0648
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	
基金份额累计净值增长率	2.71%	2.61%

注：1、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。

2、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。

3、期末可供分配利润,采用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(为期末余额,不是当期发生数)。

4、本财务报表的实际编制期间为 2021 年 9 月 7 日(合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日。

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

海通鑫逸 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	2.65%	0.18%	0.69%	0.08%	1.96%	0.10%

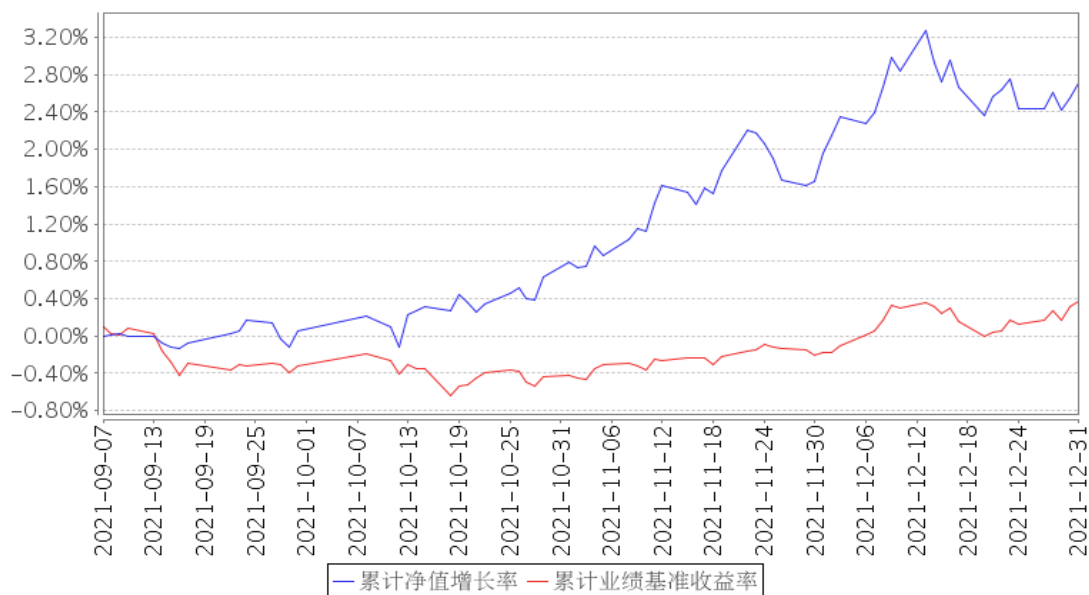
自基金合同生效起 至今	2.71%	0.17%	0.37%	0.09%	2.34%	0.08%
----------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

海通鑫逸 C

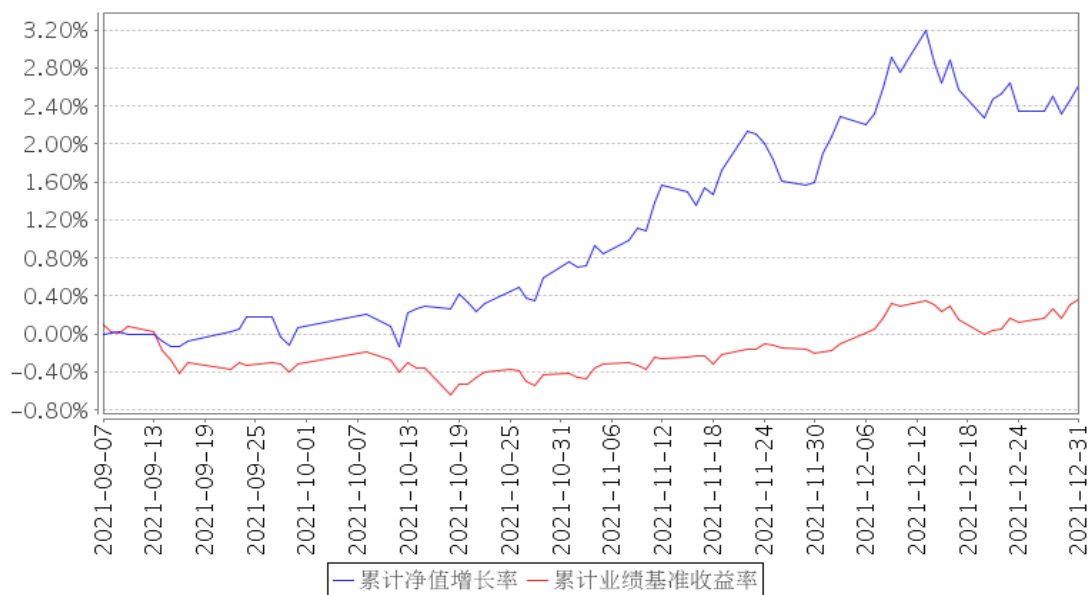
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.54%	0.18%	0.69%	0.08%	1.85%	0.10%
自基金合同生效起 至今	2.61%	0.17%	0.37%	0.09%	2.24%	0.08%

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

海通鑫逸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



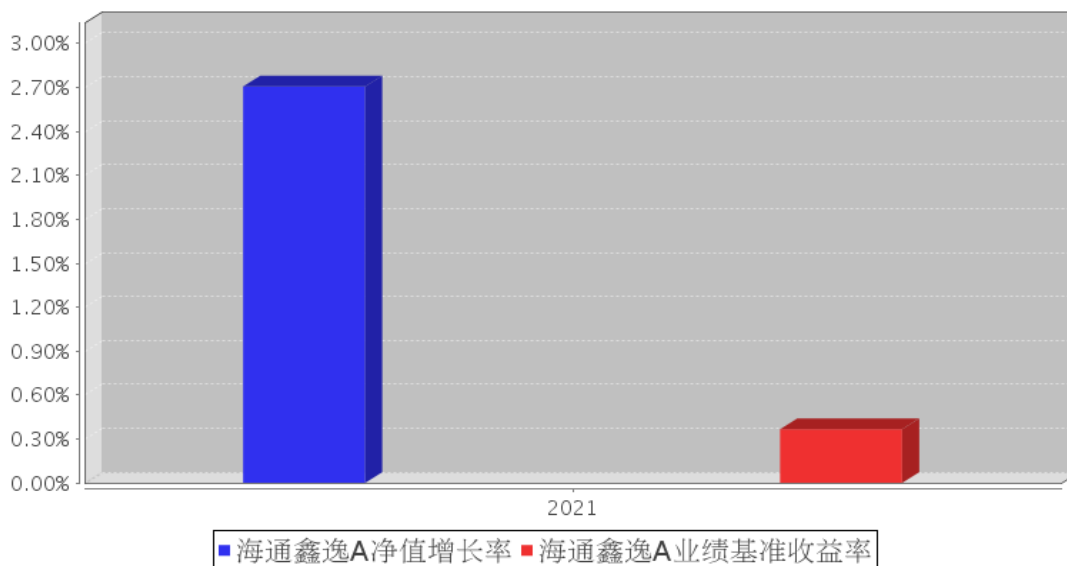
海通鑫逸C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

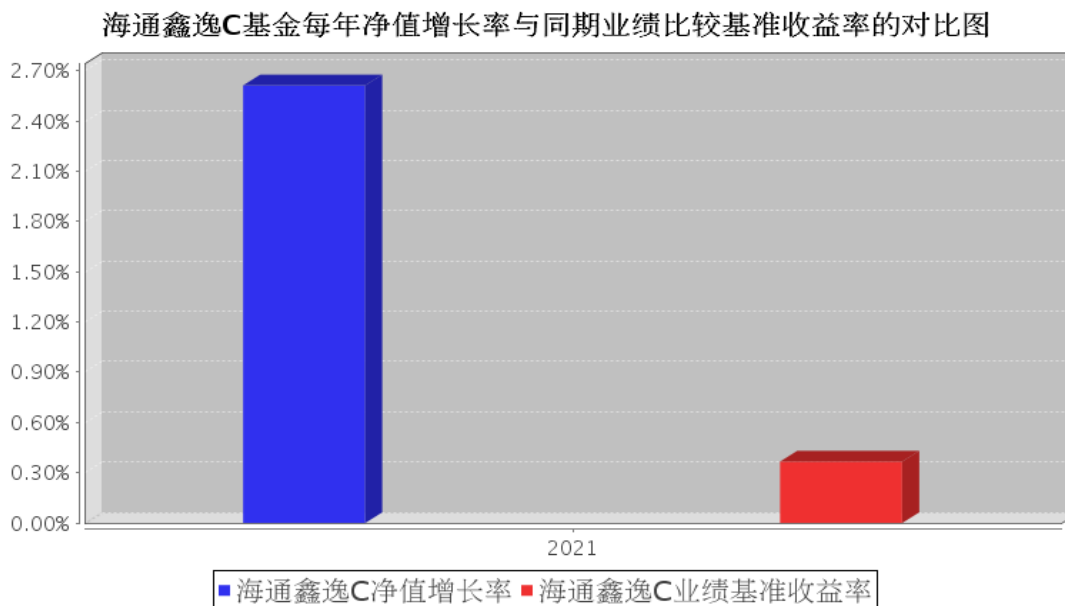


注：本集合计划合同生效日为 2021 年 9 月 7 日。按资产管理合同约定，管理人应当自资产管理合同生效之日起 6 个月内使集合计划的投资组合比例符合资产管理合同的有关约定。

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

海通鑫逸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





注：本集合计划合同生效之日为 2021 年 9 月 7 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本集合计划2021年9月7日（合同生效日）至2021年12月31日未进行利润分配。

§ 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

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

截至 2021 年 12 月 31 日，集合资产管理计划管理人共管理 9 只公募集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李亦星	投资经理、公募	2021 年 9 月 7 日	-	8 年	上海财经大学经济学硕士，拥有 12 年金融从业经验，曾任华安基金交易员、上海海

	固收部副 总监				通证券资产管理有限公司固收一部总监， 现任上海海通证券资产管理有限公司公募 固收部副总监。
--	------------	--	--	--	---

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

4.1.4 基金经理薪酬机制

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规以及集合计划合同、招募说明书的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在控制风险的基础上，为计划份额持有人谋求最大利益，没有发生损害计划份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本集合计划进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本产品自 9 月正式参照公募运作，以大类资产“动态调整”和行业赛道“均衡配置”为核心投资理念，守住底线控制回撤，向深入研究的领域获取长期合理回报。

建仓初期，伴随着降准的落地和大宗商品价格持续上涨带来通胀的压力，债券市场收益率上行，产品采取了短久期利率债为底仓进行建仓。11 月开始，房地产企业信用风险不断发酵，稳增长压力加大，降准和结构性降息的宽松政策再次落地，期间配置了高等级信用债提高产品的静态收益。可转债市场表现抢眼，碳中和以及稳增长相关行业的可转债轮番提升估值，产品对可转债进行了均衡配置，捕捉市场结构性机会。

对于股票资产，在建仓初期产品采取了“稳起步”的策略，9 月随着大宗商品价格的上涨，A 股周期股大幅上涨，期间产品仅小仓位配置。随着市场 9 月中下旬的调整，逐步将股票仓位提升至合意的水平，主要配置大消费、基建和科技板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本集合计划 A 份额净值为 1.0658 元，C 份额净值为 1.0648 元。本报告期集合计划上述两类份额净值增长率为 2.71%和 2.61%，业绩比较基准收益为 0.37%。

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 2022 年，宏观经济不确定性依旧存在，当前处于疫情经济复苏的后半程。货币政策预计将维持适度宽松的基调，主要考虑到地产数据回落明显，经济压力较大。财政政策有望进一步积极推进，专项债的发行以及减税降费的各项措施有利于降低企业经营成本，提升经济活力。基建持续发力和消费复苏预计将为 2022 年的经济注入动力。同时需要关注全球通胀的压力和地缘政治事件，会对国内市场造成的冲击，考验国内经济的结构和韧性。

对于债券市场，货币政策从前期疫情中退出开始回归中性，虽考虑到债务风险事件的出清货币政策未必会收紧，但明确的投资机会有限。当前债券的绝对收益率水平处于历史较低分位数，投资上会更注重规避信用风险，把握利率调整后的趋势性机会。

对于股票市场，整体波动会较去年加大。面对市场波动，将以产业链研究为出发点，配置核心竞争壁垒高的公司。主要关注两大逻辑线条，第一，高景气度行业赛道的细分龙头，第二，盈利稳健的低估值板块。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本管理人从合法合规运作、切实维护投资人合法利益的角度出发，持续推进全面风险管理理念，优化公司内部控制体系，更新完善相关内控制度和业务流程，强化员工合规和

风险意识，不断推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。本管理人秉持客观、公正的原则，通过系统监控、合规审核、信息披露、现场检查等一系列方式开展监察稽核工作，加强了风险控制与合规管理的力度，推动了内控管理体系的落实。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

- 一、本集合计划本报告期内无应分配的收益。
- 二、已实施的利润分配：无。
- 三、不存在应分配但尚未实施的利润。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本集合计划本报告期无需要说明的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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、集合计划合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了集合计划托管人义务，不存在损害本集合计划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、集合计划合同、托管协议的规定，对本集合计划的投资运作、集合计划资产净值计算、集合计划费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现集合计划管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、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 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	信会师报字[2022]第 ZA30301 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	海通鑫逸债券型集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	<p>我们审计了上海海通证券资产管理有限公司（以下简称“集合计划管理人”）作为集合计划管理人的海通鑫逸债券型集合资产管理计划（以下简称“海通鑫逸”）的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年 9 月 7 日（合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日的利润表、所有者权益（集合计划净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的行业实务操作编制，公允反映了海通鑫逸 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 9 月 7 日（合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于海通鑫逸，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。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>集合计划管理人对其他信息负责。其他信息包括海通鑫逸 2021 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，</p>

	<p>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>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>集合计划管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估海通鑫逸的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>集合计划管理人治理层负责监督海通鑫逸的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（三）评价集合计划管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四）对集合计划管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对海通鑫逸持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致海通鑫逸不能持续经营。</p> <p>（五）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与集合计划管理人就审计范围、时间安排和重大审计发</p>

	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。	
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	黄晔	迟媛
会计师事务所的地址	上海市南京东路 61 号 4 楼	
审计报告日期	2022 年 3 月 31 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海通鑫逸债券型集合资产管理计划

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	21,358,328.02
结算备付金		185,734.75
存出保证金		33,088.73
交易性金融资产	7.4.7.2	145,061,440.36
其中：股票投资		23,096,570.42
基金投资		-
债券投资		121,964,869.94
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	1,816,104.01
应收股利		-
应收申购款		610,100.92
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		169,064,796.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 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		-
应付证券清算款		17,141,649.77
应付赎回款		691,515.18

应付管理人报酬		54,598.57
应付托管费		3,899.89
应付销售服务费		3,889.27
应付交易费用	7.4.7.7	2,450.50
应交税费		28,768.25
应付利息		-722.63
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	129,126.21
负债合计		18,055,175.01
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	141,695,722.22
未分配利润	7.4.7.10	9,313,899.56
所有者权益合计		151,009,621.78
负债和所有者权益总计		169,064,796.79

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，本集合计划份额总额 141,695,722.22 份，其中 A 类计划份额净值 1.0658 元，份额总额 128,945,784.38 份；C 类计划份额净值 1.0648 元，份额总额 12,749,937.84 份。

本财务报表的实际编制期间为 2021 年 9 月 7 日(合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：海通鑫逸债券型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 9 月 7 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 9 月 7 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		2,746,038.25
1. 利息收入		537,295.97
其中：存款利息收入	7.4.7.11	11,518.10
债券利息收入		525,083.65
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		694.22
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,838,466.25
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,348,412.26
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	490,053.99
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-

贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	309,375.59
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	60,900.44
减：二、费用		364,521.61
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	174,296.54
2. 托管费	7.4.10.2.2	12,449.72
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	6,234.06
4. 交易费用	7.4.7.19	31,786.37
5. 利息支出		1,142.07
其中：卖出回购金融资产支出		1,142.07
6. 税金及附加		6,435.19
7. 其他费用	7.4.7.20	132,177.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,381,516.64
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,381,516.64

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海通鑫逸债券型集合资产管理计划

本报告期：2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	45,476,843.75	1,697,888.96	47,174,732.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,381,516.64	2,381,516.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	96,218,878.47	5,234,493.96	101,453,372.43
其中：1. 基金申购款	150,434,892.91	8,285,128.01	158,720,020.92
2. 基金赎回款	-54,216,014.44	-3,050,634.05	-57,266,648.49
四、本期向基金	-	-	-

份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	141,695,722.22	9,313,899.56	151,009,621.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>李井伟</u>	<u>陈颖</u>	<u>刘雯</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

海通鑫逸债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于 2021 年 8 月 3 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予海通赢家系列一半年鑫集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2021]2417 号）批准，《海通鑫逸债券型集合资产管理计划资产管理合同》于 2021 年 9 月 7 日起正式变更生效。本集合计划为契约型开放式，自合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本集合计划的管理人为上海海通证券资产管理有限公司，托管人为上海银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海通鑫逸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为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行、上市的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、存托凭证及其他依法发行、上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、国债期货以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具。

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投资比例不低于计划资产的 80%，投资股票（含存托凭证）的比例不高于计划资产的 20%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的 0%-50%）；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，持有现金或到期

日在一年以内的政府债券的比例合计不得低于计划资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本集合计划将港股通标的股票投资的比例下限设为零，本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股通标的股票或选择不将集合计划资产投资于港股通标的股票，集合计划资产并非必然投资港股通标的股票。

本集合计划的业绩比较基准为中债-综合全价（总值）指数收益率 \times 85%+沪深 300 指数收益率 \times 10%+银行活期存款利率（税后） \times 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（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〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海通鑫逸债券型集合资产管理计划资产管理合同》和在 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划 2021 年 9 月 7 日（计划合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 9 月 7 日（计划合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 9 月 7 日（计划合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划采用人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

金融资产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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本集合计划对金融资产的持有意图和持有能力。本集合计划现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本集合计划目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债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。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本集合计划持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本集合计划 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行集合计划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集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

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集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日认列，并于期末全额转

入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提。

买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率(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。

股票投资收益/(损失)以卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)以卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本和应收利息的差额确认。

资产支持证券投资收益/(损失)为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本和应收利息的差额确认。

基金投资收益/(损失)以卖出/赎回基金交易日的成交总额扣除应结转的基金投资成本的差额确认。

基金红利收入按持有份额计算红利收入金额，于红利日确认并计入投资收益。

股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算，于除息日确认并计入投资收益。

公允价值变动损益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期转出时计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本集合计划的收益分配政策为：

(1) 在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数最多为 12 次，

每份集合计划份额每次集合计划收益分配比例不得低于集合计划收益分配基准日每份集合计划份额可供分配利润的 10%，若《资产管理合同》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；因红利再投资转换的份额类别，与集合计划份额持有人在收益分配基准日持有的份额同属一个类别；如集合计划份额持有人持有多个类别份额的，则根据不同类别收益分配方案分别计算该类别红利再投资份额；

(3) 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；

(4) 由于本集合计划 A 类份额、C 类份额的费用收取方式存在不同，各类集合计划份额对应的可供分配收益将有所不同。本集合计划同一类别每一集合计划份额享有同等分配权；

(5) 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

本集合计划本报告期无外币交易。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 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股票投资、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) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本集合计划根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基

金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

（3）根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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：（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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	21,358,328.02
定期存款	-
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	-
合计	21,358,328.02

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		22,861,552.94	23,096,570.42	235,017.48
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	121,753,805.22	121,964,869.94	211,064.72
	银行间市场	-	-	-
	合计	121,753,805.22	121,964,869.94	211,064.72
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		144,615,358.16	145,061,440.36	446,082.20

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

注：本集合计划本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本集合计划本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应收活期存款利息	3,202.25
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	91.96
应收债券利息	1,812,793.52
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	16.28
合计	1,816,104.01

注：其他包括应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本集合计划本报告期末其他资产无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,450.50
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,450.50

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	126.21
应付证券出借违约金	-
预提费用	129,000.00
合计	129,126.21

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

海通鑫逸 A

项目	本期 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	45,476,843.75	45,476,843.75
本期申购	136,293,122.51	136,293,122.51
本期赎回（以“-”号填列）	-52,824,181.88	-52,824,181.88
-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	128,945,784.38	128,945,784.38

海通鑫逸 C

项目	本期 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	14,141,770.40	14,141,770.40
本期赎回（以“-”号填列）	-1,391,832.56	-1,391,832.56
-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	12,749,937.84	12,749,937.84

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

海通鑫逸 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	801,530.66	896,358.30	1,697,888.96
本期利润	1,925,352.36	316,505.19	2,241,857.55
本期基金份额交易产生的变动数	2,674,610.84	1,873,326.24	4,547,937.08
其中：基金申购款	4,494,408.97	3,020,297.82	7,514,706.79
基金赎回款	-1,819,798.13	-1,146,971.58	-2,966,769.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,401,493.86	3,086,189.73	8,487,683.59

海通鑫逸 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	146,788.69	-7,129.60	139,659.09
本期基金份额交易产生的变动数	609,024.97	77,531.91	686,556.88
其中：基金申购款	684,571.88	85,849.34	770,421.22
基金赎回款	-75,546.91	-8,317.43	-83,864.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	755,813.66	70,402.31	826,215.97

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	10,254.12
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	1,158.41
其他	105.57

合计	11,518.10
----	-----------

注：其他包括结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,348,412.26
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	1,348,412.26

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	18,570,359.32
减：卖出股票成本总额	17,221,947.06
买卖股票差价收入	1,348,412.26

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	490,053.99
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	490,053.99

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	61,454,608.67
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	59,963,361.93
减：应收利息总额	1,001,192.75
买卖债券差价收入	490,053.99

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本集合计划本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本集合计划本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本集合计划本报告期无其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

注：本集合计划本报告期无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	318,677.36
股票投资	235,017.48
债券投资	83,659.88
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	9,301.77
合计	309,375.59

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年 12月31日
基金赎回费收入	60,900.44
合计	60,900.44

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	31,786.37
银行间市场交易费用	-
合计	31,786.37

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年 12月31日
审计费用	2,859.66
信息披露费	120,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	18.00
账户维护费	9,300.00
合计	132,177.66

7.4.7.21 分部报告

本集合计划本报告期无分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本集合计划并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海海通证券资产管理有限公司（“海通资管”）	基金管理人、基金销售机构
上海银行股份有限公司（“上海银行”）	基金托管人
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

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 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
海通证券	58,694,311.70	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 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
海通证券	189,242,874.96	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 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
海通证券	10,200,000.00	

7.4.10.1.4 权证交易

注：本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

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 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021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（%）
海通证券	7,244.50	100.00	2,450.50	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。

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 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	57,075.32

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.7% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海通鑫逸 A	海通鑫逸 C	合计
海通证券	-	6,199.05	6,199.05
-	-	-	-
-	-	-	-
合计	-	6,199.05	6,199.05

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 0.4%。

C 类份额的销售服务费按前一日 C 类份额资产净值的 0.4% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：注：本集合计划本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本集合计划本报告期末与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本集合计划本报告期末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。

7.4.10.5 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	本期
	2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日	2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日
	海通鑫逸 A	海通鑫逸 C
基金合同生效日（2021年9月7日）持有的基金份额	8,655,560.00	-
报告期初持有的基金份额	8,655,560.00	-
报告期内申购/买入总份额	0.00	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	8,655,560.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.71%	-

注：本表报告期末持有的基金份额占总份额比例的计算中，A、C级比例分母为各自级别的份额。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本集合计划本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资及持有本基金份额。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2021年9月7日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
上海银行	21,358,328.02	10,254.12

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本集合计划均无其他关联交易事项的说明。

7.4.11 利润分配情况

注：本集合计划本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本集合计划本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本集合计划本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本集合计划本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本集合计划管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、合规与风险控制委员会、合规负责人、风控与稽核部和合规与法务部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本集合计划投资于一家上市公司发行的证券市值不超过集合计划资产净值的 10%，且本集合计划与由本集合计划管理人管理的其他全部公开募集性质的集合计划共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本集合计划在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；集合计划在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不在下表进行列示。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

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 2021年12月31日
AAA	5,914,848.70
AAA 以下	10,441,737.64
未评级	17,250,358.80
合计	33,606,945.14

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合计划份额持有人可随时要求赎回其持有的集合计划份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全流动性风险管理的内部控制体系，

审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理。

本集合计划的管理人采用监控组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本集合计划的申购赎回情况进行监控，保持投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本集合计划资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本集合计划的管理人在合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障持有人利益。

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

本集合计划本报告期末无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本集合计划的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 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,358,328.02	-	-	-	21,358,328.02

结算备付金	185,734.75	-	-	-	185,734.75
存出保证金	33,088.73	-	-	-	33,088.73
交易性金融资产	97,794,288.74	22,017,786.20	2,152,795.00	23,096,570.42	145,061,440.36
应收利息	-	-	-	1,816,104.01	1,816,104.01
应收申购款	-	-	-	610,100.92	610,100.92
资产总计	119,371,440.24	22,017,786.20	2,152,795.00	25,522,775.35	169,064,796.79
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	691,515.18	691,515.18
应付管理人报酬	-	-	-	54,598.57	54,598.57
应付托管费	-	-	-	3,899.89	3,899.89
应付证券清算款	-	-	-	17,141,649.77	17,141,649.77
应付销售服务费	-	-	-	3,889.27	3,889.27
应付交易费用	-	-	-	2,450.50	2,450.50
应付利息	-	-	-	-722.63	-722.63
应交税费	-	-	-	28,768.25	28,768.25
其他负债	-	-	-	129,126.21	129,126.21
负债总计	-	-	-	18,055,175.01	18,055,175.01
利率敏感度缺口	119,371,440.24	22,017,786.20	2,152,795.00	7,467,600.34	151,009,621.78

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
	利率曲线平行移动	
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（2021年12月31日）	
分析	市场利率上升 25 个基点	-297,167.27
	市场利率下降 25 个基点	303,381.67

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本集合计划主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，本集合计划的投资组合比例为：本集合计划债券资产的投资比例不低于计划资产的 80%，投资股票（含存托凭证）的比例不高于计划资产的 20%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的 0%-50%）；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，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不得低于计划资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本集合计划通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本集合计划的管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	23,096,570.42	15.29
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	23,096,570.42	15.29

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票价格以外的其他市场变量保持不变	
	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（2021 年 12 月 31 日）
分析	股票价格上升 5%	1,154,828.52

	股票价格下降 5%	-1,154,828.52
--	-----------	---------------

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 以公允价值计量的资产和负债下表列示了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。

于 2021 年 12 月 31 日，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工具中属于第一层次的余额为人民币 35,250,158.06

元，第二层次的余额为人民币 109,811,282.30 元，无属于第三层次的余额。

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本集合计划投资的证券交易所上市的证券，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时，本集合计划不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本集合计划综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本集合计划无非持续的以公允价值计量的金融工具。

(2) 其他金融工具的公允价值（非以公允价值计量的项目）

其他金融工具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之间无重大差异。

(3) 除以上事项外，截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	23,096,570.42	13.66
	其中：股票	23,096,570.42	13.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	121,964,869.94	72.14

	其中：债券	121,964,869.94	72.14
	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	-	-
	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	21,544,062.77	12.74
8	其他各项资产	2,459,293.66	1.45
9	合计	169,064,796.79	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	1,459,900.00	0.97
C	制造业	19,956,670.42	13.22
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	1,541,840.00	1.02
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	138,160.00	0.09
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	23,096,570.42	15.29

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本集合本报告期末未持有港股通股票。

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	600176	中国巨石	113,000	2,056,600.00	1.36
2	600031	三一重工	82,000	1,869,600.00	1.24
3	601615	明阳智能	65,000	1,696,500.00	1.12
4	000807	云铝股份	149,000	1,664,330.00	1.10
5	688188	柏楚电子	4,000	1,541,840.00	1.02
6	601766	中国中车	220,000	1,339,800.00	0.89
7	601388	怡球资源	285,000	1,268,250.00	0.84
8	600111	北方稀土	24,500	1,122,100.00	0.74
9	601225	陕西煤业	87,500	1,067,500.00	0.71
10	002353	杰瑞股份	26,000	1,040,000.00	0.69
11	601233	桐昆股份	35,000	741,300.00	0.49
12	002572	索菲亚	30,000	666,000.00	0.44
13	600438	通威股份	14,402	647,513.92	0.43
14	600426	华鲁恒升	20,000	626,000.00	0.41
15	000786	北新建材	17,100	612,693.00	0.41
16	603986	兆易创新	3,100	545,135.00	0.36
17	002129	中环股份	13,000	542,750.00	0.36
18	000977	浪潮信息	15,000	537,450.00	0.36
19	600409	三友化工	60,000	522,000.00	0.35
20	000651	格力电器	13,000	481,390.00	0.32
21	003012	东鹏控股	30,000	411,600.00	0.27
22	600256	广汇能源	60,000	392,400.00	0.26
23	603833	欧派家居	2,367	349,132.50	0.23
24	688002	睿创微纳	4,000	314,280.00	0.21
25	002460	赣锋锂业	2,000	285,700.00	0.19
26	600745	闻泰科技	2,000	258,600.00	0.17
27	600893	航发动力	4,000	253,840.00	0.17
28	002034	旺能环境	8,000	138,160.00	0.09
29	002371	北方华创	300	104,106.00	0.07

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600031	三一重工	2,285,573.00	1.51
2	600176	中国巨石	2,008,133.00	1.33
3	000807	云铝股份	1,701,452.00	1.13
4	002572	索菲亚	1,697,389.00	1.12
5	601615	明阳智能	1,696,352.00	1.12
6	000977	浪潮信息	1,680,246.00	1.11

7	601225	陕西煤业	1,607,067.00	1.06
8	603986	兆易创新	1,601,953.40	1.06
9	600893	航发动力	1,594,272.00	1.06
10	688188	柏楚电子	1,547,816.72	1.02
11	605123	派克新材	1,543,175.00	1.02
12	601766	中国中车	1,404,000.00	0.93
13	601388	怡球资源	1,327,350.00	0.88
14	600111	北方稀土	1,226,817.00	0.81
15	002241	歌尔股份	1,096,081.00	0.73
16	002353	杰瑞股份	1,044,493.00	0.69
17	600438	通威股份	997,977.36	0.66
18	601233	桐昆股份	981,364.00	0.65
19	003012	东鹏控股	938,623.00	0.62
20	000786	北新建材	927,763.00	0.61

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	605123	派克新材	2,072,101.51	1.37
2	600893	航发动力	1,475,903.00	0.98
3	002241	歌尔股份	1,349,620.00	0.89
4	000977	浪潮信息	1,322,412.00	0.88
5	002572	索菲亚	1,207,335.00	0.80
6	603986	兆易创新	1,119,709.40	0.74
7	300014	亿纬锂能	895,060.00	0.59
8	003012	东鹏控股	599,347.00	0.40
9	603833	欧派家居	592,739.00	0.39
10	601225	陕西煤业	515,340.00	0.34
11	300750	宁德时代	496,869.00	0.33
12	000786	北新建材	467,621.00	0.31
13	601919	中远海控	458,384.00	0.30
14	688363	华熙生物	417,678.79	0.28
15	600745	闻泰科技	396,576.00	0.26
16	600031	三一重工	394,560.00	0.26
17	002034	旺能环境	352,835.00	0.23
18	002959	小熊电器	346,057.00	0.23
19	002475	立讯精密	325,640.00	0.22
20	300760	迈瑞医疗	300,128.00	0.20

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	40,083,500.00
卖出股票收入（成交）总额	18,570,359.32

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	88,357,924.80	58.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	17,250,358.80	11.42
	其中：政策性金融债	17,250,358.80	11.42
4	企业债券	400,200.00	0.27
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	15,956,386.34	10.57
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	121,964,869.94	80.77

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	019654	21 国债 06	201,010	20,107,030.30	13.32
2	019649	21 国债 01	190,000	19,003,800.00	12.58
3	019658	21 国债 10	169,970	16,971,504.50	11.24
4	019628	20 国债 02	125,400	12,541,254.00	8.30
5	018008	国开 1802	89,550	9,154,696.50	6.06

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

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本集合计划本报告期末未持有贵金属。

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

注：本集合计划本报告期末未持有权证。

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

-

8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本集合计划本报告期末未持有国债期货。

8.10.3 本期国债期货投资评价

-

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

本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。本集合计划对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及产品合同的要求。

8.11.2 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

集合计划投资的前十名股票中，没有投资于超出集合计划合同规定备选股票库之外的情况。

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	33,088.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,816,104.01
5	应收申购款	610,100.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,459,293.66

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	132015	18 中油 EB	3,802,798.70	2.52
2	110077	洪城转债	1,606,127.40	1.06
3	128116	瑞达转债	1,603,287.40	1.06
4	110043	无锡转债	1,195,900.00	0.79
5	113044	大秦转债	1,094,400.00	0.72

6	110045	海澜转债	876,675.00	0.58
7	128128	齐翔转 2	870,255.00	0.58
8	113047	旗滨转债	681,800.00	0.45
9	113013	N 国君转	617,450.00	0.41
10	123035	利德转债	604,765.00	0.40
11	123114	三角转债	473,025.00	0.31
12	128070	智能转债	347,220.00	0.23
13	128133	奇正转债	266,324.20	0.18

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本集合计划本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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（%）
海通鑫逸 A	175	736,833.05	83,163,735.19	64.50	45,782,049.19	35.50
海通鑫逸 C	103	123,785.80	1,901,790.19	14.92	10,848,147.65	85.08
合计	278	509,696.84	85,065,525.38	60.03	56,630,196.84	39.97

注：本表机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、C 级比例分母为各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用集合计划份额的合计数（即期末集合计划份额总额）。

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	海通鑫逸 A	437,108.11	0.3390
	海通鑫逸 C	10,490.53	0.0823

有从业人员持有本基金			
	合计	447,598.64	0.3159

注：本表报告期末持有份额总数占总份额比例的计算中，A、C级比例分母为各自级别的份额。

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	海通鑫逸 A	10~50
	海通鑫逸 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	海通鑫逸 A	0~10
	海通鑫逸 C	0
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海通鑫逸 A	海通鑫逸 C
基金合同生效日 (2021年9月7日) 基金份额总额	45,476,843.75	-
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	136,293,122.51	14,141,770.40
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	52,824,181.88	1,391,832.56
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额（份额减少 以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份 额总额	128,945,784.38	12,749,937.84

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无集合计划份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2021年5月21日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司第四届第十七次董事会审议通过，张士军先生自2021年5月20日起不再担任公司副总经理兼投资总监。

2、2021年5月21日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司第四届第十七次董事会审议通过，李雪女士自2021年5月20日起不再担任公司首席风险官兼合规总监。

3、2021年7月30日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司第四届第十七次董事会审议通过，周陶女士自2021年7月28日起担任公司合规总监。

4、2021年10月26日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司第四届第二十三次董事会审议通过，陈颖女士自2021年10月25日起担任公司首席风险官。

5、2021年12月8日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司第四届第二十七次董事会审议通过，曾丽琼女士自2021年10月28日起担任公司总经理助理。

6、2021年12月27日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司第四届第二十七次董事会审议通过，张承启先生自2021年10月28日起担任公司总经理助理。

7. 本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

1. 因金融委托理财合同纠纷，四川信托有限公司向四川省成都市中级人民法院起诉，要求上海海通证券资产管理有限公司、海通证券股份有限公司等13个被告返还或赔偿原告委托财产51,455万元及相应利息。截止本报告披露日，该案尚未开庭审理。

2. 报告期内未发生涉及基金托管业务的重大诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本投资期内没有改变投资策略

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内集合计划管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本年度应支付的审计费用是9,000.00元，目前事务所已提供审计服务的连续年限是1年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1. 本报告期内，上海海通证券资产管理有限公司收到中国证券监督管理委员会上海证监局《关于对上海海通证券资产管理有限公司采取责令暂停部分业务措施的决定》，并对公司相关人员出具了监管措施。公司高度重视，按照法律法规相关要求梳理了相关业务流程，制定了整改措施，并抓紧落实整改工作。
2. 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	
海通证券	2	58,694,311.70	100.00%	7,244.50	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
海通证券	189,242,874.96	100.00%	10,200,000.00	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	海通赢家系列一半年鑫集合资产管理计划正式变更为海通鑫逸债券型集合资产管理计划及合同生效的公告	中国证券报及公司网站	2021年9月7日
2	海通鑫逸债券型集合资产管理计划开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	中国证券报及公司网站	2021年9月16日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金份额情况

别	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	1	2021/10/27-2021/12/01	0.00	38,349,952.06	38,349,952.06	0.00	0
机构	2	2021/12/22-2021/12/31	0.00	65,795,570.71	0.00	65,795,570.71	46.43
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>报告期内,本集合计划存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况,由此可能导致的特有风险主要包括:</p> <p>1、当集合计划份额持有人占比过于集中时,可能会因某单一集合计划份额持有人大额赎回而引发集合计划净值剧烈波动的风险;</p> <p>2、若某单一集合计划份额持有人巨额赎回有可能引发集合计划的流动性风险,集合计划管理人可能无法及时变现集合计划资产以应对集合计划份额持有人的赎回申请,集合计划份额持有人可能无法及时赎回持有的全部集合计划份额。</p> <p>3、若个别投资者大额赎回后,可能会导致集合计划资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险,集合计划可能会面临转换运作方式、与其他集合计划合并或者终止集合计划合同等情形。</p> <p>4、其他可能的风险。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,未发现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准海通赢家系列一半年鑫集合资产管理计划资产管理合同变更的文件
- (二) 海通鑫逸债券型集合资产管理计划资产管理合同
- (三) 海通鑫逸债券型集合资产管理计划托管协议
- (四) 法律意见书
- (五) 管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 业务规则
- (八) 中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所。

13.3 查阅方式

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

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

客户服务中心电话：95553

上海海通证券资产管理有限公司

2022年3月31日