

# 海通鑫逸债券型集合资产管理计划 2022 年第 2 季度报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：上海海通证券资产管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 7 月 21 日

## § 1 重要提示

集合计划管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

集合计划托管人上海银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 7 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期为 2022 年 4 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	354,728,088.06 份
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。本集合计划债券投资策略包括：（1）信用债投资策略；（2）可转债投资策略。其他投资策略包括：（1）资产支持证券投资策略；（2）现金资产投资策略；（3）股票投资策略；（4）港股通标的股票投资策略；（5）国债期货投资策略；（6）存托凭证投资策略；（7）其他策略。
业绩比较基准	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
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。	
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	
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	270,780,402.64 份	83,947,685.42 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日）	
	海通鑫逸 A	海通鑫逸 C
1. 本期已实现收益	-2,673,919.82	-857,234.80
2. 本期利润	9,485,725.09	2,677,557.20
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0311	0.0304
4. 期末基金资产净值	292,340,489.82	90,366,027.69
5. 期末基金份额净值	1.0796	1.0765

注：（1）所述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、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。

#### 3.2 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	净值增长率①	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	3.22%	0.37%	0.92%	0.14%	2.30%	0.23%
过去六个月	1.29%	0.33%	-0.52%	0.15%	1.81%	0.18%

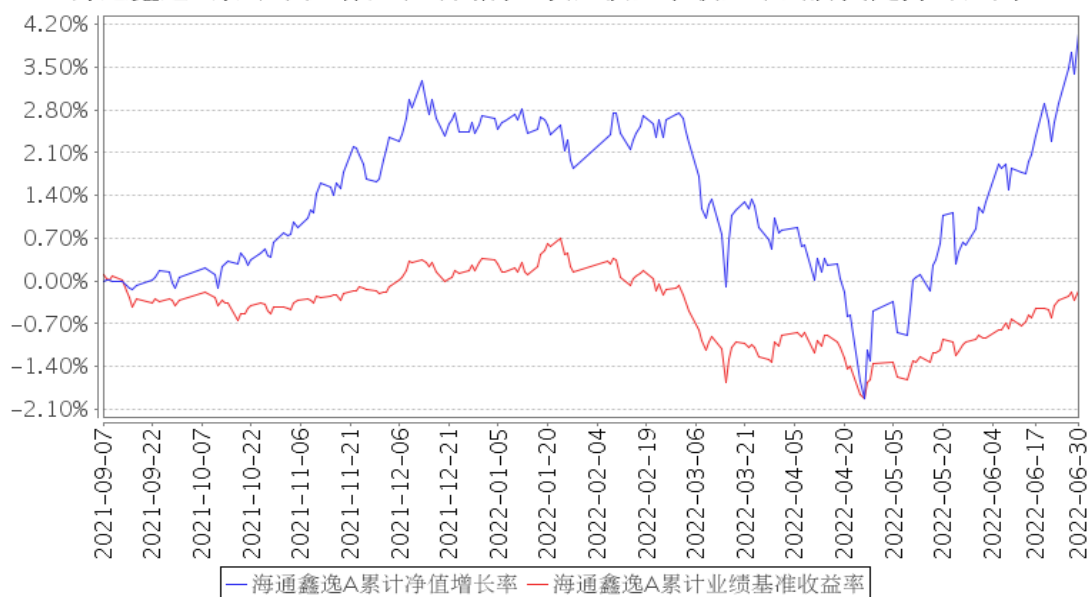
自基金合同 生效起至今	4.04%	0.28%	-0.16%	0.13%	4.20%	0.15%
----------------	-------	-------	--------	-------	-------	-------

## 海通鑫逸 C

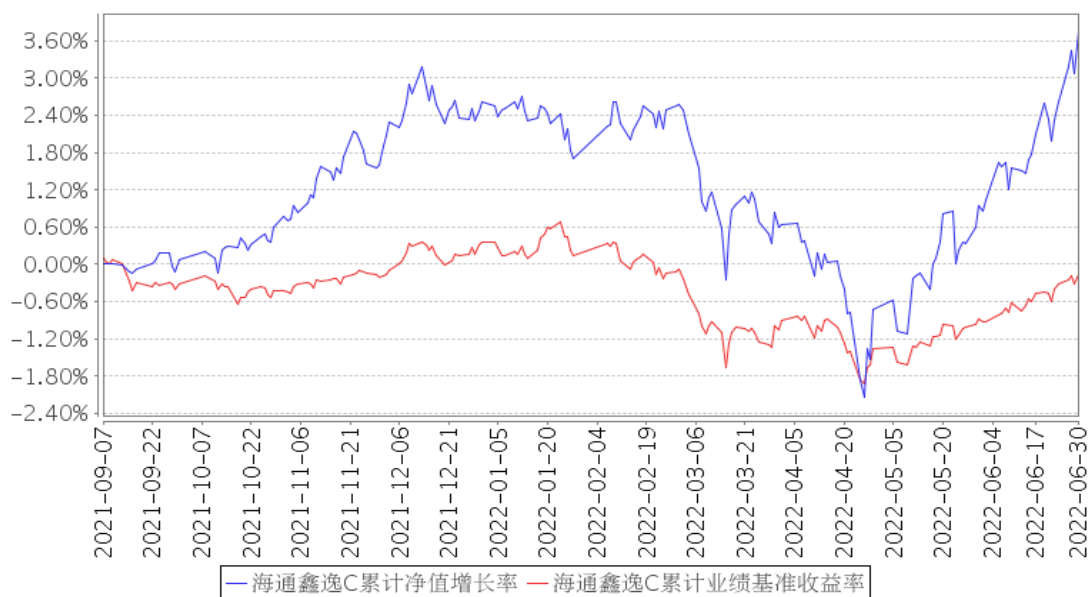
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.12%	0.37%	0.92%	0.14%	2.20%	0.23%
过去六个月	1.10%	0.33%	-0.52%	0.15%	1.62%	0.18%
自基金合同 生效起至今	3.74%	0.28%	-0.16%	0.13%	3.90%	0.15%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



### 3.3 其他指标

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李亦星	投资经理、公募固收部副总监	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。

#### 4.1.1 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

#### 4.2 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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关

规定，通过各项内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有投资组合，切实防范利益输送行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本集合计划进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度受到诸多内外因素影响，资本市场出现较大波动。国内贯穿整季度的因素是流动性合理充裕，债券收益率低位运行，特别是短端债券收益率持续下行。长端债券收益率呈现波动的走势，4月因宽信用政策持续出台的预期收益率上行调整、5月疫情持续发酵叠加金融数据不佳收益率重回下行、6月因疫情拐点出现海外加息和通胀高企的影响收益率再度回升。

权益市场，在深度调整后伴随着市场信心的恢复，市场出现V型反转，各大指数均反弹明显。特别是新能源车以及食品饮料板块表现亮眼。年初至今涨幅领先的稳增长板块，银行、房地产和建筑建材板块则反弹不明显。

策略坚持“多资产协同配置”的主策略：以宏观策略视角入手，自上而下地判断债券和股票性价比，确定债券和股票的投资比例。债券策略：本阶段选择以保守策略为主，结合流动性管理和少部分利率债交易策略构建一个高等级债券组合，给组合提供充裕的流动性，获取稳定的收益回报。

可转债和股票分策略：专注在“政策导向型景气赛道”和“利润稳定型低估品种”这两大领域精选个券。采用分散化投资的方式，控制单一行业和单一个股的占比，避免特定风险对组合产生巨大冲击。

#### 4.5 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1.0796元，C份额净值为1.0765元。本报告期集合计划上述两类份额净值增长率为3.22%和3.12%，业绩比较基准收益为0.92%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本集合计划本报告期无需要说明的情形。

## § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	69,121,726.87	17.10
	其中：股票	69,121,726.87	17.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	321,380,040.44	79.50
	其中：债券	321,380,040.44	79.50
	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	5,901,572.77	1.46
8	其他资产	7,827,307.53	1.94
9	合计	404,230,647.61	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,916,100.00	0.50
B	采矿业	1,679,400.00	0.44
C	制造业	50,471,956.87	13.19
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	1,444,590.00	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	1,789,200.00	0.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,833,600.00	1.52
J	金融业	1,681,480.00	0.44
K	房地产业	3,841,200.00	1.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	464,200.00	0.12
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	69,121,726.87	18.06
----	---------------	-------

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本集合计划本报告期末未持有港股通股票。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300122	智飞生物	48,000	5,328,480.00	1.39
2	002043	兔宝宝	400,000	4,640,000.00	1.21
3	601615	明阳智能	130,000	4,394,000.00	1.15
4	600048	保利发展	220,000	3,841,200.00	1.00
5	688018	乐鑫科技	31,000	3,484,400.00	0.91
6	000977	浪潮信息	115,000	3,045,200.00	0.80
7	000858	五粮液	13,500	2,726,055.00	0.71
8	603986	兆易创新	18,000	2,559,780.00	0.67
9	600887	伊利股份	63,000	2,453,850.00	0.64
10	002567	唐人神	280,000	2,382,800.00	0.62

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	158,988,016.01	41.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	76,220,804.22	19.92
	其中：政策性金融债	29,925,145.31	7.82
4	企业债券	10,776,205.48	2.82
5	企业短期融资券	12,182,330.96	3.18
6	中期票据	10,196,350.69	2.66
7	可转债（可交换债）	53,016,333.08	13.85
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	321,380,040.44	83.98

### 5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019666	22 国债 01	365,000	36,909,650.00	9.64
2	019641	20 国债 11	359,350	36,807,856.23	9.62
3	019658	21 国债 10	360,890	36,776,470.73	9.61
4	019664	21 国债 16	325,000	33,035,021.23	8.63
5	2028029	20 交通银行 01	150,000	15,560,646.58	4.07

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资



## 明细

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.9.1 本期国债期货投资政策

-

#### 5.9.2 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。

#### 5.9.3 本期国债期货投资评价

-

### 5.10 投资组合报告附注

#### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司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、国家外汇管理局上海市分局、中国人民银行的处罚，申万宏源证券有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会上海监管局的处罚，中国国际航空股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到北京市发展和改革委员会的处罚。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。

#### 5.10.2 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

报告期内，本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。

#### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	235,743.19

2	应收证券清算款	7,042,695.16
3	应收股利	101,677.17
4	应收利息	-
5	应收申购款	447,192.01
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,827,307.53

#### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111000	起帆转债	5,869,176.03	1.53
2	113039	嘉泽转债	5,586,641.10	1.46
3	113051	节能转债	5,379,316.44	1.41
4	113052	兴业转债	3,685,173.29	0.96
5	132015	18 中油 EB	3,533,211.93	0.92
6	113013	N 国君转	2,272,008.22	0.59
7	110043	无锡转债	1,886,581.92	0.49
8	128141	旺能转债	1,852,720.20	0.48
9	128116	瑞达转债	1,709,083.09	0.45
10	110045	海澜转债	1,637,356.85	0.43
11	128081	海亮转债	1,534,298.63	0.40
12	127042	嘉美转债	1,519,978.46	0.40
13	110077	洪城转债	1,519,683.79	0.40
14	128095	恩捷转债	1,515,617.47	0.40
15	113631	皖天转债	1,450,324.45	0.38
16	128048	张行转债	1,398,971.82	0.37
17	113044	大秦转债	1,090,626.03	0.28
18	113582	火炬转债	1,076,111.51	0.28
19	128135	洽洽转债	1,023,980.27	0.27
20	123035	利德转债	936,651.78	0.24
21	128133	奇正转债	644,338.10	0.17
22	127012	招路转债	571,106.85	0.15
23	113047	旗滨转债	554,843.84	0.14
24	127038	国微转债	502,179.04	0.13
25	123114	三角转债	432,852.05	0.11
26	128128	齐翔转 2	301,595.62	0.08
27	123064	万孚转债	244,550.14	0.06
28	128026	众兴转债	98,194.73	0.03

#### 5.10.5 报告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不存在流通受限情况。

### 5.10.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海通鑫逸 A	海通鑫逸 C
报告期期初基金份额总额	327,805,846.15	95,802,268.17
报告期期间基金总申购份额	367,085.52	415,721.75
减：报告期期间基金总赎回份额	57,392,529.03	12,270,304.50
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	270,780,402.64	83,947,685.42

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	海通鑫逸 A	海通鑫逸 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	8,655,560.00	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	8,655,560.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	3.20	-

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。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本集合计划的管理人未运用固有资金申赎及买卖本集合计划。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本集合计划报告期内无单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 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

### 9.2 存放地点

集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所。

### 9.3 查阅方式

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

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

客户服务中心电话:95553

上海海通证券资产管理有限公司

2022 年 7 月 21 日