

海通鑫逸债券型集合资产管理计划 2022 年中期报告

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

送出日期：2022 年 8 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。

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 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
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	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 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的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	41
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	41
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	41

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	41
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.11 投资组合报告附注	41
§ 8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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	44
§ 9 开放式基金份额变动	44
§ 10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	46
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

§ 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	354,728,088.06 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	270,780,402.64 份	83,947,685.42 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</p>

	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	吴文然	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.htsamc.com
基金中期报告备置地点	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
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(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	海通鑫逸 A	海通鑫逸 C
本期已实现收益	-868,263.15	-413,616.68
本期利润	3,348,489.70	579,786.34

加权平均基金份额本期利润	0.0113	0.0065
本期加权平均净值利润率	1.07%	0.62%
本期基金份额净值增长率	1.29%	1.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	10,663,980.73	4,592,650.06
期末可供分配基金份额利润	0.0394	0.0547
期末基金资产净值	292,340,489.82	90,366,027.69
期末基金份额净值	1.0796	1.0765
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	4.04%	3.74%

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。

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)。

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
过去一个月	2.79%	0.31%	0.73%	0.10%	2.06%	0.21%

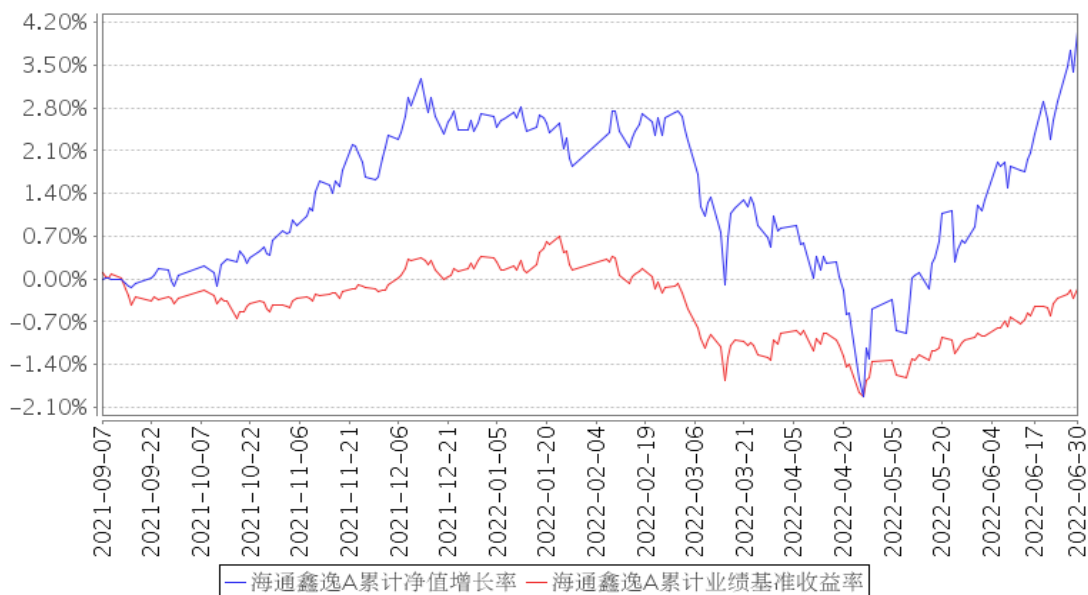
过去三个月	3.22%	0.37%	0.92%	0.14%	2.30%	0.23%
过去六个月	1.29%	0.33%	-0.52%	0.15%	1.81%	0.18%
自基金合同生效起至今	4.04%	0.28%	-0.16%	0.13%	4.20%	0.15%

海通鑫逸 C

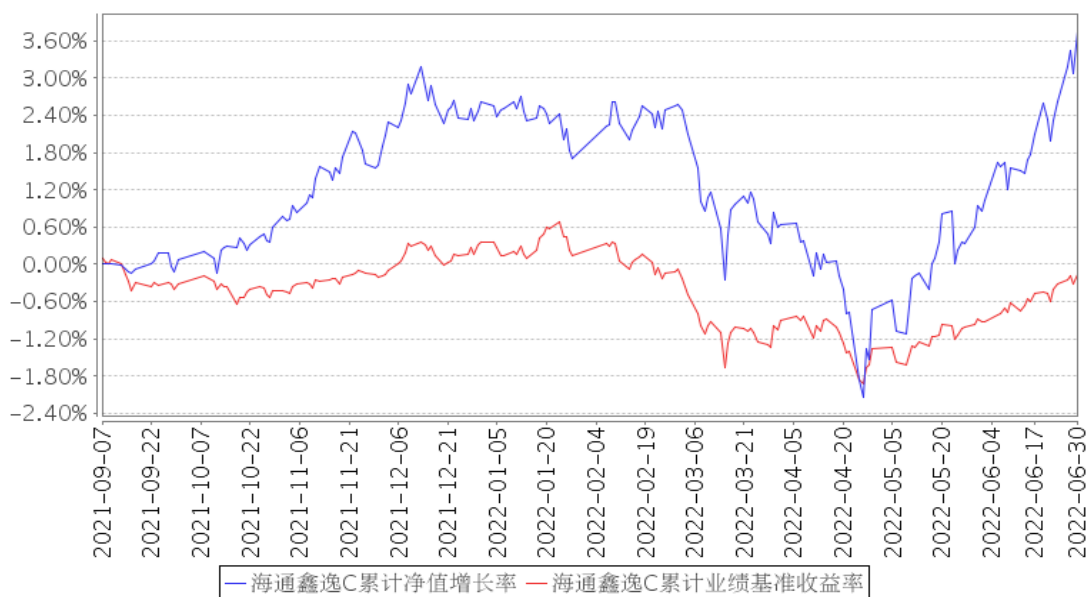
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.76%	0.32%	0.73%	0.10%	2.03%	0.22%
过去三个月	3.12%	0.37%	0.92%	0.14%	2.20%	0.23%
过去六个月	1.10%	0.33%	-0.52%	0.15%	1.62%	0.18%
自基金合同生效起至今	3.74%	0.28%	-0.16%	0.13%	3.90%	0.15%

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



§ 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 业务和创新业务等，覆盖传统权益、固收、量化、现金管理、另类投资、QDII 等全业务产品线。

截至 2022 年 6 月 30 日，本集合计划管理人共管理 15 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、公募固收部副总监	2021 年 9 月 7 日	-	11 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。

4.2 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

2022 年上半年,国内国外一系列不可抗力影响给中国经济的运行造成了较大的干扰。从外部因素看,全球经济受地缘政治事件的直接影响,面临能源和粮食供应短缺、价格波动。同时,叠加欧美前期实行量化宽松政策,货币超发,导致通胀在上半年越发严重。为应对供给和需求双重因素导致的复杂的通胀情况,欧美各国纷纷开启了加息进程,从而导致了经济景气度边际走弱,各项需求下滑,制造业 PMI 持续下降,全球衰退的预期走高。从国内因素看,在本轮经济复苏的中期,上半年面临着经济数据可持续性验证、增长动能切换和突发公共卫生事件的考验。面对挑战,政治局会议做出了面对复杂严峻的国际环境和艰巨繁重的国内改革发展稳定任务,全面落实疫情要防住、经济要稳住、发展要安全的要求,巩固经济回升向好趋势的重要指示。

债券市场,上半年机构的配置意愿旺盛,合理宽裕的市场流动性预期叠加短期经济数据的下滑使得债券的价值体现,整体来看,债券收益率在低位波动,短期限国债表现要强于长期国债。

权益市场,在全球经济下滑、突发事件不断的背景下表现较弱,指数深度调整至 4 月底之后随着国内公共卫生事件得到有效控制,市场信心恢复,经济新增长极逐步明确,指数也得到了修复。可以说资源品和地产为代表的稳增长板块在下跌中表现出了强势,指数反弹时新能源和汽车领域完成了动能切换。

报告期内,本基金债券保持了中性仓位,以利率债券和 AAA 评级信用债为主要持仓品种,整体持仓久期较短。择机进行了久期波段操作。股票方面,仓位中等偏高,通过行业的均衡和分散来控制整体股票仓位的风险收益。通过不同时期市场特征调整持仓结构,完成对投资策略的执行。

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 1.0796 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 1.29%和 1.10%，业绩比较基准收益为负 0.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金最重要的任务是构建、优化明确的投资策略，并且不断重复、准确地执行投资计划。通过不断提升投资策略的胜率，追求在长期投资中使“大数定律”体现，逐步积累收益。实现真正财富积累的关键是“时间”，而非“时机”。过分强调“预测”并非投资的关键，能够及时、准确地“识别”就足够让复利不断积累。本基金基于这个投资理念，致力投资于业绩及盈利能力良好且主营业务可预期的企业。

展望下半年，可以识别到一些投资机会。由于上半年市场波动剧烈，内外部不利因素叠加给国内经济运行带来了巨大的压力，与此同时，也催生了变革的来临。这半年可以比较明显地体会到经济动能的更新换代，也就是新基建对老基建的替代。以风电、光伏、新能源车为代表的新基建为经济复苏中后期的持续性注入了新的增长信心。国内新能源企业依靠自研技术的不断精进，跻身全球领先地位，同时国内巨大的市场需求潜力，使得新能源企业的估值受到市场的认可。另外，消费领域受景气度下滑影响估值已经调整至相对合理的区间，如三季度利润可以保持稳定的话，下半年也将具备一定的配置价值。

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》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

- 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。

4.8 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：海通鑫逸债券型集合资产管理计划

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,917,498.61	21,358,328.02
结算备付金		984,074.16	185,734.75
存出保证金		235,743.19	33,088.73
交易性金融资产	6.4.7.2	390,501,767.31	145,061,440.36
其中：股票投资		69,121,726.87	23,096,570.42
基金投资		-	-
债券投资		321,380,040.44	121,964,869.94
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		7,042,695.16	-
应收股利		101,677.17	-
应收申购款		447,192.01	610,100.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	1,816,104.01
资产总计		404,230,647.61	169,064,796.79
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		18,500,955.43	-
应付清算款		1,679,466.24	17,141,649.77
应付赎回款		983,875.17	691,515.18
应付管理人报酬		232,098.29	54,598.57
应付托管费		16,578.46	3,899.89
应付销售服务费		29,526.03	3,889.27
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,694.82	28,768.25
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	71,935.66	130,854.08
负债合计		21,524,130.10	18,055,175.01
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	354,728,088.06	141,695,722.22
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	27,978,429.45	9,313,899.56
净资产合计		382,706,517.51	151,009,621.78
负债和净资产总计		404,230,647.61	169,064,796.79

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，本集合计划份额总额 354,728,088.06 份，其中 A 类计划份额净值 1.0796 元，份额总额 270,780,402.64 份；C 类计划份额净值 1.0765 元，份额总额 83,947,685.42 份。

6.2 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		5,794,797.10
1. 利息收入		106,054.58
其中：存款利息收入	6.4.7.13	50,124.09
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		55,930.49
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		436,336.33
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-4,784,133.79
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	4,166,260.51
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	1,054,209.61
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	5,210,155.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	42,250.32
减：二、营业总支出		1,866,521.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,402,316.33
2. 托管费	6.4.10.2.2	100,165.51
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	184,606.28
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-
5. 利息支出		88,808.42
其中：卖出回购金融资产支出		88,808.42
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		7,287.49
8. 其他费用	6.4.7.23	83,337.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,928,276.04
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,928,276.04
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		3,928,276.04

注：本集合计划合同生效日为 2021 年 9 月 7 日，无上年度同期对比数据。

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	141,695,722.22	-	9,313,899.56	151,009,621.78
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	141,695,722.22	-	9,313,899.56	151,009,621.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	213,032,365.84	-	18,664,529.89	231,696,895.73
(一)、综合收益总额	-	-	3,928,276.04	3,928,276.04
(二)、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)	213,032,365.84	-	14,736,253.85	227,768,619.69
其中：1. 基金申	318,878,519.65	-	20,229,774.59	339,108,294.24

购款				
2. 基金赎回款	-105,846,153.81	-	-5,493,520.74	-111,339,674.55
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	354,728,088.06	-	27,978,429.45	382,706,517.51

注：本集合计划合同生效日为 2021 年 9 月 7 日，无上年度同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告至-财务报表由下列负责人签署：

李井伟

陈颖

刘雯

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

海通鑫逸债券型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)是由海通赢家系列一半年鑫集合资产管理计划转型而来。海通鑫逸债券型集合资产管理计划的管理人上海海通证券资产管理有限公司 2021 年 9 月 7 日发布《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》。根据公告，海通赢家系列一半年鑫集合资产管理计划名称变更为“海通鑫逸债券型集合资产管理计划”，海通赢家系列一半年鑫集合资产管理计划份额

转换为海通鑫逸债券型集合资产管理计划份额。合同变更后，本集合计划的托管人、登记机构不变。自 2021 年 9 月 7 日起《海通鑫逸债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《海通鑫逸债券型集合资产管理计划托管协议》生效。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 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(以下简称“海通证券”)，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《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×85%+沪深 300 指数收益率×10%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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》和在财务报表附注 6.4.4 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。

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 2022 年上半年度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 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年上半年度的经营成果和净资产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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本集合计划报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《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》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 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〈年度报告和中期报告〉》，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 2022 年度财务报表，对本集合计划财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本集合计划对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本集合计划均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为 21,358,328.02 元、185,734.75 元、33,088.73 元、1,816,104.01 元和 610,100.92 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 21,361,530.27 元、185,826.71 元、

33,105.01 元、0.00 元和 610,100.92 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 145,061,440.36 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 146,874,233.88 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付赎回款、应付赎回费、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 0.00 元、17,141,649.77 元、691,515.18 元、126.21 元、54,598.57 元、3,899.89 元、3,889.27 元、2,450.50 元、-722.63 元和 129,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为-722.63 元、17,141,649.77 元、691,515.18 元、54,598.57 元、3,899.89 元、3,889.27 元、2,450.50 元、0.00 元和 129,126.21 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本集合计划持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本集合计划根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本集合计划的管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本集合计划财务报表产生重大影响。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局

证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 基金卖出股票按0.1%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。

(4) 本集合计划的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
活期存款	4,917,498.61
等于：本金	4,916,006.10
加：应计利息	1,492.51
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	4,917,498.61

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	65,410,540.48	-	69,121,726.87	3,711,186.39	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	257,066,484.24	3,947,666.70	262,966,791.66	1,952,640.72
	银行间市场	57,395,975.00	1,032,148.78	58,413,248.78	-14,875.00
	合计	314,462,459.24	4,979,815.48	321,380,040.44	1,937,765.72
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	379,872,999.72	4,979,815.48	390,501,767.31	5,648,952.11	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本集合计划本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本集合计划本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

6.4.7.8 其他资产

注：本集合计划本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	7,964.83
其中：交易所市场	7,134.83
银行间市场	830.00
应付利息	-
预提费用	63,970.83
合计	71,935.66

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

海通鑫逸 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	128,945,784.38	128,945,784.38
本期申购	218,133,585.16	218,133,585.16
本期赎回（以“-”号填列）	-76,298,966.90	-76,298,966.90
基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	270,780,402.64	270,780,402.64

海通鑫逸 C

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,749,937.84	12,749,937.84
本期申购	100,744,934.49	100,744,934.49
本期赎回（以“-”号填列）	-29,547,186.91	-29,547,186.91
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	83,947,685.42	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）。

6.4.7.11 其他综合收益

6.4.7.12 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
本期期初	5,401,493.86	3,086,189.73	8,487,683.59
本期利润	-868,263.15	4,216,752.85	3,348,489.70
本期基金份额交易产生的变动数	6,130,750.02	3,593,163.87	9,723,913.89
其中：基金申购款	9,418,914.89	4,440,637.95	13,859,552.84
基金赎回款	-3,288,164.87	-847,474.08	-4,135,638.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,663,980.73	10,896,106.45	21,560,087.18

海通鑫逸 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	755,813.66	70,402.31	826,215.97
本期利润	-413,616.68	993,403.02	579,786.34
本期基金份额交易产生的变动数	4,250,453.08	761,886.88	5,012,339.96
其中：基金申购款	6,064,442.21	305,779.54	6,370,221.75
基金赎回款	-1,813,989.13	456,107.34	-1,357,881.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,592,650.06	1,825,692.21	6,418,342.27

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	42,564.04
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	6,712.03
其他	848.02
合计	50,124.09

注：其他包括结算保证金利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	112,675,862.70
减：卖出股票成本总额	117,285,487.39
减：交易费用	174,509.10
买卖股票差价收入	-4,784,133.79

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,929,607.68
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	236,652.83
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	4,166,260.51

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	188,516,146.65

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	184,933,875.99
减：应计利息总额	3,341,029.00
减：交易费用	4,588.83
买卖债券差价收入	236,652.83

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 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。

6.4.7.18.2 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。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,054,209.61
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,054,209.61

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	5,202,869.91
股票投资	3,476,168.91
债券投资	1,726,701.00
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	-7,285.96
合计	5,210,155.87

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	42,250.32
合计	42,250.32

6.4.7.22 信用减值损失

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	4,463.46
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	764.58
账户维护费	18,600.00
证券组合费	1.62
合计	83,337.03

6.4.7.24 分部报告

本集合计划本报告期无分部报告。

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，本集合计划并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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
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

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。本集合计划合同生效日为 2021 年 9 月 7 日，无上年度同期对比数据。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
海通证券	272,548,062.67	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
海通证券	327,635,139.59	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
海通证券	475,100,000.00	100.00

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6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 (%)
海通证券	34,533.75	100.00	7,134.83	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 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,402,316.33
其中：支付销售机构的客户维护费	402.52

注：1. 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。

2. 实际支付销售机构的客户维护费以本集合计划管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	100,165.51

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。

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 2022年1月1日至2022年6月30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	-	184,429.69	184,429.69
海通资管	-	3.24	3.24
合计	-	184,432.93	184,432.93

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。

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

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。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	本期 2022年1月1日至2022年6 月30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	0.00
报告期初持有的基金份额	8,655,560.00	0.00
报告期内申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期内因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	8,655,560.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.2000%	0.0000%

注：本表报告期末持有的集合计划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。

6.4.10.5.2 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：本报告期末有除管理人之外其他关联方投资本集合计划的情况。

6.4.10.6 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
上海银行	4,917,498.61	42,564.04

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况

注：本集合计划本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022 年 6 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

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。

6.4.12.2 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。

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

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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 18,500,955.43 元，其中人民币 13,000,000.00 元于 2022 年 7 月 1 日到期、人民币 500,072.20 元于 2022 年 7 月 5 日到期、人民币 5,000,883.23 元于 2022 年 7 月 11 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。

6.4.12.4 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。

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。

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，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	12,182,330.96	-
合计	12,182,330.96	-

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.2.3 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。

6.4.13.2.4 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	上年度末
	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
AAA	73,324,807.15	5,914,848.70
AAA 以下	41,864,206.76	10,441,737.64
未评级	5,095,534.25	17,250,358.80
合计	120,284,548.16	33,606,945.14

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.5 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。

6.4.13.2.6 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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理。

本集合计划的管理人采用监控基金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、基金组合资产中 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 6.4.12 中列示的部分基金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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金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。

本基金的基金管理人定期对本基金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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,917,498.61	-	-	-	4,917,498.61
结算备付金	984,074.16	-	-	-	984,074.16
存出保证金	235,743.19	-	-	-	235,743.19
交易性金融资产	249,605,406.08	71,774,634.36	-	69,121,726.87	390,501,767.31
应收股利	-	-	-	101,677.17	101,677.17
应收申购款	-	-	-	447,192.01	447,192.01

应收清算款	-	-	-	7,042,695.16	7,042,695.16
资产总计	255,742,722.04	71,774,634.36	-	76,713,291.21	404,230,647.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	983,875.17	983,875.17
应付管理人报酬	-	-	-	232,098.29	232,098.29
应付托管费	-	-	-	16,578.46	16,578.46
应付清算款	-	-	-	1,679,466.24	1,679,466.24
卖出回购金融资产款	18,500,955.43	-	-	-	18,500,955.43
应付销售服务费	-	-	-	29,526.03	29,526.03
应交税费	-	-	-	9,694.82	9,694.82
其他负债	-	-	-	71,935.66	71,935.66
负债总计	18,500,955.43	-	-	3,023,174.67	21,524,130.10
利率敏感度缺口	237,241,766.61	71,774,634.36	-	73,690,116.54	382,706,517.51
上年度末 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
应收申购款	-	-	-	610,100.92	610,100.92
其他资产	-	-	-	1,816,104.01	1,816,104.01
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
应交税费	-	-	-	28,768.25	28,768.25
其他负债	-	-	-	130,854.08	130,854.08
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：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金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。

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		
	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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月	

			31 日)
分析	市场利率上升 25 个基点	-812,948.29	-297,167.13
	市场利率下降 25 个基点	821,526.67	303,381.53

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。

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，本集合计划各类资产的投资比例范围为：投资于债券资产的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，集合计划保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%，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。

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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	69,121,726.87	18.06	23,096,570.42	15.29
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	69,121,726.87	18.06	23,096,570.42	15.29

6.4.13.4.3.2 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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	股票价格上升 5%	3,456,086.34	1,154,828.52
	股票价格下降 5%	-3,456,086.34	-1,154,828.52

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	118,604,848.02	35,250,158.06
第二层次	271,896,919.29	109,811,282.30
第三层次	-	-
合计	390,501,767.31	145,061,440.36

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 06 月 30 日，本集合计划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

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。

§ 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	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	其他各项资产	7,827,307.53	1.94
9	合计	404,230,647.61	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 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	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

7.2.2 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。

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

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	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
11	000960	锡业股份	130,200	2,183,454.00	0.57
12	000333	美的集团	33,000	1,992,870.00	0.52
13	300498	温氏股份	90,000	1,916,100.00	0.50
14	603517	绝味食品	32,000	1,850,240.00	0.48
15	300482	万孚生物	44,000	1,791,240.00	0.47
16	600004	白云机场	120,000	1,789,200.00	0.47
17	600585	海螺水泥	50,000	1,764,000.00	0.46
18	300059	东方财富	66,200	1,681,480.00	0.44
19	601899	紫金矿业	180,000	1,679,400.00	0.44
20	002727	一心堂	63,000	1,444,590.00	0.38
21	600519	贵州茅台	700	1,431,500.00	0.37

22	600183	生益科技	80,000	1,359,200.00	0.36
23	688059	华锐精密	8,000	1,103,840.00	0.29
24	688188	柏楚电子	5,000	1,100,200.00	0.29
25	600176	中国巨石	58,000	1,009,780.00	0.26
26	603799	华友钴业	10,000	956,200.00	0.25
27	600031	三一重工	50,000	953,000.00	0.25
28	600332	白云山	30,000	947,700.00	0.25
29	688696	极米科技	3,001	923,917.87	0.24
30	300601	康泰生物	20,000	903,600.00	0.24
31	300171	东富龙	26,000	881,660.00	0.23
32	002230	科大讯飞	20,000	824,400.00	0.22
33	600600	青岛啤酒	7,000	727,440.00	0.19
34	600702	舍得酒业	3,000	611,970.00	0.16
35	688388	嘉元科技	7,000	594,090.00	0.16
36	603501	韦尔股份	3,000	519,090.00	0.14
37	300012	华测检测	20,000	464,200.00	0.12
38	003012	东鹏控股	50,000	437,000.00	0.11
39	002555	三七互娱	20,000	424,600.00	0.11

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300122	智飞生物	8,936,194.00	5.92
2	603501	韦尔股份	7,012,699.00	4.64
3	000977	浪潮信息	5,529,889.18	3.66
4	601899	紫金矿业	4,844,838.00	3.21
5	688388	嘉元科技	4,600,223.45	3.05
6	002230	科大讯飞	3,985,402.06	2.64
7	002043	兔宝宝	3,792,085.00	2.51
8	600887	伊利股份	3,714,430.00	2.46
9	603799	华友钴业	3,696,950.00	2.45
10	603986	兆易创新	3,665,517.00	2.43
11	600048	保利发展	3,653,884.00	2.42
12	688696	极米科技	3,650,067.19	2.42
13	600372	中航电子	3,554,346.00	2.35
14	688012	中微公司	3,457,565.52	2.29
15	688018	乐鑫科技	3,425,363.97	2.27
16	601615	明阳智能	3,411,666.79	2.26
17	002567	唐人神	3,286,250.00	2.18
18	603517	绝味食品	3,273,913.00	2.17
19	600323	瀚蓝环境	3,260,417.00	2.16

20	600332	白云山	3,222,340.00	2.13
21	600438	通威股份	3,151,363.00	2.09
22	600183	生益科技	3,142,677.00	2.08
23	300012	华测检测	3,110,471.00	2.06

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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300122	智飞生物	4,778,276.00	3.16
2	603501	韦尔股份	4,734,530.68	3.14
3	600438	通威股份	4,693,678.18	3.11
4	600111	北方稀土	3,925,926.50	2.60
5	603799	华友钴业	3,855,314.00	2.55
6	601388	怡球资源	3,727,344.00	2.47
7	600372	中航电子	3,696,311.30	2.45
8	688012	中微公司	3,306,894.21	2.19
9	601899	紫金矿业	3,151,846.00	2.09
10	600323	瀚蓝环境	3,090,744.98	2.05
11	300957	贝泰妮	2,964,747.00	1.96
12	688388	嘉元科技	2,905,433.04	1.92
13	300012	华测检测	2,902,356.00	1.92
14	600176	中国巨石	2,592,953.81	1.72
15	002230	科大讯飞	2,485,018.00	1.65
16	00586	海螺创业	2,470,389.30	1.64
17	000977	浪潮信息	2,465,692.00	1.63
18	600332	白云山	2,407,865.00	1.59
19	002129	TCL 中环	2,368,976.00	1.57
20	002353	杰瑞股份	2,283,150.00	1.51

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。

7.4.3 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	159,834,474.93
卖出股票收入（成交）总额	112,713,587.74

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。

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	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

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	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

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

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：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

注：本集合计划本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

-

7.10.2 本期国债期货投资评价

-

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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，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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	235,743.19
2	应收清算款	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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,827,307.53

7.11.4 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	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

7.11.5 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。

7.11.6 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。

§ 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 (%)
海通鑫逸 A	353	767,083.29	186,434,243.94	68.85	84,346,158.70	31.15
海通鑫逸 C	143	587,046.75	64,412,010.05	76.73	19,535,675.37	23.27
合计	496	715,177.60	250,846,253.99	70.72	103,881,834.07	29.28

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）。

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	海通鑫逸 A	316,041.60	0.1167
	海通鑫逸 C	8,276.16	0.0099
	合计	324,317.76	0.0914

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	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

§9 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	-
本报告期期初基金份额总额	128,945,784.38	12,749,937.84
本报告期基金总申购份额	218,133,585.16	100,744,934.49
减：本报告期基金总赎回份额	76,298,966.90	29,547,186.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本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）。

§10 重大事件揭示

10.1 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。

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

1、2022 年 3 月 11 日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司第四届第三十四次董事会审议通过，周陶女士自 2022 年 3 月 10 日起不再担任公司合规总监，由总经理李井伟先生代任公司合规总监。

2、2022 年 5 月 20 日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司第四届第三十四

次董事会审议通过，吴文然女士自 2022 年 5 月 18 日起担任公司合规总监。

3、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门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

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。

10.4 基金投资策略的改变

本投资期内没有改变投资策略

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为了促进会计师事务所提供更优质的服务，2022 年 6 月 30 日本集合计划会计师事务所由立信会计师事务所（特殊普通合伙）变更为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。本次变更事项已履行上海海通证券资产管理有限公司董事会适当程序，并已按照相关规定及集合资产管理计划资产管理合同约定通知集合资产管理计划托管人。

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，集合计划管理人、集合计划托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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 (%)	
海通证券	2	272,548,062.67	100.00	34,533.75	100.00	-

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	
	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	327,635,139.59	100.00	475,100,000.00	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	上海海通证券资产管理有限公司旗下 参公集合资产管理计划转换业务规则 说明	规定披露媒介	2022 年 3 月 30 日
2	上海海通证券资产管理有限公司关于 开通旗下部分集合资产管理计划转换 业务及费率优惠活动的公告	规定披露媒介	2022 年 3 月 30 日
3	上海海通证券资产管理有限公司关于 高级管理人员变更公告	规定披露媒介	2022 年 5 月 20 日

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2022/1/1-2022/1/19	65,795,570.71	-	-	65,795,570.71	18.5400

产品特有风险

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: 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; 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。 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。 4、其他可能的风险。

11.2 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 存放地点

集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所。

12.3 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8月31日