

# 海通海升六个月持有期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：中国农业银行股份有限公司

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。

集合计划托管人中国农业银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 8 月 26 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

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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 .....	7
2.5 其他相关资料 .....	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	19
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	40
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 .....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	41
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 .....	42
7.11 投资组合报告附注 .....	42
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>43</b>
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 .....	44
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
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>44</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	46
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>47</b>
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 .....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	47
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>47</b>
12.1 备查文件目录 .....	47
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	海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划	
基金简称	海通海升六个月持有	
基金主代码	850003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 1 月 14 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	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,531,904,218.55 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海通海升六个月持有 A	海通海升六个月持有 C
下属分级基金的交易代码	850003	855001
报告期末下属分级基金的份额总额	1,124,819,171.81 份	407,085,046.74 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制和分散投资组合风险的前提下，实现集合计划资产长期稳定增值。
投资策略	<p>1、久期管理策略</p> <p>在全球经济的框架下，管理人对宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化做出判断，密切跟踪 CPI、PPI、汇率、M2 等利率敏感指标，运用数量化工具，对未来市场利率趋势进行分析与预测，并据此确定合理的债券组合目标久期，通过合理的久期控制实现对利率风险的有效管理。</p> <p>2、类属配置策略</p> <p>类属配置主要包括资产类别选择、各类资产的适当组合以及对资产组合的管理。本集合计划通过情景分析和历史预测相结合的方法，“自上而下”在债券一级市场和二级市场，银行间市场和交易所市场，银行存款、信用债、政府债券等资产类别之间进行类属配置，进而确定具有最优风险收益特征的资产组合。</p> <p>3、期限结构配置策略</p> <p>本集合计划对同一类属收益率曲线形态和期限结构变动进行分析，在给定组合久期以及其他组合约束条件的情形下，确定最优的期限结构。本集合计划期限结构调整的配置方式包括子弹策略、哑铃策略和梯形策略。</p> <p>4、信用债券投资策略</p> <p>信用债券的信用利差与债券发行人所在行业特征和自身情况密切相关。本集合计划将通过行业分析、公司资产负债分析、公司现金流分析、公司运营管理分析等调查研究，分析违约风险即合理的信用</p>

	<p>利差水平，对信用债券进行独立、客观的价值评估。本集合计划依靠内部信用评级体系跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估，以此作为个券选择的基本依据。</p> <p>5、可转换债券投资策略</p> <p>本集合计划将结合可转换债券的条款，根据其标的股票股价的波动率水平、分红率、市场的基准利率、可转换债券的剩余期限、当前股价水平等因素，运用 BS 模型以及蒙特卡洛模型等，计算期权价值，从而确定可转换债券的理论价值。本计划将理论价值作为可转换债券投资价值的参考，并与市场真实价格进行比较。如果理论价值显著高于当前价格，说明该可转换债券可能被低估，如果理论价值显著低于当前价格，显示该可转换债券可能被高估。本计划将持续跟踪可转换债券市场的供求变化、流动性以及估值溢价水平，判断转股溢价率和纯债溢价率，从而挑选出具有投资价值的可转换债券。同时，在控制风险的基础上，运用转股策略、条款博弈策略、套利策略等进行投资，获取收益。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>本集合计划投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和资产管理合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>7、国债期货投资策略</p> <p>国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证集合计划资产安全的基础上，力求实现所资产的长期稳定增值。</p>
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率×90%+1 年期定期存款利率（税后）×10%
风险收益特征	本集合计划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。

## 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴文然	秦一楠
	联系电话	021-23154762	010-66060069
	电子邮箱	htam@htsec.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95553、4008888001	95599
传真		021-63410460	010-63201816
注册地址		上海市广东路 689 号海通证券大厦 32 楼	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市广东路 689 号海通证券大	北京市西城区复兴门内大街 28

	厦 32 楼	号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	200001	100031
法定代表人	裴长江	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.htsamc.com">http://www.htsamc.com</a>
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)	
	海通海升六个月持有 A	海通海升六个月持有 C
本期已实现收益	14,165,973.92	4,073,450.09
本期利润	15,687,376.67	4,409,508.56
加权平均基金份额本期利润	0.0141	0.0115
本期加权平均净值利润率	1.23%	1.00%
本期基金份额净值增长率	1.18%	1.04%
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	62,882,611.52
	期末可供分配基金份额利润	0.1545
	期末基金资产净值	470,050,338.63
期末基金份额净值	1.1547	1.1547

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	4.56%	4.13%

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

海通海升六个月持有 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.37%	0.06%	0.01%	0.02%	0.36%	0.04%
过去三个月	1.53%	0.08%	0.98%	0.03%	0.55%	0.05%
过去六个月	1.18%	0.09%	1.72%	0.05%	-0.54%	0.04%
过去一年	4.75%	0.09%	4.44%	0.05%	0.31%	0.04%
自基金合同生效起至今	4.56%	0.09%	6.11%	0.04%	-1.55%	0.05%

海通海升六个月持有 C

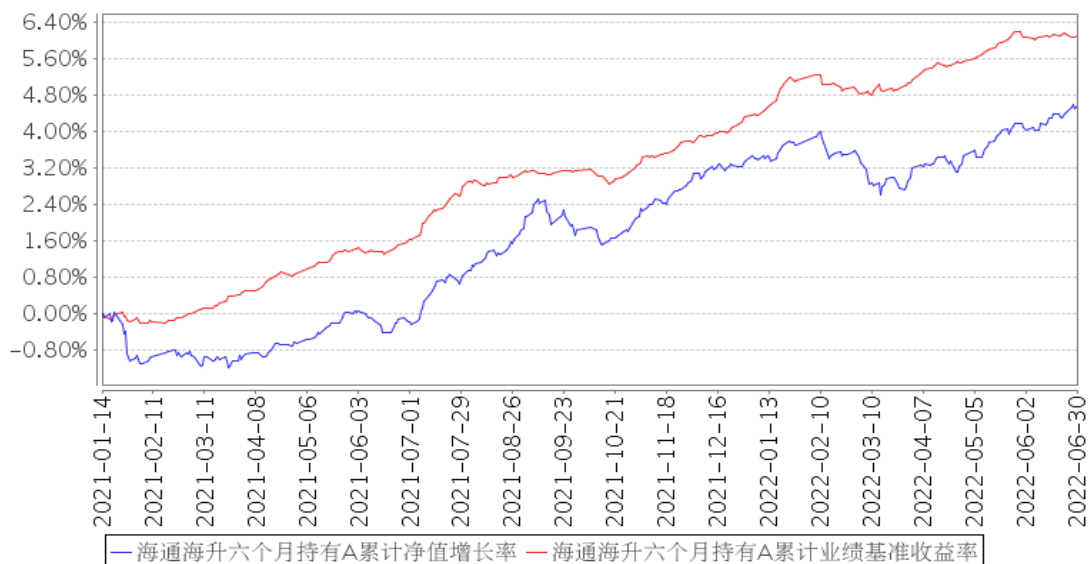
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.35%	0.07%	0.01%	0.02%	0.34%	0.05%



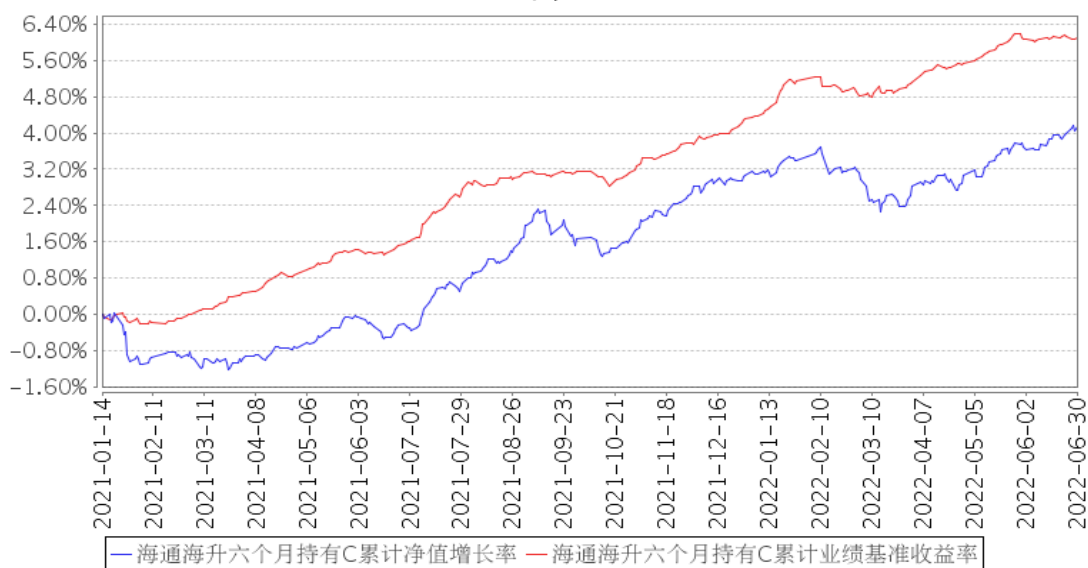
过去三个月	1.47%	0.08%	0.98%	0.03%	0.49%	0.05%
过去六个月	1.04%	0.09%	1.72%	0.05%	-0.68%	0.04%
过去一年	4.44%	0.09%	4.44%	0.05%	0.00%	0.04%
自基金合同生效起至今	4.13%	0.09%	6.11%	0.04%	-1.98%	0.05%

### 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

海通海升六个月持有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



海通海升六个月持有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		
邱博文	投资经理	2021 年 4 月 19 日	-	7 年	邱博文先生，CFA，美国宾夕法尼亚大学硕士。曾任国开证券固定收益部投资经理，2018 年 6 月加入海通资管。现任上海海通证券资产管理有限公司公募固收部基金经理。

### 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

海通海升六个月的投资策略以利率债和信用债为主,可转债为辅,信用债以中高等级为主,阶段性配置不同期限的利率债品种,可转债仓位保持相对灵活。

2022 年上半年,中国经济经历了三重叠加的负面影响。首先,2021 年底中国经济正面临传统经济周期的下行压力,分别是以制造业为代表的库存下行周期,和以房地产为代表的中期金融下行周期。其次,俄乌冲突的爆发对全球的需求端、生产供应链和大宗原材料产生了短期难以量化的扰动。再者,3 月中旬奥密克戎疫情在国内传播,带来了需求和供给端的进一步双降,特别是以贸易物流和制造业为代表的工企业普遍遇到了一定的冲击。这一历史级别的三重叠加对国内 A 股和可转债市场造成了较大幅度的冲击,对债券市场业构成了阶段性扰动。海通海升六个月在 2022 年初调低了可转债仓位,并较好的把握住了 2 季度的债市行情。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本计划 A 份额净值为 1.1595 元,C 份额净值为 1.1547 元。本报告集合计划上述两类份额净值增长率为 1.18%和 1.04%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为,2022 年上半年金融场所遇到的不利因素,放在长期历史中是较为极端的,尽管俄乌冲突和美联储加息等外围扰动并未完全结束,但以我为主的中国经济体已处于慢起步、缓修复的过程中,我们大概率可以期待在 2022 年下半年,数据转强、经济转好、通胀不高、政策仍然宽松的组合状态。

#### 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

在托管本集合计划的过程中，本集合计划托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及集合计划合同、托管协议的约定，对本集合计划管理人—上海海通证券资产管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日集合计划的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害集合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

本托管人认为，上海海通证券资产管理有限公司在本集合计划的投资运作、集合计划资产净值的计算、集合份额申购赎回价格的计算、费用开支及利润分配等问题上，不存在损害集合计划份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照集合计划合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，上海海通证券资产管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，集合管理人所编制和披露的本集合中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害集合计划持有人利益的行为。

## § 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：海通海升六个月持有期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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	6,640,276.67	660,401.28
结算备付金		29,452,900.26	5,938,530.20
存出保证金		78,655.44	107,384.64
交易性金融资产	6.4.7.2	1,936,949,492.44	942,215,009.54
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,936,949,492.44	942,215,009.54
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	-	1,400,000.00
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		1,517,492.04	60,716,820.95
应收股利		-	-
应收申购款		1,314,022.74	4,074,649.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	20,158,705.19
资产总计		1,975,952,839.59	1,035,271,500.88
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		198,000,821.92	110,000,000.00
应付清算款		-	2,418,162.63
应付赎回款		2,197,575.67	6,880,491.02

应付管理人报酬		740,411.71	401,259.25
应付托管费		148,082.36	80,251.85
应付销售服务费		122,154.38	31,344.60
应付投资顾问费		-	-
应交税费		240,374.39	263,859.52
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	210,171.37	116,322.83
负债合计		201,659,591.80	120,191,691.70
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,531,904,218.55	798,924,716.95
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	242,389,029.24	116,155,092.23
净资产合计		1,774,293,247.79	915,079,809.18
负债和净资产总计		1,975,952,839.59	1,035,271,500.88

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，集合计划份额净值 1.1582 元，集合计划份额总额 1,531,904,218.55 份，其中 A 类集合份额 1,124,819,171.81 份，集合份额净值 1.1595 元；C 类集合份额 407,085,046.74 份，集合份额净值 1.1547 元。

## 6.2 利润表

会计主体：海通海升六个月持有期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	上年度可比期间 2021 年 1 月 14 日（基金合 同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		29,167,629.30	10,025,121.54
1. 利息收入		391,481.47	12,641,390.54
其中：存款利息收入	6.4.7.13	216,872.85	148,287.50
债券利息收入		-	11,263,233.70
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		174,608.62	1,229,869.34
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		26,918,686.61	-2,817,500.86
其中：股票投资收益	6.4.7.14	67,634.09	245,469.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	26,851,052.52	-3,062,970.18

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	-	-
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	1,857,461.22	201,231.86
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		9,070,744.07	3,497,903.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,229,413.14	1,552,834.79
2. 托管费	6.4.10.2.2	845,882.67	310,566.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	645,248.26	113,036.81
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		3,137,257.77	1,409,097.37
其中：卖出回购金融资产支出		3,137,257.77	1,409,097.37
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		93,667.82	32,498.03
8. 其他费用	6.4.7.23	119,274.41	79,869.80
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		20,096,885.23	6,527,217.78
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		20,096,885.23	6,527,217.78
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		20,096,885.23	6,527,217.78

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海通海升六个月持有期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	798,924,716.95	-	116,155,092.23	915,079,809.18

资产(基金净值)				
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	798,924,716.95	-	116,155,092.23	915,079,809.18
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	732,979,501.60	-	126,233,937.01	859,213,438.61
(一)、综合收益总额	-	-	20,096,885.23	20,096,885.23
(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)	732,979,501.60	-	106,137,051.78	839,116,553.38
其中:1.基金申购款	1,118,732,477.81	-	163,404,993.00	1,282,137,470.81
2.基金赎回款	-385,752,976.21	-	-57,267,941.22	-443,020,917.43
(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、本期期末净资产(基金净值)	1,531,904,218.55	-	242,389,029.24	1,774,293,247.79
项目	上年度可比期间			
	2021年1月14日(基金合同生效日)至2021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)	28,324,420.55	-	3,118,049.71	31,442,470.26
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)	28,324,420.55	-	3,118,049.71	31,442,470.26
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	994,674,737.34	-	106,093,990.91	1,100,768,728.25
(一)、综合收益总额	-	-	6,527,217.78	6,527,217.78
(二)、本期基	994,674,737.34	-	99,566,773.13	1,094,241,510.47

金份额 交易产 生的基 金净值 变动数 (净值 减少以 “-”号 填列)				
其中:1. 基金申 购款	994,674,737.34	-	99,566,773.13	1,094,241,510.47
2 .基金赎 回款	-	-	-	-
(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 期末净 资产(基 金净值)	1,022,999,157.89	-	109,212,040.62	1,132,211,198.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

李井伟

基金管理人负责人

陈颖

主管会计工作负责人

刘雯

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)是由海通季季红集合资产管理计划转型而来。海通海升六个月持有期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 1 月 14 日发布《海通季季红集合资产管理计划正式变更为海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划及合同生效的公告》。根据公告,海通季季红集合资产管理计划名称变更为“海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划”,海通季季红集合资产管理计划份额转换为海通海升六个月持有期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 1 月 14 日起《海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议》生效。本集合计划自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”),托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海通海升六个月持有期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,包括债券(国债、金融债券、中央银行票据、地方政府债券、企业债券、公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券)、债券回购、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本集合计划不直接投资于股票,但可持有因可转换债券和可交换债券转股所形成的股票等权益类资产。因上述原因持有的股票,本集合计划将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。

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。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本集合计划的业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数收益率×90%+1 年期定期存款利率（税后）×10%。

#### 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》、《海通海升六个月持有期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 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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，财政部于 2022 年颁布了《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会[2022]14 号），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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金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，本基金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，本基金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。

(i) 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、买入返售金融资产、应收利息、应收申购款和应收证券清算款，金额分别为 660,401.28 元、5,938,530.20 元、107,384.64 元、1,400,000.00 元、20,158,705.19 元、4,074,649.08 元和 60,716,820.95。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、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、应收申购款和应收证券清算款，金额分别为 662,240.35 元、5,941,469.73 元、107,437.77、1,399,526.91 元、0.00 元、4,074,649.08 元和 60,716,820.95。

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 942,215,009.54 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 962,369,356.09 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、卖出回购金融资产、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付税费、应付利息和其他负债-预提费用，金额分别为 2,418,162.63 元、110,000,000.00 元、6,880,491.02 元、401,259.25 元、80,251.85 元、31,344.60 元、2,945.84 元、263,859.52 元、21,623.01 和 135,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、卖出回购金融资产、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、应付利息和其他负债-预提费用，金额分别为

2,418,162.63 元、109,978,376.99 元、6,880,491.02 元、401,259.25 元、80,251.85 元、31,344.60 元、2,945.84、0.00 元和 135,000.00 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“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，本基金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。

#### 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[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]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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、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。

(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) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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	6,640,276.67
等于：本金	6,639,440.96
加：应计利息	835.71
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	6,640,276.67

#### 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	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	959,468,940.42	16,552,424.02	980,961,176.04	4,939,811.60
	银行间市场	934,740,902.33	18,952,016.40	955,988,316.40	2,295,397.67
	合计	1,894,209,842.75	35,504,440.42	1,936,949,492.44	7,235,209.27
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,894,209,842.75	35,504,440.42	1,936,949,492.44	7,235,209.27	

#### 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

注：本集合计划本报告期末未持有期货合约。

## 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

## 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

## 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	8,224.90
其中：交易所市场	-
银行间市场	8,224.90
应付利息	-
预提费用	201,946.47
合计	210,171.37

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

海通海升六个月持有 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	644,328,328.89	644,328,328.89
本期申购	792,230,163.28	792,230,163.28
本期赎回 (以“-”号填列)	-311,739,320.36	-311,739,320.36
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	1,124,819,171.81	1,124,819,171.81

## 海通海升六个月持有 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	154,596,388.06	154,596,388.06
本期申购	326,502,314.53	326,502,314.53
本期赎回 (以“-”号填列)	-74,013,655.85	-74,013,655.85
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	407,085,046.74	407,085,046.74

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

## 海通海升六个月持有 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	81,874,828.82	12,196,172.60	94,071,001.42
本期利润	14,165,973.92	1,521,402.75	15,687,376.67
本期基金份额交易产生的变动数	61,409,150.76	8,256,208.50	69,665,359.26
其中：基金申购款	102,806,638.50	13,157,245.23	115,963,883.73
基金赎回款	-41,397,487.74	-4,901,036.73	-46,298,524.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	157,449,953.50	21,973,783.85	179,423,737.35

## 海通海升六个月持有 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	22,148,551.87	-64,461.06	22,084,090.81
本期利润	4,073,450.09	336,058.47	4,409,508.56
本期基金份额交易产	36,660,609.56	-188,917.04	36,471,692.52

生的变动数			
其中：基金申购款	47,828,640.10	-387,530.83	47,441,109.27
基金赎回款	-11,168,030.54	198,613.79	-10,969,416.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,882,611.52	82,680.37	62,965,291.89

#### 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	65,711.70
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	150,461.60
其他	699.55
合计	216,872.85

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

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	67,634.09
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	67,634.09

##### 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	2,556,397.40
减：卖出股票成本总额	2,485,695.60
减：交易费用	3,067.71
买卖股票差价收入	67,634.09

##### 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	31,909,232.32
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-5,058,179.80
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	26,851,052.52

#### 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	1,547,681,819.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,525,925,827.35
减：应计利息总额	26,778,191.09
减：交易费用	35,980.56
买卖债券差价收入	-5,058,179.80

#### 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**

注：本集合计划本报告期无股利收益。

**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	1,794,512.89
股票投资	-
债券投资	1,794,512.89
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	-62,948.33
合计	1,857,461.22

**6.4.7.21 其他收入**

注：本集合计划本报告期无其他收入。

**6.4.7.22 信用减值损失**

注：本集合计划本报告期无信用减值损失。

**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	7,439.10
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	32,100.00
银行费用	20,227.94
合计	119,274.41

**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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
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。

##### 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		上年度可比期间 2021年1月14日（基金合同生效日） 至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
海通证券	2,556,397.40	100.00	3,464,099.50	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		上年度可比期间 2021年1月14日（基金合同生效日）至 2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 （%）
海通证券	1,679,133,688.78	100.00	2,742,313,365.05	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	上年度可比期间 2021年1月14日（基金合同生效日）至 2021年6月30日

	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
海通证券	23,660,700,000.00	100.00	27,480,400,000.00	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	284.53	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月14日（基金合同生效日）至2021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	455.86	100.00	2,280.84	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	上年度可比期间 2021年1月14日（基金合 同生效日）至2021年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,229,413.14	1,552,834.79
其中：支付销售机构的客户维护费	843,158.81	637,620.18

注：1. 本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	845,882.67	310,566.96

注： $H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$ 

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		
	海通海升六个月持有 A	海通海升六个月持有 C	合计
农业银行	-	14,217.75	14,217.75
海通证券	-	69,226.10	69,226.10
海通资管	-	20.68	20.68
合计	-	83,464.53	83,464.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海通海升六个月持有 A	海通海升六个月持有 C	合计
农业银行	-	5,319.13	5,319.13
海通证券	-	111,800.79	111,800.79
海通资管	-	99.73	99.73
合计	-	117,219.65	117,219.65

注：C 类份额的销售服务费按前一日 C 类份额资产净值的 0.3% 年费率计提，计算方法如下：

 $H=E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$ 

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：本集合计划报告期末与关联方通过银行间同业市场进债券（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自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
	海通海升六个月持有 A	海通海升六个月持有 C
基金合同生效日（2021年1月14日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%
项目	上年度可比期间 2021年1月14日（基金合同生效日）至2021年6月30日	上年度可比期间 2021年1月14日（基金合同生效日）至2021年6月30日
	海通海升六个月持有 A	海通海升六个月持有 C
基金合同生效日（2021年1月14日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	109,318,575.20	0.00



报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	109,318,575.20	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.0300%	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

份额单位：份

海通海升六个月持有 A

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)
海通证券股份有限公司	20,197,000.00	1.8000	20,197,000.00	3.1300

注：本表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。

#### 6.4.10.6 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		上年度可比期间 2021 年 1 月 14 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	6,640,276.67	65,711.70	66,363,578.78	63,587.30

#### 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

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102101197	21 雨花城投 MTN002	2022 年 7 月 1 日	101.53	55,000	5,584,150.00
合计				55,000	5,584,150.00

#### 6.4.12.3.2 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。

### 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日

A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	30,356,868.49	-
合计	30,356,868.49	-

#### 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	4,872,000.00
合计	-	4,872,000.00

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	700,234,473.96	618,652,517.74
AAA 以下	570,213,427.23	221,571,203.40
未评级	521,190,731.74	35,588,738.40
合计	1,791,638,632.93	875,812,459.54

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	6,640,276.67	-	-	-	6,640,276.67
结算备付金	29,452,900.26	-	-	-	29,452,900.26
存出保证金	78,655.44	-	-	-	78,655.44
交易性金融资产	518,515,568.03	1,393,597,504.63	24,836,419.78	-	1,936,949,492.44
应收申购款	-	-	-	1,314,022.74	1,314,022.74
清算资金往来	-	-	-	1,517,492.04	1,517,492.04
资产总计	554,687,400.40	1,393,597,504.63	24,836,419.78	2,831,514.78	1,975,952,839.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,197,575.67	2,197,575.67
应付管理人报酬	-	-	-	740,411.71	740,411.71
应付托管费	-	-	-	148,082.36	148,082.36
卖出回购金融资产款	198,000,821.92	-	-	-	198,000,821.92
应付销售服务费	-	-	-	122,154.38	122,154.38
应交税费	-	-	-	240,374.39	240,374.39
其他负债	-	-	-	210,171.37	210,171.37
负债总计	198,000,821.92	-	-	3,658,769.88	201,659,591.80
利率敏感度缺口	356,686,578.48	1,393,597,504.63	24,836,419.78	-827,255.10	1,774,293,247.79
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	660,401.28	-	-	-	660,401.28
结算备付金	5,938,530.20	-	-	-	5,938,530.20
存出保证金	107,384.64	-	-	-	107,384.64
交易性金融资产	282,262,279.54	626,271,050.00	33,681,680.00	-	942,215,009.54
买入返售金融资产	1,400,000.00	-	-	-	1,400,000.00
应收申购款	-	-	-	4,074,649.08	4,074,649.08
应收证券清算款	-	-	-	60,716,820.95	60,716,820.95
其他资产	-	-	-	20,158,705.19	20,158,705.19
资产总计	290,368,595.66	626,271,050.00	33,681,680.00	84,950,175.22	1,035,271,500.88
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,880,491.02	6,880,491.02
应付管理人报酬	-	-	-	401,259.25	401,259.25
应付托管费	-	-	-	80,251.85	80,251.85
应付证券清算款	-	-	-	2,418,162.63	2,418,162.63
卖出回购金融资产款	110,000,000.00	-	-	-	110,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	31,344.60	31,344.60
应交税费	-	-	-	263,859.52	263,859.52
其他负债	-	-	-	116,322.83	116,322.83
负债总计	110,000,000.00	-	-	10,191,691.70	120,191,691.70
利率敏感度缺口	180,368,595.66	626,271,050.00	33,681,680.00	74,758,483.52	915,079,809.18

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

合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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	-11,595,840.82	-5,603,162.76
	市场利率下降 25 个基点	11,750,894.01	5,697,095.38

#### 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

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

## 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	194,993,475.28	76,388,681.14
第二层次	1,741,956,017.16	865,826,328.40
第三层次	-	-
合计	1,936,949,492.44	942,215,009.54

## 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 6 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,936,949,492.44	98.03
	其中：债券	1,936,949,492.44	98.03
	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	36,093,176.93	1.83
8	其他各项资产	2,910,170.22	0.15
9	合计	1,975,952,839.59	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

注：本集合本报告期末未持有股票。

#### 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

注：本集合本报告期末未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	000887	中鼎股份	2,485,695.60	0.27

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	000887	中鼎股份	2,556,397.40	0.28

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	2,485,695.60
卖出股票收入（成交）总额	2,556,397.40

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	114,953,991.02	6.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	122,655,063.14	6.91
	其中：政策性金融债	20,024,575.61	1.13
4	企业债券	469,023,708.64	26.43
5	企业短期融资券	30,356,868.49	1.71
6	中期票据	865,650,784.90	48.79
7	可转债（可交换债）	211,396,839.67	11.91
8	同业存单	-	-
9	其他	122,912,236.58	6.93
10	合计	1,936,949,492.44	109.17

## 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	149405	21 申证 C2	695,000	71,653,795.48	4.04
2	102103104	21 宜兴城投 MTN002	580,000	59,526,353.42	3.35
3	019658	21 国债 10	485,000	49,423,891.78	2.79
4	101801277	18 黄冈城投 MTN002	400,000	41,937,676.71	2.36
5	127452	PR 硃口债	1,000,000	41,356,991.78	2.33

## 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

无。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

## 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，武汉市硚口国有资产经营有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行间市场交易商协会的处罚，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。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	78,655.44
2	应收清算款	1,517,492.04
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,314,022.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,910,170.22

### 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	110053	苏银转债	17,750,138.07	1.00
2	127005	长证转债	16,527,994.75	0.93
3	113013	国君转债	15,779,097.08	0.89
4	132018	G 三峡 EB1	14,558,304.66	0.82
5	113024	核建转债	9,940,512.05	0.56
6	113050	南银转债	8,783,711.45	0.50
7	110064	建工转债	8,579,696.80	0.48
8	127038	国微转债	7,532,685.62	0.42

9	123107	温氏转债	7,090,133.42	0.40
10	127016	鲁泰转债	6,998,243.84	0.39
11	110043	无锡转债	6,127,853.89	0.35
12	110056	亨通转债	5,674,598.08	0.32
13	113046	金田转债	5,570,546.88	0.31
14	127025	冀东转债	5,188,997.15	0.29
15	110079	杭银转债	4,798,339.42	0.27
16	127036	三花转债	4,674,544.93	0.26
17	113043	财通转债	3,956,719.03	0.22
18	128035	大族转债	3,756,760.03	0.21
19	127020	中金转债	3,522,275.34	0.20
20	127015	希望转债	3,115,549.85	0.18
21	128048	张行转债	2,972,498.90	0.17
22	127012	招路转债	2,855,534.25	0.16
23	113049	长汽转债	2,366,154.25	0.13
24	110081	闻泰转债	2,217,286.85	0.12
25	110073	国投转债	2,142,235.99	0.12
26	127045	牧原转债	2,051,176.23	0.12
27	110060	天路转债	1,846,783.56	0.10
28	132014	18 中化 EB	1,845,059.73	0.10
29	127022	恒逸转债	1,779,298.36	0.10
30	110061	川投转债	1,584,903.35	0.09
31	127040	国泰转债	1,457,662.85	0.08
32	113051	节能转债	1,132,487.67	0.06
33	110077	洪城转债	1,020,976.19	0.06
34	110083	苏租转债	968,376.99	0.05
35	110075	南航转债	741,172.33	0.04
36	128132	交建转债	593,225.34	0.03
37	128136	立讯转债	114,391.51	0.01
38	113616	韦尔转债	12,772.27	0.00

### 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	户均持有的基 金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
海通海升 六个月持 有 A	4,058	277,185.60	610,296,180.90	54.26	514,522,990.90	45.74
海通海升 六个月持 有 C	10,179	39,992.64	4,541,131.42	1.12	402,543,915.32	98.88
合计	14,237	107,600.21	614,837,312.33	40.14	917,066,906.22	59.86

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	海通海升六个月持有 A	392,848.32	0.0349
	海通海升六个月持有 C	4,988.05	0.0012
	合计	397,836.37	0.0260

### 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	海通海升六个月持有 A	0~10
	海通海升六个月持有 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有 本开放式基金	海通海升六个月持有 A	10~50
	海通海升六个月持有 C	0
	合计	10~50

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海通海升六个月持有 A	海通海升六个月持有 C
基金合同生效日 (2021 年 1 月 14 日) 基金份额总额	28,324,420.55	-

本报告期期初基金份额总额	644,328,328.89	154,596,388.06
本报告期基金总申购份额	792,230,163.28	326,502,314.53
减：本报告期基金总赎回份额	311,739,320.36	74,013,655.85
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,124,819,171.81	407,085,046.74

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、2022年3月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

4、2022年3月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

### 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

无。

### 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	2,556,397.40	100.00	284.53	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	1,679,133,688.78	100.00	23,660,700,000.00	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	海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划基金经理变更公告	规定披露媒介	2022年1月20日
2	海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划基金产品资料概要更新	规定披露媒介	2022年1月21日
3	海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书更新	规定披露媒介	2022年1月21日
4	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
5	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
6	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

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

### 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季季红集合资产管理计划资产管理合同变更的文件
- (二) 海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同
- (三) 海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议
- (四) 海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书
- (五) 法律意见书
- (六) 管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 托管人业务资格批件、营业执照
- (八) 业务规则
- (九) 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](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 8 月 31 日