

海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合 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 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 2 月 10 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	10
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	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
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	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	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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	43
§ 9 开放式基金份额变动	43
§ 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	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	45
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	45
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	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	45
§ 12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录	45
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划	
基金简称	海通安润 90 天滚动持有中短债	
基金主代码	970134	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 2 月 10 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	58,459,475.97 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海通安润 90 天滚动持有中短债 A	海通安润 90 天滚动持有中短债 C
下属分级基金的交易代码	970134	970135
报告期末下属分级基金的份额总额	50,601,494.49 份	7,857,981.48 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，重点投资中短债，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本集合计划主要投资于中短期债券，并控制投资组合久期，力求在承担较低风险和保持组合较好流动性的前提下，实现集合计划资产的稳健增值。</p> <p>1、固定收益类资产投资策略</p> <p>（1）债券投资策略</p> <p>本集合计划在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理。</p> <p>（2）可转债投资策略</p> <p>可转债主要筛选正股优良、估值合理及具备明显条款博弈价值的个券。根据转债估值及定价模型，结合权益市场预期进行择时判断，在市场估值及隐含波动率的不同阶段采用不同的投资策略；</p> <p>（3）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采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。</p> <p>（4）杠杆投资策略</p> <p>本集合计划将对资金面进行综合分析的基础上，比较债券收益率和融资成本，判断利差空间，适当运用杠杆方式来获取主动管理回报。</p> <p>（5）银行存款、同业存单投资策略</p> <p>本集合计划根据宏观经济指标分析各类资产的预期收益率水平和预期波动率水平，并据此制定和调整资产配置策略。</p> <p>2、衍生产品投资策略</p>

	<p>(1) 国债期货投资策略</p> <p>本集合计划可投资国债期货。若本集合计划投资国债期货，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易，以对冲投资组合的系统性风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。</p> <p>(2) 本集合计划将关注其他金融衍生产品的推出情况，如法律法规或监管机构允许本集合计划投资前述衍生工具，本集合计划将按届时有效的法律法规和监管机构的规定，制定与本集合计划投资目标相适应的投资策略和估值政策，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。</p>
业绩比较基准	中债综合财富(1年以下)指数收益率*50%+中债综合财富(1-3年)指数收益率*35%+一年期定期存款利率(税后)*15%
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	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@bosc.cn
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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://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	上海海通证券资产管理有限公司	上海市黄浦区广东路 689 号 32 楼 01-12 室单元

§ 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	2022 年 02 月 10 日（基金合同生效日）-2022 年 06 月 30 日	
和指标	海通安润 90 天滚动持有中短债 A	海通安润 90 天滚动持有中短债 C
本期已实现收益	552,027.71	101,588.86
本期利润	494,120.22	96,479.84
加权平均基金份额本期利润	0.0097	0.0091
本期加权平均净值利润率	0.94%	0.89%
本期基金份额净值增长率	0.88%	0.77%
3.1.2 期末数据	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
和指标		
期末可供分配利润	1,575,687.92	235,935.42
期末可供分配基金份额利润	0.0311	0.0300
期末基金资产净值	52,177,182.41	8,093,916.90
期末基金份额净值	1.0311	1.0300
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	0.88%	0.77%

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)。

4、本财务报表的实际编制期间为 2022 年 02 月 10 日(合同生效日)至 2022 年 06 月 30 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

海通安润 90 天滚动持有中短债 A

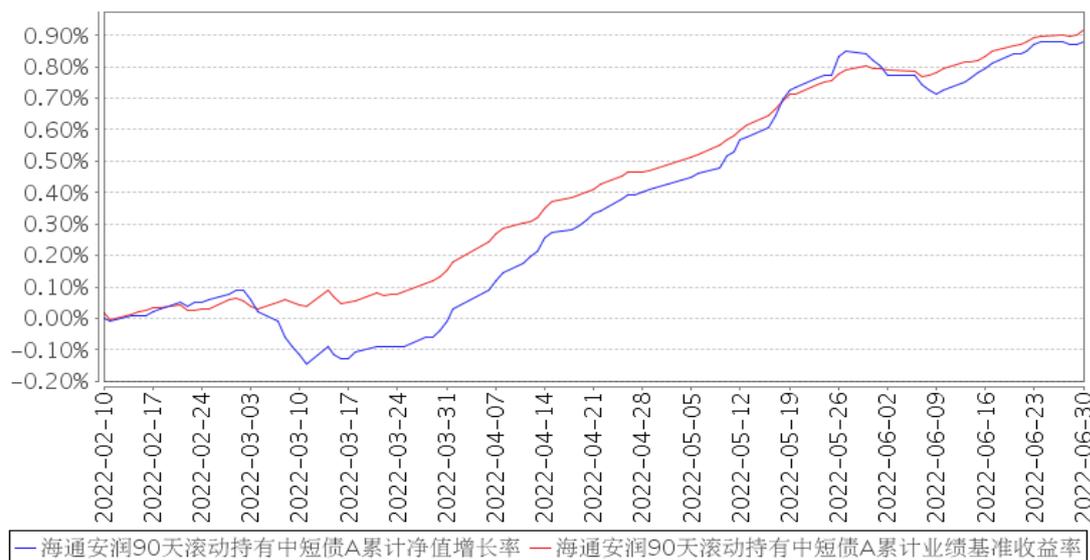
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.06%	0.02%	0.12%	0.01%	-0.06%	0.01%
过去三个月	0.89%	0.02%	0.76%	0.01%	0.13%	0.01%
自基金合同生效起至今	0.88%	0.02%	0.92%	0.01%	-0.04%	0.01%

海通安润 90 天滚动持有中短债 C

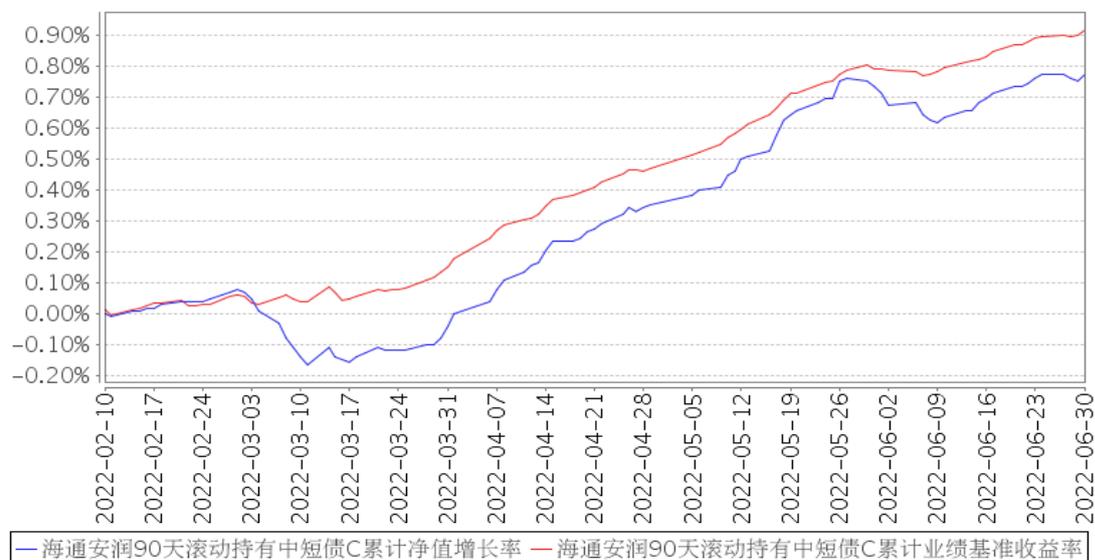
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.04%	0.02%	0.12%	0.01%	-0.08%	0.01%
过去三个月	0.81%	0.02%	0.76%	0.01%	0.05%	0.01%
自基金合同生效起至今	0.77%	0.02%	0.92%	0.01%	-0.15%	0.01%

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

海通安润90天滚动持有中短债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



海通安润90天滚动持有中短债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 2022 年 2 月 10 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。

§ 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		
肖彦	投资经理	2022 年 2 月 10 日	-	7 年	肖彦，女，北京大学管理学硕士，7 年证券从业经验。曾就职于花旗环球金融亚洲有限公司，2017 年加入海通证券资产管理有限公司，曾任固定收益部研究员、固定收益

					三部投资经理 现任公募固收部投资经理。
--	--	--	--	--	---------------------

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 年上半年债市收益率整体呈现宽幅震荡走势。一季度债券市场在央行下调政策利率的利好下迎来上涨，之后随着金融数据的改善收益率上行。二季度主导债券市场走势的主要是疫情形势，4 月上海疫情加重，经济基本面下滑，在央行降准 0.25% 与上缴利润下，资金利率下行并维持在低位水平。这期间中短端信用债表现突出，利率债在美债利率倒挂与汇率贬值压力下走势偏震荡。进入 5 月，PMI 数据表现疲弱，叠加北京疫情与资金面的持续宽松，债券收益率延续下行走势。5 月底至 6 月，随着上海全面复工复产与北京疫情得到控制，各项经济金融数据边际改善，收益率在快速上行后维持震荡。报告期内组合均衡配置于中短久期的中高等级信用债，组合加权久期位于中性水平区间，杠杆水平于 6 月底有所下降。

展望下半年，在流动性宽松刺激下短端利率有望带动中长端利率进一步下行，同时需要关注后期可能存在资金利率中枢回归与银行间杠杆水平上升的风险。组合将继续维持中高等级中短久期的底仓配置思路，底仓久期维持在中性水平附近，同时以一定的交易性仓位（利率债与高等级信用债为主）积极参与到债券市场行情中，灵活调整组合久期以积极应对市场变化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本集合计划 A 份额净值为 1.0311，C 份额净值为 1.0300。本报告期集合计划上述两类份额净值增长率为 0.88% 和 0.77%。业绩比较基准收益率为 0.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观基本面预期将延续温和修复走势，基建与制造业投资预期将保持一定韧性，出口仍有望维持在较高的同比增速水平。同时也需要关注到宽信用进程面临需求不足的考验。7-8 月债券市场在流动性宽松刺激下短端利率将有望带动中长端利率进一步下行，期限利差有进一步压缩的空间，但后期需要关注资金利率中枢回归与银行间杠杆水平上升的风险。

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：海通安润 90 天滚动持有中短债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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	45,709.64
结算备付金		952,912.47
存出保证金		19,364.74
交易性金融资产	6.4.7.2	69,044,226.92
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		69,044,226.92
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	1,700,169.30
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		64,125.18
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	63,390.00
资产总计		71,889,898.25
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 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		11,507,000.00
应付清算款		4,000.45
应付赎回款		-
应付管理人报酬		12,240.18
应付托管费		2,040.04
应付销售服务费		1,979.30
应付投资顾问费		-
应交税费		5,426.88
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	86,112.09
负债合计		11,618,798.94
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	58,459,475.97
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	1,811,623.34
净资产合计		60,271,099.31
负债和净资产总计		71,889,898.25

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，本集合计划份额总额 58,459,475.97 份，其中 A 类份额净值 1.0311 元，份额总额 50,601,494.49 份；C 类份额净值 1.0300 元，份额总额 7,857,981.48 份。

（2）本财务报表的实际编制期间为 2022 年 02 月 10 日（合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日，无上年度同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2022 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		812,291.77
1. 利息收入		17,651.27
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,697.85
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		6,953.42
证券出借利息收入		-

其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		857,657.01
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	857,657.01
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	-63,016.51
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	-
减：二、营业总支出		221,691.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	73,772.68
2. 托管费	6.4.10.2.2	12,295.44
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	12,752.82
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-
5. 利息支出		49,720.51
其中：卖出回购金融资产支出		49,720.51
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		3,206.12
8. 其他费用	6.4.7.23	69,944.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		590,600.06
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		590,600.06
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		590,600.06

注：本集合计划合同生效日为 2022 年 02 月 10 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：海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 2 月 10 日（基金合同生效日）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)				
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)	31,773,886.00	-	701,600.46	32,475,486.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	26,685,589.97	-	1,110,022.88	27,795,612.85
(一)、综合收益总额	-	-	590,600.06	590,600.06
(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)	26,685,589.97	-	519,422.82	27,205,012.79
其中:1.基金申购款	54,186,466.49	-	1,324,369.35	55,510,835.84
2.基金赎回款	-27,500,876.52	-	-804,946.53	-28,305,823.05
(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)	58,459,475.97	-	1,811,623.34	60,271,099.31

注：本集合计划合同生效日为 2022 年 02 月 10 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

海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于 2022 年 1 月 11 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予海通月月财集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2022]70 号）批准，《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》于 2022 年 2 月 10 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《海通安润 90 天滚动持有中短债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。

本集合计划不投资于股票等权益类资产，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。

本集合计划的投资组合比例为：债券资产的投资比例不低于集合计划资产的 80%，其中投资于中短债的比例不低于非现金资产的 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，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集合计划资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本集合计划所指的中短债是指剩余期限不超过三年的债券资产，主要包括国债、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金融工具。

本集合计划的业绩比较基准为中债综合财富(1 年以下)指数收益率*50%+中债综合财富(1-3 年)指数收益率*35%+一年期定期存款利率(税后)*15%。

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》、财政部《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》、《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》和在财务报表附注四、所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2 月 10 日(合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2022 年 2 月 10 日（合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本集合计划采用人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

根据本集合计划管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本集合计划将同时符合下列条件且未被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，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 合同现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

本集合计划将同时符合下列条件且未被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，分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（债务工具）：

- 业务模式既以收取合同现金流量又以出售该金融资产为目标；
- 合同现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

对于非交易性权益工具投资，本集合计划可以在初始确认时将其不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（权益工具）。该指定在单项投资的基础上作出，且相关投资从发行者的角度符合权益工具的定义。

除上述以摊余成本计量和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产外，本公司将其余所有的金融资产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。

（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和以摊余成本计量的金融负债。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。本集合计划持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

（1）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括交易性金融资产、衍生金融资产、其他非流动金融资产等，按公允价值进行初始计量，相关交易费用计入当期损益。该金融资产按公允价值进行后续计量，公允价值变动计入当期损益。

(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（债务工具）

以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（债务工具）包括应收款项融资、其他债权投资等，按公允价值进行初始计量，相关交易费用计入初始确认金额。该金融资产按公允价值进行后续计量，公允价值变动除采用实际利率法计算的利息、减值损失或利得和汇兑损益之外，均计入其他综合收益。

终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。

(3) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（权益工具）

以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产（权益工具）包括其他权益工具投资等，按公允价值进行初始计量，相关交易费用计入初始确认金额。该金融资产按公允价值进行后续计量，公允价值变动计入其他综合收益。取得的股利计入当期损益。

终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

(4) 以摊余成本计量的金融资产

以摊余成本计量的金融资产包括应收账款、其他应收款、债权投资等，按公允价值进行初始计量，相关交易费用计入初始确认金额；不包含重大融资成分的应收账款以及本公司决定不考虑不超过一年的融资成分的应收账款，以合同交易价格进行初始计量。

持有期间采用实际利率法计算的利息计入当期损益。

收回或处置时，将取得的价款与该金融资产账面价值之间的差额计入当期损益。

(5) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债、衍生金融负债等，按公允价值进行初始计量，相关交易费用计入当期损益。该金融负债按公允价值进行后续计量，公允价值变动计入当期损益。

终止确认时，其账面价值与支付的对价之间的差额计入当期损益。

(6) 以摊余成本计量的金融负债

以摊余成本计量的金融负债包括应付账款、其他应付款等，按公允价值进行初始计量，相关交易费用计入初始确认金额。

持有期间采用实际利率法计算的利息计入当期损益。

终止确认时，将支付的对价与该金融负债账面价值之间的差额计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

存在活跃市场的金融工具，以活跃市场中的报价确定其公允价值。不存在活跃市场的金融工具，采用估值技术确定其公允价值。在估值时，本集合计划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，选择与市场参与者在相关资产或负债的交易中所考虑的资产或负债特征相一致的输入值，并优先使用相关可观察输入值。只有在相关可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

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。

(2) 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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集合计划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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占集合计划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)。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬(包括管理费和业绩报酬)、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，其中业绩报酬于相应的集合计划赎回确认日按投资者赎回申请的集合计划实际收益情况计算确认，未达到支付条件的暂估业绩报酬不计入当期收

益。

暂估业绩报酬为假设本集合计划于本报告期末按照当日的集合计划份额净值（计提业绩报酬前）清算，根据集合计划份额持有人持有的集合计划份额（包括未到期份额）至该日持有期间的收益情况估算的业绩报酬。

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。

6.4.4.11 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。由红利再投资而来的 A 类或 C 类份额，其运作期起始日和运作期到期日与原份额相同；

（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 类份额和 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。

6.4.4.12 外币交易

本集合计划本报告期无外币交易。

6.4.4.13 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。

6.4.4.14 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。

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

本集合计划本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

财政部、国家税务总局财税[2016]140 号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》对资产管理计划增值税做出相关规定。除增值税外，本集合计划比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，若遇政策法规调整，相关的税务问题将按照调整后的政策法规执行。主要税项列示如下：

1、增值税

根据财税[2016]140 号文件的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财税[2017]56 号文件的规定, 2018 年 1 月 1 日(含)以后, 资管产品管理人 (以下简称管理人) 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。

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	45,709.64
等于: 本金	45,375.18
加: 应计利息	334.46
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	45,709.64

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	52,453,740.00	1,129,151.22	53,563,914.22	-18,977.00
	银行间市场	15,352,018.00	142,212.70	15,480,312.70	-13,918.00
	合计	67,805,758.00	1,271,363.92	69,044,226.92	-32,895.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	67,805,758.00	1,271,363.92	69,044,226.92	-32,895.00	

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,700,169.30	-

银行间市场	-	-
合计	1,700,169.30	-

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应收利息	-
其他应收款	63,390.00
待摊费用	-
合计	63,390.00

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	5,629.61
其中：交易所市场	-
银行间市场	5,629.61
应付利息	-
预提费用	80,482.48
合计	86,112.09

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

海通安润 90 天滚动持有中短债 A

项目	本期 2022 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	31,773,886.00	31,773,886.00
本期申购	40,384,485.73	40,384,485.73
本期赎回（以“-”号填列）	-21,556,877.24	-21,556,877.24
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	50,601,494.49	50,601,494.49

海通安润 90 天滚动持有中短债 C

项目	本期 2022 年 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	13,801,980.76	13,801,980.76
本期赎回（以“-”号填列）	-5,943,999.28	-5,943,999.28
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	7,857,981.48	7,857,981.48

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

海通安润 90 天滚动持有中短债 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	693,666.83	7,933.63	701,600.46
本期利润	552,027.71	-57,907.49	494,120.22
本期基金份额交易产生的变动数	417,599.47	-37,632.23	379,967.24
其中：基金申购款	1,038,517.96	-24,211.15	1,014,306.81
基金赎回款	-620,918.49	-13,421.08	-634,339.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,663,294.01	-87,606.09	1,575,687.92

海通安润 90 天滚动持有中短债 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	101,588.86	-5,109.02	96,479.84
本期基金份额交易产生的变动数	147,368.20	-7,912.62	139,455.58
其中：基金申购款	313,675.66	-3,613.12	310,062.54
基金赎回款	-166,307.46	-4,299.50	-170,606.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	248,957.06	-13,021.64	235,935.42

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年2月10日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
活期存款利息收入		6,396.42
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		4,128.87
其他		172.56
合计		10,697.85

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

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本集合计划本报告期无股票投资收益。

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2月10日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
债券投资收益——利息收入		936,580.61
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		-78,923.60
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		857,657.01

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2月10日（基金合同生效日）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	206,742,459.21
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	203,069,520.82
减：应计利息总额	3,744,940.24
减：交易费用	6,921.75
买卖债券差价收入	-78,923.60

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

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2月10日（基金合同生效日）至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-63,903.00
股票投资	-

债券投资	-63,903.00
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	-886.49
合计	-63,016.51

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

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年2月10日（基金合同生效日）至2022年6月30日
审计费用	7,339.05
信息披露费	52,061.43
证券出借违约金	-
银行费用	1,243.66
账户维护费	9,300.00
合计	69,944.14

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 2022 年 2 月 10 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

注：本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 2 月 10 日（基金合同生效日）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	164,839,549.79	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 2 月 10 日（基金合同生效日）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	615,624,000.00	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

注：本集合计划本报告期无应支付关联方的佣金。

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 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	当期发生的基金应支付的管理费	73,772.68
其中：支付销售机构的客户维护费	31.16	

注：1. 本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.3% 年费率计提。管理费的计算方法如

下：

$$H=E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

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 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	12,295.44

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 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海通安润 90 天滚动持有中短债 A	海通安润 90 天滚动持有中短债 C	合计
海通证券	-	12,689.01	12,689.01
海通资管	-	0.22	0.22
合计	-	12,689.23	12,689.23

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：本集合计划本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（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市场化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	本期
	2022年2月10日(基金合同生效日)至2022年6月30日	2022年2月10日(基金合同生效日)至2022年6月30日
	海通安润90天滚动持有中短债A	海通安润90天滚动持有中短债C
基金合同生效日(2022年2月10日)持有的基金份额	6,235,879.00	0.00
报告期初持有的基金份额	6,235,879.00	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	6,235,879.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.3235%	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 2 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
	上海银行	45,709.64

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内未进行利润分配。

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 11,507,000.00 元，其中人民币 11,507,000.00 元于 2022 年 7 月 4 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

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。

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
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	1,957,648.31
合计	1,957,648.31

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
AAA	43,577,245.42
AAA 以下	19,583,216.55
未评级	-
合计	63,160,461.97

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	45,709.64	-	-	-	45,709.64
结算备付金	952,912.47	-	-	-	952,912.47
存出保证金	19,364.74	-	-	-	19,364.74
交易性金融资产	29,004,173.73	39,243,367.60	796,685.59	-	69,044,226.92
买入返售金融资产	1,700,169.30	-	-	-	1,700,169.30
应收清算款	-	-	-	64,125.18	64,125.18
其他资产	-	-	-	63,390.00	63,390.00
资产总计	31,722,329.88	39,243,367.60	796,685.59	127,515.18	71,889,898.25
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	12,240.18	12,240.18
应付托管费	-	-	-	2,040.04	2,040.04
应付清算款	-	-	-	4,000.45	4,000.45
卖出回购金融资产款	11,507,000.00	-	-	-	11,507,000.00
应付销售服务费	-	-	-	1,979.30	1,979.30
应交税费	-	-	-	5,426.88	5,426.88
其他负债	-	-	-	86,112.09	86,112.09
负债总计	11,507,000.00	-	-	111,798.94	11,618,798.94
利率敏感度缺口	20,215,329.88	39,243,367.60	796,685.59	15,716.24	60,271,099.31

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	
	利率曲线的平行移动	
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）	

分析	市场利率上升 25 个基点	-238,608.76
	市场利率下降 25 个基点	241,779.15

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

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。

第一层次：如以活跃市场报价估值的股票投资、股指期货投资、国债期货投资、每日开放申赎/买卖的基金投资等；第二层次：如因新发/增发尚未上市交易而按发行价格/增发价格估值的不限售的股票投资、债券投资等，使用第三方基准服务机构提供的报价估值的在交易所市

场或银行间同业市场交易的债券投资、资产支持证券投资等；第三层次：如使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期的股票投资，以及违约债、非指数收益法估值的长期停牌的股票等估值模型中使用不可观察输入值的投资等。

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
第一层次	-
第二层次	69,044,226.92
第三层次	-
合计	69,044,226.92

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

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。

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	69,044,226.92	96.04
	其中：债券	69,044,226.92	96.04

	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	1,700,169.30	2.36
	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	998,622.11	1.39
8	其他各项资产	146,879.92	0.20
9	合计	71,889,898.25	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：本集合计划本报告期末未持有境内股票。

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：本集合计划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：本集合计划本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本集合计划本报告期末未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

注：本集合计划本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本集合计划本报告期末未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	3,926,116.64	6.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	49,637,797.58	82.36
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	13,522,664.39	22.44
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	1,957,648.31	3.25
9	其他	-	-

10	合计	69,044,226.92	114.56
----	----	---------------	--------

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	101900544	19 衢州国资 MTN001	40,000	4,164,630.14	6.91
2	102100259	21 张家经开 MTN001	40,000	4,153,200.00	6.89
3	127453	PR 建安 01	100,000	4,130,684.93	6.85
4	152161	19 木渎债	50,000	3,629,501.10	6.02
5	127671	PR 秀洲债	50,000	3,225,416.44	5.35

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

报告期内，本集合计划投资的前十名证券的发行主体没有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。

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	19,364.74
2	应收清算款	64,125.18

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	63,390.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	146,879.92

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本集合计划本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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未持有股票。

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 (%)
海通安润 90 天滚动 持有中短 债 A	207	244,451.66	18,416,102.90	36.39	32,185,391.59	63.61
海通安润 90 天滚动 持有中短 债 C	83	94,674.48	-	-	7,857,981.48	100
合计	290	201,584.40	18,416,102.90	31.50	40,043,373.07	68.50

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	海通安润 90 天滚动持有中短债	1,316,019.09	2.6008

理人所有从业人员持有本基金	A		
	海通安润 90 天滚动持有中短债 C	9,916.98	0.1262
	合计	1,325,936.07	2.2681

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	海通安润 90 天滚动持有中短债 A	0~10
	海通安润 90 天滚动持有中短债 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	海通安润 90 天滚动持有中短债 A	0
	海通安润 90 天滚动持有中短债 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海通安润 90 天滚动持有中短债 A	海通安润 90 天滚动持有中短债 C
基金合同生效日 (2022 年 2 月 10 日) 基金份额总额	31,773,886.00	-
基金合同生效日起至 报告期期末基金总 申购份额	40,384,485.73	13,801,980.76
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	21,556,877.24	5,943,999.28
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	50,601,494.49	7,857,981.48

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

无

10.5 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。

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	-	-	-	-	-

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	164,839,549.79	100.00	615,624,000.00	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	海通月月财集合资产管理计划正式变更为海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划合同生效的公告	规定披露媒介	2022 年 2 月 10 日
2	关于海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划参与直销渠道开展申购费率优惠活动的公告	规定披露媒介	2022 年 2 月 11 日
3	海通安润 90 天滚动持有中短债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	规定披露媒介	2022 年 2 月 11 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。

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月月财集合资产管理计划资产管理合同变更的文件
- (二) 海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同
- (三) 海通安润 90 天滚动持有中短债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