

# 上海证券弘利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：上海证券有限责任公司

基金托管人：广发银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 16 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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金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基金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 11 日（合同变更生效日）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	7
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>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42

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 .....	43
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 .....	43
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 .....	43
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 .....	43
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	43
7.11 投资组合报告附注 .....	43
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
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 .....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>45</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 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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
<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 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上海证券弘利债券型集合资产管理计划	
基金简称	上证弘利	
基金主代码	970122	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 1 月 11 日	
基金管理人	上海证券有限责任公司	
基金托管人	广发银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	204,450,918.95 份	
基金合同存续期	本集合计划自本集合计划合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。	
下属分级基金的基金简称	上证弘利债券 A	上证弘利债券 C
下属分级基金的交易代码	970122	970123
报告期末下属分级基金的份额总额	110,802,526.41 份	93,648,392.54 份

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，追求集合计划财产的稳健增值。
投资策略	<p>本集合计划将在资产配置策略的基础上，通过固定收益类品种投资策略构筑债券组合的平稳收益，通过积极的转债类资产投资策略追求资产的增强型回报，同时合理的控制组合回撤风险力争获取稳定持续的收益。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本集合计划将研究中国宏观经济运行状况和资本市场的变化，充分考虑经济环境的运行、政策导向、资产类别的风险收益等因素，采取“自上而下”的方法在各类债券及带有权属属性的转债之间进行稳健的大类资产配置，并采取对组合久期的控制、债券类别配置、个券选择等积极的投资策略，获取组合净值的长期稳定增长。</p> <p>2、固定收益品种投资策略</p> <p>本集合计划将采取久期策略、信用债投资策略、可转债投资策略等积极投资策略，在严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，以实现组合增值的目标。</p> <p>（1）久期策略</p> <p>通过对 GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量，分析宏观经济运行的可能情景，预判财政政策、货币政策等宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构。在此基础上，预测债券收益率水平变动趋势。</p>

组合久期是反映利率风险最重要的指标。本集合计划基于对市场利率变化的预期调整组合久期：预期市场利率水平将上升时降低组合久期；预期市场利率将下降时提高组合久期；通过久期的调整来控制市场风险，增加投资收益。

(2) 收益率曲线策略

在组合剩余期限确定的基础上，结合对收益率曲线形态的变化预期采用哑铃型或梯型或子弹型投资策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

(3) 信用债券投资策略

企业债券类证券（包括企业债、公司债、可分离债的债券部分）是获得较高投资收益不可忽视的一部分，也是本集合计划在力争在低风险下获取较高收益时采取的一种投资策略。

本集合计划在控制信用风险的前提下，将密切关注企业债券类证券的市场动态和影响债券信用利差水平变化的众多因素，稳健、适时、合理、有效地运用企业债券类证券投资策略。具体来看，一是票息策略，即信用债券作为基础资产配置的一部分，以获取较高的票息收入，二是信用利差策略，挖掘行业信用利差的变化，获取信用利差收窄带来的资本利得收益，三是回购套利策略，即利用资金成本低于票息获取息差收益的策略。

本集合计划投资于主体评级或债项评级 AAA 的信用债券的投资比例不低于本集合计划信用债资产的 50%；投资于主体评级或债项评级 AA 的信用债券的投资比例不高于本集合计划信用债资产的 50%。

本集合计划所指信用债券是指企业债券、公司债券、短期融资券、商业银行金融债券、商业银行次级债、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、资产支持证券等除国债和央行票据之外的、非国家信用的固定收益类金融工具。主体评级或债项评级参照评级机构（中债资信除外）评定的最新评级。

(4) 资产支持证券等品种投资策略

资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。资产支持证券的投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本集合计划将在国内资产支持证券产品具体政策框架下，深入分析上述基本面因素，结合数量化定价模型，评估其风险及内在价值。本集合计划将严格控制资产支持证券资质及比例要求并进行分散投资，以降低流动性风险。

(5) 可转债及可交债投资策略

可转债及可交债是债券持有人可按照发行时约定的价格将债券转换成普通股的债券。是一种既具有债性，又具有股性的混合债券产品，具有抵御价格下行风险，分享股票价格上涨收益的特点。

本集合计划一是对发债主体的信用基本面进行深入挖掘以明确该可转债的债底保护，防范信用风险，另一方面，进一步分析标的公司的盈利能力和成长空间，从而确定可转债中长期的上涨空间。在此两者基础上，针对可转债的特点，确定一级市场申购策略和二级市场交易策略。

	<p>一级市场申购策略：本集合计划将积极参与发行条款较好、申购收益较高、公司基本面优秀的可转债的一级市场申购，上市后根据个券的具体情况做出持有或卖出的决策；</p> <p>二级市场交易策略：一是遵循价值投资策略，自下而上，择优而买，从正股和转债两方面考察基本面和估值，选择基本面优秀且估值合理的个券；二是兼顾成长投资策略，主要考虑低溢价率和低转股价格的双低策略，同时考虑下行风险和上行空间；利用债性控制下行风险，利用股性跟踪上涨空间。最后积极利用条款博弈策略，利用转债的回售及下修条款进行价格博弈，考虑在多种结果下的盈利方法。</p> <p>本集合计划不参与转股，在转股期内，将根据市场情况择机出售可转债。</p> <p>本集合计划投资于可转债（含可分离交易可转债纯债部分）、可交债的比例不超过集合计划资产的 20%。</p> <p>（6）证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>基于控制风险需求，本集合计划将综合研究及跟踪证券公司短期公司债券的信用风险、流动性风险等方面的因素，适当投资证券公司短期公司债券。</p>
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率。
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，在通常情况下，本集合计划预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金、股票型集合资产管理计划、混合型集合资产管理计划。

### 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		上海证券有限责任公司	广发银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张艳红	顾洪峰
	联系电话	021-53686888	010-65169885
	电子邮箱	zhangyanhong@shzq.com	guhongfeng@cgbchina.com.cn
客户服务电话		4008-918-918	4008308003
传真		021-53686313	010-65169555
注册地址		上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼	广东省广州市越秀区东风东路 713 号
办公地址		上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼	北京市西城区菜市口大街 1 号院 2 号楼信托大厦
邮政编码		200002	100053
法定代表人		何伟	王凯

### 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="https://www.shzq.com/">https://www.shzq.com/</a>
基金中期报告备置地点	上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

### 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	2022 年 01 月 11 日（基金合同生效日） -2022 年 06 月 30 日	2022 年 01 月 14 日（基金合同生效日） -2022 年 06 月 30 日
	上证弘利债券 A	上证弘利债券 C
本期已实现收益	2,712,131.72	289,109.25
本期利润	2,491,810.78	311,579.20
加权平均基金份额本期利润	0.0070	0.0201
本期加权平均净值利润率	0.69%	1.99%
本期基金份额净值增长率	1.81%	1.59%
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	3,564,738.66	1,492,746.16
期末可供分配基金份额利润	0.0322	0.0159
期末基金资产净值	114,367,265.07	95,141,138.70
期末基金份额净值	1.0322	1.0159
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	1.81%	1.59%

注：1、本集合计划合同变更生效日为 2022 年 1 月 11 日，截至 2022 年 6 月 30 日，本集合计划生效不满一年。

2、上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、本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4、期末可供分配利润，采用期末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

上证弘利债券 A

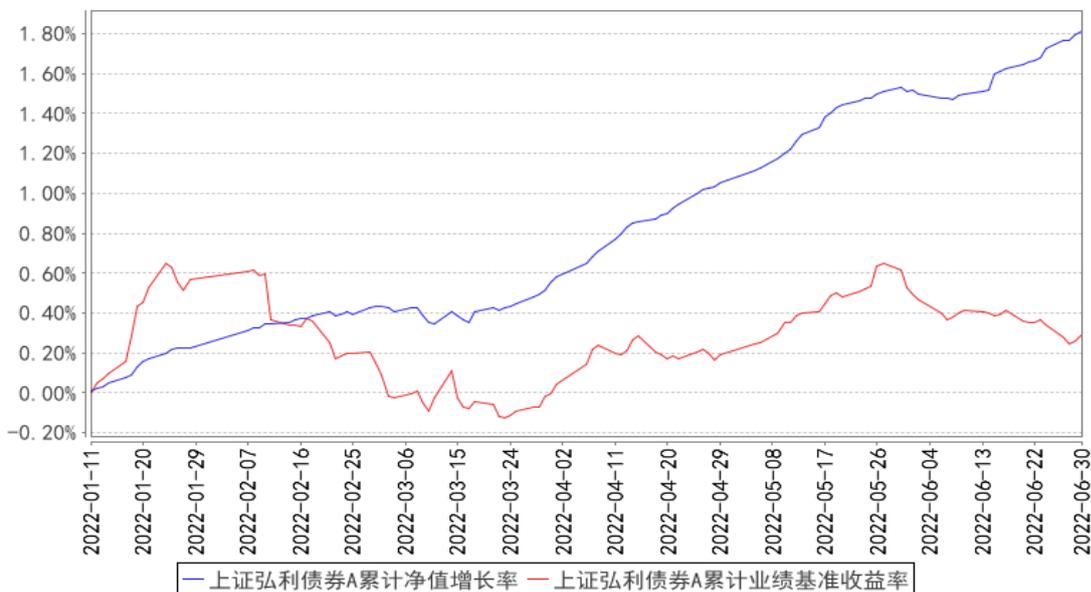
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.30%	0.02%	-0.24%	0.03%	0.54%	-0.01%
过去三个月	1.26%	0.02%	0.29%	0.04%	0.97%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.81%	0.02%	0.29%	0.05%	1.52%	-0.03%

上证弘利债券 C

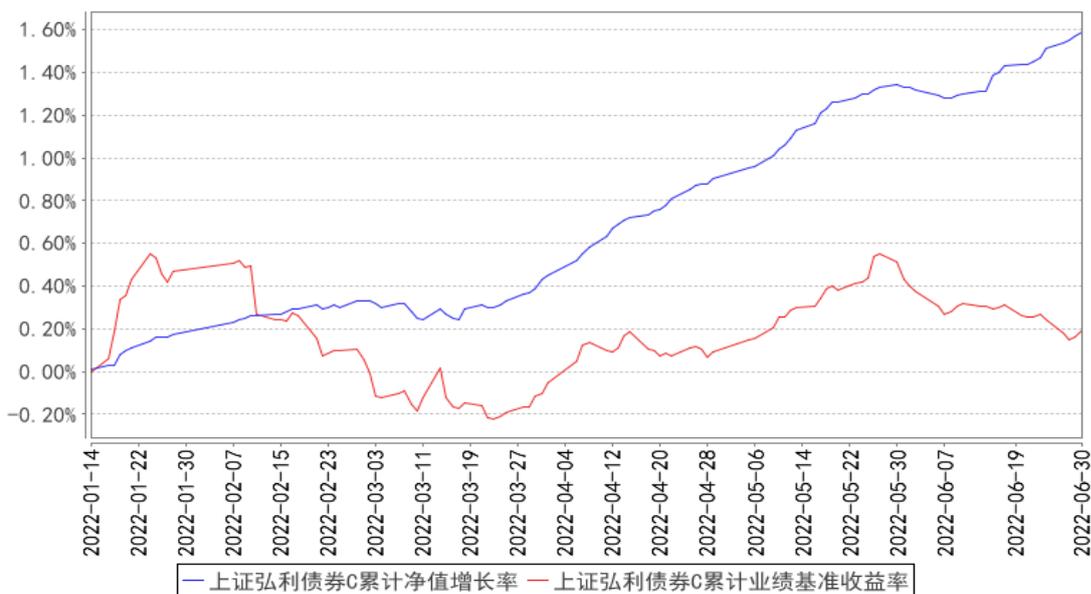
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.26%	0.02%	-0.24%	0.03%	0.50%	-0.01%
过去三个月	1.16%	0.02%	0.29%	0.04%	0.87%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.59%	0.02%	0.19%	0.05%	1.40%	-0.03%

### 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

上证弘利债券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



上证弘利债券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：1、本集合计划合同生效日为 2022 年 1 月 11 日，上证弘利债券 C 自 2022 年 1 月 14 日开放申购和赎回业务，截至 2022 年 6 月 30 日，本集合计划生效不满一年。

### 3.3 其他指标

无

## § 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

上海证券有限责任公司成立于 2001 年 5 月，目前系由百联集团有限公司、国泰君安证券股份有限公司、上海国际集团有限公司、上海上国投资管理有限公司、上海城投（集团）有限公司投资控股的综合类证券公司。公司注册资本 53.26532 亿元。

公司拥有期货子公司 1 家、分公司 5 家以及营业网点 76 家，形成以上海为中心，以长三角、珠三角和京津冀经济圈为主体的经营网络。公司业务范围涵盖场内、场外市场，能为广大投资者提供证券经纪、财富管理、投资咨询等全方位的综合金融服务。

截至 2022 年 6 月 30 日，本集合计划管理人共管理 1 只公募集合资产管理计划，为上海证券弘利债券型集合资产管理计划。

#### 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		
赖海英	投资经理	2022 年 1 月 11 日	-	13	上海师范大学数学教育学士，应用数学硕士。2009 年至 2010 年任金盛保险投资经理，2010 年至 2012 年任中欧基金基金经理助理及基金经理、2013 年至 2015 年任西部证券上海分公司固定收益投资经理，2015 年至 2020 年任太平资产固定收益投资经理，固定收益投资经验丰富，现任上海证券资产管理部高级投资经理。

注：

1、集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为集合计划合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券公司董事、监事、高级管理人员及从业人员管理规则》的相关规定。

4、2022 年 7 月 1 日起赖海英不再担任本集合计划投资经理，本集合计划的投资经理由张乃禄担任。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 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，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本产品产品合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用产品资产，在严格控制风险的基础上，为产品份额持有人谋求利益。本报告期内，本产品运作整体合法合规，没有损害产品份额持有人利益。产品的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及产品合同的规定。

#### 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，管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》与《上海证券资产管理总部公平交易管理实施细则》的规定，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有大集合产品。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本集合计划存在异常交易行为。本报告期内管理人管理的所有大集合产品参与的交易所公开竞价，未出现同日反向交易的情况。

#### 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 年上半年债券市场呈现震荡走势，10 年期国债收益率在 2.68%至 2.85%区间窄幅波动。具体而言，一季度债券市场先涨后跌，年初降息后市场在对宽货币的较高预期以及对经济的悲观预期下，债券市场上涨，1 月份 10 年期国债收益率快速下行，最低下行至 2.68%；春节后总体经济增长尚可，货币政策宽松预期未能兑现，市场开始下跌，3 月上旬 10 年期国债收益率最高上行至 2.85%，收益率绝对水平逐渐回到去年末较高水平。第二季度的 4 月份和 5 月份在上海、北京等地局部疫情负面冲击下国内经济基本面变差，央行实施降准 25BP 并将 5 年期以上 LPR 下调 15BP，资金面则持续宽松，货币市场资金利率持续处于低位，债券市场走出上涨行情，5 月末 10 年期国债收益率最低下行至 2.7%；6 月份在上海、北京等地局部疫情有效控制后逐步复工复产、经济金融数据好于预期等因素影响下债券市场下跌，6 月末 10 年期国债收益率最高上行至 2.84%。2022 年上半年本基金因为持有人集中度较高，规模较小，且刚完成转公募的改造，策略上较为谨慎，以获取绝对收益和维持账户合理的流动性为比较重要的目标。信用及久期结构上以哑铃型结构为主，高评级短久期债券以保持账户合理的流动性，较长久期中等评级债券以提升账户静态收益，同时

严格控制信用风险。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末上证弘利债券 A 基金份额净值为 1.0322 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.81%,同期业绩比较基准收益率为 0.29%;截至本报告期末上证弘利债券 C 基金份额净值为 1.0159 元,本报告期基金份额净值增长率为 1.59%;同期业绩比较基准收益率为 0.19%。

#### 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,疫情防控对经济复苏依然存在较大扰动,而在淡化全年经济增长目标的政策取向,增量稳增长政策大规模出台的概率较小,因此国内经济逐步复苏的趋势会持续,但复苏进程可能较为缓慢和曲折。下半年通胀水平将有所上升,但通胀压力可控。央行将继续执行稳健偏宽松货币政策,保持流动性合理充裕,在美联储快速大幅加息的掣肘下将主要实施结构性宽松政策。整体上判断,下半年债券市场面临经济基本面较弱的现实和稳增长政策的博弈,或将维持震荡的格局。操作上,本基金将采取稳健操作策略,配置上兼顾收益率和流动性要求,根据市场的变化择机调整组合久期和杠杆比例,争取实现更好的回报。

#### 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,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,对基金所持有的投资品种进行估值,本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

#### 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

报告期内,本集合计划未出现连续二十个工作日份额持有人数量不满二百人或者资产净值低于五千万元的情形。

## § 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

本报告期内,广发银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对上海证券弘利债券型集合资

产管理计划（以下称“本计划”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本计划合同和托管协议的有关规定，不存在任何损害本计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本计划合同和托管协议的规定，对本计划管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对本计划资产净值的计算、本计划份额申购赎回价格的计算以及本计划费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本计划管理人存在损害本计划份额持有人利益的行为。

## 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 等数据真实、准确和完整。

# § 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：上海证券弘利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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	15,387,767.54
结算备付金		121,636.16
存出保证金		3,288.55
交易性金融资产	6.4.7.2	195,308,447.99
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		195,308,447.99
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	10,000,000.00
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		-
应收股利		-
应收申购款		2,908,654.04
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		223,729,794.28
<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>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		-
应付清算款		10,000,000.00
应付赎回款		4,006,759.60
应付管理人报酬		47,642.30
应付托管费		5,955.27
应付销售服务费		20,159.28
应付投资顾问费		-
应交税费		39,649.71
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	101,224.35
负债合计		14,221,390.51
<b>净资产:</b>		
实收基金	6.4.7.10	204,450,918.95
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	5,057,484.82
净资产合计		209,508,403.77
负债和净资产总计		223,729,794.28

注：1、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 204,450,918.95 份，其中 A 类基金份额净值 1.0322 元，基金份额总额 110,802,526.41 份；C 类基金份额净值 1.0159 元，基金份额总额 93,648,392.54 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 11 日(合同变更生效日)至 2022 年 6 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：上海证券弘利债券型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 1 月 11 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 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		3,372,008.21
1. 利息收入		94,243.81
其中：存款利息收入	6.4.7.13	22,766.50
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		71,477.31
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,289,677.83
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	3,289,677.83
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	-198,565.83
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	186,652.40
<b>减：二、营业总支出</b>		568,618.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	297,924.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	37,240.67
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	20,159.28
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-
5. 利息支出		28,889.94
其中：卖出回购金融资产支出		28,889.94
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		11,654.39
8. 其他费用	6.4.7.23	172,748.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,803,389.98
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,803,389.98
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		2,803,389.98

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：上海证券弘利债券型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 1 月 11 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 1 月 11 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、本期期初净资产(基金净值)	217,399,424.91	-	2,999,320.50	220,398,745.41
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-12,948,505.96	-	2,058,164.32	-10,890,341.64
(一)、综合收益总额	-	-	2,803,389.98	2,803,389.98
(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)	-12,948,505.96	-	-745,225.66	-13,693,731.62
其中：1. 基金申购款	197,270,850.72	-	3,116,329.71	200,387,180.43
2	-210,219,356.68	-	-3,861,555.37	-214,080,912.05

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、本期末净资产(基金净值)	204,450,918.95	-	5,057,484.82	209,508,403.77

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：

罗国华

张艳红

张艳红

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

上海证券弘利债券型集合资产管理计划由上海证券心安增利债券分级集合资产管理计划变更而来。上海证券心安增利债券分级集合资产管理计划于 2013 年 5 月 21 日正式成立。上海证券心安增利债券分级集合资产管理计划变更获中国证监会机构部函 [2021] 3579 号文批复。自 2022 年 1 月 11 日,《上海证券弘利债券型集合资产管理计划集合资产管理合同》生效,原《上海证券心安增利债券分级集合资产管理计划资产管理合同》自同日起失效。

本集合计划将投资于包括但不限于在交易所/银行间上市交易的国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券等。其中,金融债、企业债、公司债主体评级

且债项评级均在 AA-（含）以上；短期融资券主体评级在 A+（含）以上且债项评级为 A-1；中期票据主体评级在 AA-（含）以上且债项评级在 AA-（含）以上。本集合计划不得投资于可转换债券（含分离交易可转债、可交换债）、非公开定向债务融资工具（PPN）、中小企业私募债及中小企业集合票据。

货币市场工具，包括但不限于现金、银行存款、债券正逆回购、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划以及其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种。

开放期内，持有现金及等价物（银行活期存款、货币市场基金、期限在 1 年内的国债和央行票据、期限为 7 天以内的债券逆回购等）不低于集合计划资产净值的 5%。

本集合计划管理人为上海证券有限责任公司，本集合计划托管人为广发银行股份有限公司。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本集合财务报表按照财政部颁布的企业会计准则、应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》以及中国证券监督管理委员会、中国证券业协会发布的关于基金行业实务操作和《证券公司客户资产管理业务规范》的有关规定以及本集合计划合同的相关约定。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本集合计划采用公历年制，即自每年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产在初始确认时，按照持有意图，结合业务特点和风险管理要求将其分为：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（含衍生金融资产）和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、贷款和应收款项。本集合计划的债券投资和基金投资等项目于初始确认时即划分为交易性金融资产。本集合计划无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。

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：取得该金融资产的目的，主要是为了近期内出售；属于进行集中管理的可辨认金融工具组合的一部分，且有客观证据表明企业近期采用短期获利方式对该组合进行管理；属于衍生工具。但是，被指定且为有效套期工具的衍生工具、属于财务担保合同的衍生工具、与在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产除外。

金融资产符合下列条件之一的，将其确定为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：

1) 对于包括一项或多项嵌入衍生工具的混合工具，如果不是以下两种情况，可将其直接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：嵌入衍生工具对混合工具现金流量没有重大改变；类似混合工具所嵌入的衍生工具，明显不应当从混合工具中分拆；

2) 按金融工具确认和计量准则规定应将某嵌入衍生工具从混合工具中分拆，但分拆时或后续的资产负债表日无法对其进行单独计量的，应将整个混合工具直接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；

3) 对于以上混合工具以外的情形，只有在能够产生更相关的会计信息时，才能将某项金融资产直接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。在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的权益工具投资，不得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。

这类资产在初始计量时按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或已到付息但尚未领取的债券利息，单独确认为应收项目。

② 贷款及应收款项

是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债在初始确认时按承担该负债的目的，结合业务特点和风险管理要求将其分为以下两类：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(含衍生金融负债)和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；其他金融负债。

① 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：取得该金融负债的目的，主要是为

了近期内回购；属于进行集中管理的可辨认金融工具组合的一部分，且有客观证据表明企业近期采用短期获利方式对该组合进行管理；属于衍生工具。但是，被指定且为有效套期工具的衍生工具、属于财务担保合同的衍生工具、与在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融负债除外。

金融负债符合下列条件之一的，将其确定为指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债：

1) 对于包括一项或多项嵌入衍生工具的混合工具，如果不是以下两种情况，可将其直接指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益金融负债：嵌入衍生工具对混合工具现金流量没有重大改变；类似混合工具所嵌入的衍生工具，明显不应当从混合工具中分拆；

2) 按金融工具确认和计量准则规定应将某嵌入衍生工具从混合工具中分拆，但分拆时或后续的资产负债表日无法对其进行单独计量的，应将整个混合工具直接指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；

3) 对于以上混合工具以外的情形，只有在能够产生更相关的会计信息时，公司才能将某项金融负债直接指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

② 其他金融负债包括：划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债，将其划分为其他金融负债。

#### 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) 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入未上市债券和银行间同业市场交易的债券，于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交总额扣除交易费用入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券投资收益；

卖出未上市债券和银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益；

出售债券的成本按移动加权平均法结转。

##### (2) 基金投资

买入基金于交易日确认为基金投资，基金投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出基金于交易日确认为基金投资收益，出售基金的成本按移动加权平均法于交易日或确认日结转。

### (3) 贷款及应收款项

应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额。

### (4) 其他金融负债

其他金融负债以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额。

## 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资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，基金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

本集合计划金融资产和金融负债应当在资产负债表内分别列示，不得相互抵销。但同时满足下列条件的，应当以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 金融资产和金融负债具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- (2) 金融资产和金融负债以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收计划为对外发行的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、赎回引起的实收计划的变动分别于计划申购确认日、赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括计划转换所引起的转入计划的实收计划增加和转出计划的实收计划减少。

#### 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本集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占计划净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回本集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占计划净值比例计算的金额。损益平准金于本集合计划申购确认日或计划赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

- (1) 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提的金额入账；
- (2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率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；
- (3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（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；
- (4) 债券投资收益按卖出债券成交金额（不包含交易手续费）与其成本和应收利息的差额确认；
- (5) 基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额与其成本的差额入账；
- (6) 公允价值变动收益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；
- (7) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 管理人报酬和计划托管费：按照计划合同和计划说明书规定的方法和标准计提，并按计提的金额入账；
- (2) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在证券回购期内逐日计提；

(3) 其他费用：银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费、银行间交易相关维护费、登记结算机构收取的相关费用、货币经纪公司收取的佣金等集合计划运营过程中发生的相关费用，在存续期间发生的信息披露费用、律师费及按照国家有关规定可以列入的其他费用。与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次进入集合计划费用；如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

##### 一、集合计划利润的构成

集合计划利润指集合计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，集合计划已实现收益指集合计划利润减去公允价值变动损益后的余额。

##### 二、集合计划可供分配利润

集合计划可供分配利润指截至收益分配基准日集合计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

##### 三、集合计划收益分配原则

1、本集合计划在符合分红条件的前提下可进行收益分配，每次收益分配比例等具体分红方案见集合计划管理人届时发布的相关分红公告；若本集合计划合同生效不满 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；

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 类计划份额不收取销售服务费，而 C 类计划份额收取销售服务费，各集合计划份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本集合计划同一类别的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。

在不违反法律法规且对集合计划份额持有人利益无实质不利影响的前提下，集合计划管理人与集合计划托管人协商一致后，可对集合计划收益分配原则进行调整，并及时公告，不需召开集合计划份额持有人大会。

##### 四、收益分配方案

集合计划收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、集合计划收益分配对

象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本集合计划收益分配方案由集合计划管理人拟定，并由集合计划托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

#### 六、集合计划收益分配中发生的费用

集合计划收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，集合计划登记机构可将集合计划份额持有人的现金红利自动转为相应类别的集合计划份额。红利再投资的计算方法，依照登记机构的相关业务规则执行。

#### 七、实施侧袋机制期间的收益分配

本集合计划实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

### 6.4.4.12 外币交易

无。

### 6.4.4.13 分部报告

无。

### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

## 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

无。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 6.4.6 税项

主要税项列示如下(集合计划比照基金执行)：

### 1、印花税

根据财政部、国家税务总局《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》，从 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰。

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定从 2008 年 9 月 19 日起，调整证券（股票）交易

印花税征收方式，调整为单边征收，对证券（股票）受让方不再征税。

## 2、增值税

根据财政部、国家税务总局财税〔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〕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》及财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》等相关规定，自2018年1月1日起资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

## 3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字〔2002〕128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税。

## 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	15,387,767.54
等于：本金	15,384,576.01
加：应计利息	3,191.53
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	15,387,767.54

### 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	43,458,036.21	580,226.91	43,936,779.91	-101,483.21
	银行间市场	148,499,088.46	2,525,368.08	151,371,668.08	347,211.54
	合计	191,957,124.67	3,105,594.99	195,308,447.99	245,728.33
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		191,957,124.67	3,105,594.99	195,308,447.99	245,728.33

#### 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

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 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	10,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	10,000,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

##### 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

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

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

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

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	9,797.04
其中：交易所市场	-
银行间市场	9,797.04
应付利息	-
预提费用	91,427.31
合计	101,224.35

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

上证弘利债券 A

项目	本期 2022年1月11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	217,399,424.91	217,399,424.91
本期申购	36,925,039.36	36,925,039.36
本期赎回（以“-”号填列）	-143,521,937.86	-143,521,937.86
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	110,802,526.41	110,802,526.41

上证弘利债券 C

项目	本期 2022 年 1 月 11 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	160,345,811.36	160,345,811.36
本期赎回（以“-”号填列）	-66,697,418.82	-66,697,418.82
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	93,648,392.54	93,648,392.54

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

上证弘利债券 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	2,807,028.99	192,291.51	2,999,320.50
本期利润	2,712,131.72	-220,320.94	2,491,810.78
本期基金份额交易产生的变动数	-1,771,077.83	-155,314.79	-1,926,392.62
其中：基金申购款	1,115,823.64	-60,607.66	1,055,215.98
基金赎回款	-2,886,901.47	-94,707.13	-2,981,608.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,748,082.87	-183,344.21	3,564,738.66

上证弘利债券 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	289,109.25	22,469.95	311,579.20
本期基金份额交易产生的变动数	1,432,261.91	-251,094.95	1,181,166.96
其中：基金申购款	2,455,103.18	-393,989.45	2,061,113.73
基金赎回款	-1,022,841.27	142,894.50	-879,946.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,721,371.16	-228,625.00	1,492,746.16

### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月11日（基金合同生效日）至2022年6月30日
活期存款利息收入	21,020.66
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,692.25
其他	53.59
合计	22,766.50

### 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

无。

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

### 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11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	2,984,128.11
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	305,549.72
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	3,289,677.83

#### 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11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	261,534,381.57
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	254,733,563.84

减：应计利息总额	6,487,207.18
减：交易费用	8,060.83
买卖债券差价收入	305,549.72

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

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

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

#### 6.4.7.19 股利收益

无。

#### 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 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-204,522.80
股票投资	-
债券投资	-204,522.80
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	-5,956.97
合计	-198,565.83

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	186,651.40
其他收入	1.00
合计	186,652.40

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	-1,260.11
信息披露费	71,591.52
证券出借违约金	-
其他费用	102,417.56
合计	172,748.97

#### 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，本集合计划无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本集合计划无需要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

-

##### 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
上海证券有限责任公司	基金管理人、基金销售机构
广发银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 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

无。

###### 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 11 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（%）
上海证券有限责任公司	37,802,282.67	100.27

###### 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 11 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（%）
上海证券有限责任公司	269,200,000.00	100.00

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

## 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 11 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	297,924.98
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.4% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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算，逐日累计至每月月末，按月支付，由集合计划管理人向集合计划托管人发送集合计划管理费划款指令，集合计划托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给集合计划管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 11 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	37,240.67

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算，逐日累计至每月月末，按月支付，由集合计划管理人向集合计划托管人发送集合计划托管费划款指令，集合计划托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 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 11 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		
	上证弘利债券 A	上证弘利债券 C	合计

上海证券有限责任公司	20,159.28	-	20,159.28
合计	20,159.28	-	20,159.28

注：销售服务费用于支付销售机构佣金、营销费用以及集合计划份额持有人服务费等。本集合计划 A 类计划份额不收取销售服务费，C 类计划份额的销售服务费年费率为 0.3%。C 类计划份额的销售服务费按前一日 C 类计划份额的集合计划资产净值的 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 类计划份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类计划份额前一日的集合计划资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由集合计划管理人向集合计划托管人发送销售服务费划款指令，集合计划托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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

无。

#### 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

无。

##### 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

无。

#### 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 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
	上证弘利债券 A	上证弘利债券 C
基金合同生效日（2022 年 1 月 11 日）持有的基金份额	29,000,000.00	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-

减：报告期内赎回/卖出总份额	29,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	-

**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**

无。

**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11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
广发银行股份有限公司	15,387,767.54	21,020.66

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本集合计划于2022年6月24日申购了漳州市九龙江集团有限公司公开发行2022年公司债券（第四期）（债券代码为“185930”）1000万元。该债券承销商国泰君安证券股份有限公司为我司的关联方。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

无。

**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**

无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

**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**

无。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

-

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 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

本产品在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本产品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。

本产品管理人建立了由董事会及风险控制委员会、经理层及风险管理委员会与首席风险官、风险管理总部及其他相关职能部门，业务部门及分支机构的四层级全面风险管理组织体系，明确了各层级在全面风险管理中的职责。其中，董事会是公司全面风险管理的最高决策机构，承担全面风险管理的最终责任，董事会下设风险控制委员会，协助董事会履行相应风险管理职责；公司经理层是公司风险管理策略的最终执行人，对全面风险管理承担主要责任，总经理下设风险管理委员会，协助履行相应风险管理职责；公司设首席风险官，首席风险官负责组织、落实经营层面的全面风险管理工作；风险管理总部在首席风险官的领导下推动全面风险管理工作，风险管理总部是公司市场风险、操作风险、信用风险、流动性风险的归口管理部门；公司各业务部门、分支机构及负责人承担风险管理的直接责任。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指产品在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者产品所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致产品资产损失和收益变化的风险。本产品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。本集合计划持有一家公司发行的证券，其市值不超过集合计划资产净值的 10%，且本集合计划管理人管理的全部大集合计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。

本产品在进行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；产品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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本产品报告期末未持有按短期信用评级列示的债券。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本产品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

本产品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
AAA	55,538,207.72
AAA 以下	76,848,187.14
未评级	52,985,376.02
合计	185,371,770.88

注：未评级债券包括国债及政策性金融债，债券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

本产品本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日
AAA	9,936,677.11
AAA 以下	-
未评级	-
合计	9,936,677.11

注：本表主要列示同业存单，评级取自第三方评级机构的主体评级。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指产品管理人未能以合理价格及时变现产品资产以支付投资者赎回款项的风险。本产品的流动性风险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，另一方面来自于产品份额持有人可依据产品合同约定要求赎回其持有的产品份额。

本产品管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本产品的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本产品组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本产品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，除在附注 6.4.12 中列示的部分产品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。此外，本产品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，其上限一般不超过产品持有的债券资产的公允价值。于 2022 年 6 月 30 日，本产品所承担的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回产品份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额

约为未折现的合约到期现金流量。

本产品管理人每日预测本产品的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本产品的产品管理人严格按照《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开放式产品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，对本产品组合资产的流动性风险进行管理。在日常运作中，本产品的流动性安排能够与产品合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。本产品的产品管理人在产品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模式带来的流动性风险，有效保障产品持有人利益。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指产品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

利率风险是指产品所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本产品所面临的利率风险主要来源于本产品所持有的生息资产。本产品的生息资产主要为银行存款、结算备付金、结算保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

##### 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	15,387,767.54	-	-	-	15,387,767.54
结算备付金	121,636.16	-	-	-	121,636.16
存出保证金	3,288.55	-	-	-	3,288.55
交易性金融资产	74,825,889.32	120,482,558.67	-	-	195,308,447.99
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
应收申购款	-	-	-	2,908,654.04	2,908,654.04
资产总计	100,338,581.57	120,482,558.67	-	2,908,654.04	223,729,794.28
负债					
应付清算款	-	-	-	10,000,000.00	10,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	4,006,759.60	4,006,759.60
应付管理人报酬	-	-	-	47,642.30	47,642.30
应付托管费	-	-	-	5,955.27	5,955.27
应付销售服务费	-	-	-	20,159.28	20,159.28

应付税费	-	-	-	39,649.71	39,649.71
其他负债	-	-	-	101,224.35	101,224.35
负债总计	-	-	-	14,221,390.51	14,221,390.51
利率敏感度缺口	100,338,581.57	120,482,558.67	-	-11,312,736.47	209,508,403.77

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率外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）
分析	市场利率下降 25 基点	499,386.52
	市场利率上升 25 基点	-495,722.00

#### 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。本产品的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

假设	-	
	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	相对人民币升值 5%	-
	相对人民币贬值 5%	-

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指产品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。本产品主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于 2022 年 6 月 30 日，本产品无重大价格风险。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

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
第一层次	-
第二层次	195,308,447.99
第三层次	-
合计	195,308,447.99

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

无。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 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	195,308,447.99	87.30
	其中：债券	195,308,447.99	87.30
	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	10,000,000.00	4.47
	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	15,509,403.70	6.93
8	其他各项资产	2,911,942.59	1.30
9	合计	223,729,794.28	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

本集合计划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

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

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

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

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

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	10,650,491.09	5.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	42,334,884.93	20.21
	其中：政策性金融债	42,334,884.93	20.21
4	企业债券	53,449,571.58	25.51
5	企业短期融资券	33,478,312.33	15.98
6	中期票据	45,458,510.95	21.70
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	9,936,677.11	4.74
9	其他	-	-
10	合计	195,308,447.99	93.22

### 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	180211	18 国开 11	300,000	31,532,021.92	15.05
2	140205	14 国开 05	100,000	10,802,863.01	5.16
3	185655	22 津投 06	100,000	10,226,232.88	4.88
4	012103869	21 常城建 SCP011	100,000	10,198,539.73	4.87
5	012104022	21 广州高新 SCP003	100,000	10,197,178.08	4.87

### 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

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

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

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

本集合计划本报告期末无国债期货投资。

#### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末无国债期货投资。

### 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

无。

### 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

本集合计划本报告期末未持有股票。

### 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	3,288.55
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,908,654.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,911,942.59

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本集合计划本报告期末未持有股票。

## § 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 (%)
上证弘利 债券 A	323	343,041.88	17,790,193.74	16.06	93,012,332.67	83.94
上证弘利 债券 C	126	743,241.21	26,641,541.12	28.45	67,006,851.42	71.55
合计	449	455,347.26	44,431,735.00	21.73	160,019,184.00	78.27

### 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	上证弘利债券 A	7,269,625.36	6.5600
	上证弘利债券 C	5,437,848.13	5.8100

有本基金			
	合计	12,707,473.49	6.2200

### 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

无。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	上证弘利债券 A	上证弘利债券 C
基金合同生效日 (2022 年 1 月 11 日) 基金份额总额	217,399,424.91	-
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	36,925,039.36	160,345,811.36
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	143,521,937.86	66,697,418.82
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	110,802,526.41	93,648,392.54

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开份额持有人大会。

### 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、报告期内基金管理人的重大人事变动

本集合计划管理人于 2022 年 2 月 16 日发布《上海证券有限责任公司高级管理人员变更公告》，自 2022 年 2 月 14 日起，罗国华先生担任公司总经理；张艳红女士担任公司副总经理。

#### 2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期末改聘会计师事务所。

#### 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，管理人、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 (%)	
上海证券有限责任公司	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 (%)
上海证券有限责任公司	37,802,282.67	100.00	269,200,000.00	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	上海证券弘利债券型集合资产管理计划（C类份额）产品资料概要	中国证监会规定的媒介	2022年01月07日
2	上海证券弘利债券型集合资产管理计划（A类份额）产品资料概要	中国证监会规定的媒介	2022年01月07日
3	上海证券弘利债券型集合资产管理计划招募说明书	中国证监会规定的媒介	2022年01月07日
4	上海证券弘利债券型集合资产管理计划托管协议	中国证监会规定的媒介	2022年01月07日
5	上海证券弘利债券型集合资产管理计划集合资产管理合同	中国证监会规定的媒介	2022年01月07日

6	上海证券弘利债券型集合资产管理计划合同生效公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 01 月 11 日
7	上海证券弘利债券型集合资产管理计划开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 01 月 11 日
8	上海证券弘利债券型集合资产管理计划开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 01 月 14 日
9	上海证券有限责任公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 02 月 16 日
10	上海证券有限责任公司关于旗下上海证券弘利债券型集合资产管理计划发生巨额赎回并实施延期赎回的公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 04 月 15 日
11	上海证券弘利债券型集合资产管理计划 2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定的媒介	2022 年 04 月 22 日
12	关于上海证券弘利债券型集合资产管理计划在上海证券渠道开展申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 06 月 01 日
13	关于上海证券弘利债券型集合资产管理计划申购关联公司承销债券的公告	中国证监会规定的媒介	2022 年 06 月 28 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	20220112-20220331	63,098,440.16	0.00	0.00	63,098,440.16	30.8600
	2	20220401-20220516	63,098,440.16	0.00	63,098,440.16	0.00	0.0000
产品特有风险							

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《上海证券弘利债券型集合资产管理计划集合资产管理合同》
- 2、《上海证券弘利债券型集合资产管理计划托管协议》

- 3、法律意见书
- 4、集合计划管理人业务资格批件和营业执照
- 5、集合计划托管人业务资格批件和营业执照
- 6、中国证监会要求的其他文件

## 12.2 存放地点

上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼。

## 12.3 查阅方式

投资者可通过管理人网站 (<https://www.shzq.com/>) 或致电 4008-918-918 查询, 或在营业时间内至集合计划管理人、托管人的办公场所免费查阅。

上海证券有限责任公司

2022 年 8 月 31 日