

海通核心优势一年持有期混合型集合资产 管理计划 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 30 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、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。本年度报告已经全部董事签字同意，并由董事长签发。

集合计划托管人交通银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2021 年 3 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。

本报告的财务资料经审计，立信会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 4 月 8 日起至 2020 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21

§ 8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
8.3 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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
8.6 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	52
8.7 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	52
8.8 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	53
8.9 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	53
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	53
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
8.12 投资组合报告附注	53
§ 9 基金份额持有人信息	54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
9.3 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	55
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	55
§ 10 开放式基金份额变动	55
§ 11 重大事件揭示	56
11.1 基金份额持有人大会决议	56
11.2 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	56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
11.4 基金投资策略的改变	56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
11.8 其他重大事件	57
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	59
12.1 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	59
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 13 备查文件目录	59
13.1 备查文件目录	59
13.2 存放地点	59
13.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划		
基金简称	海通核心优势		
基金主代码	850005		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020 年 4 月 8 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	交通银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	2,706,868,503.68 份		
基金合同存续期	自合同变更生效日起存续期不得超过 3 年		
下属分级基金的基金简称	海通核心优势 A	海通核心优势 B	海通核心优势 C
下属分级基金的交易代码	850588	850005	850599
报告期末下属分级基金的份额总额	2,510,031,383.79 份	67,261,590.39 份	129,575,529.50 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的增值。
投资策略	<p>本集合计划将综合运用定量分析和定性分析手段，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定大类资产相对最优的配置比例，定期或不定期地进行调整，以达到规避风险及提高收益的目的。</p> <p>股票投资策略：本集合计划坚持“成长与价值并重”的选股理念，采用“自上而下与自下而上相结合”的研究方法，根据宏观经济发展趋势及国家政策导向，在可理解可跟踪的行业内，采用定性和定量相结合的方法，严选具有核心优势的股票构建组合。</p> <p>债券投资策略：本集合计划将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。</p> <p>资产支持证券投资策略：本集合计划将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>股指期货投资策略：管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、合约选择，谨慎地进行投资，旨在通过股指期货实现组合风险敞口管理的目标。</p> <p>股票期权投资策略：本集合计划投资于股票期权按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好的期权合约进行投资。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×50%+中证港股通综合指数收益率×20%+中

	证全债指数收益率×30%
风险收益特征	本集合计划是一只混合型集合计划，其预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型集合计划和货币市场基金，低于股票型基金、股票型集合计划。

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		上海海通证券资产管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李雪	陆志俊
	联系电话	95553	95559
	电子邮箱	htam@htsec.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		95553	95559
传真		021-63410460	021-62701216
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 188 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）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200001	200336
法定代表人		裴长江	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.htsamc.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区南京东路 61 号 4 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）-2020 年 12 月 31 日		
	海通核心优势 A	海通核心优势 B	海通核心优势 C
本期已实现收益	16,224,026.99	470,026.55	417,916.06
本期利润	481,549,795.59	13,221,337.04	23,897,133.45
加权平均	0.2439	0.1914	0.2353

基金份额 本期利润			
本期加权 平均净值 利润率	22.40%	17.91%	21.66%
本期基金 份额净值 增长率	19.40%	19.39%	19.02%
3.1.2 期 末数据和 指标	2020 年末		
期末可供 分配利润	17,276,192.26	458,337.14	450,060.41
期末可供 分配基金 份额利润	0.0069	0.0068	0.0035
期末基金 资产净值	2,996,939,962.82	80,303,987.40	154,224,025.94
期末基金 份额净值	1.1940	1.1939	1.1902
3.1.3 累 计期末指 标	2020 年末		
基金份额 累计净值 增长率	19.40%	19.39%	19.02%

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

海通核心优势 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

过去三个月	10.58%	0.87%	8.40%	0.64%	2.18%	0.23%
过去六个月	18.97%	0.96%	12.96%	0.84%	6.01%	0.12%
自基金合同生效起 至今	19.40%	0.80%	19.89%	0.78%	-0.49%	0.02%

海通核心优势 B

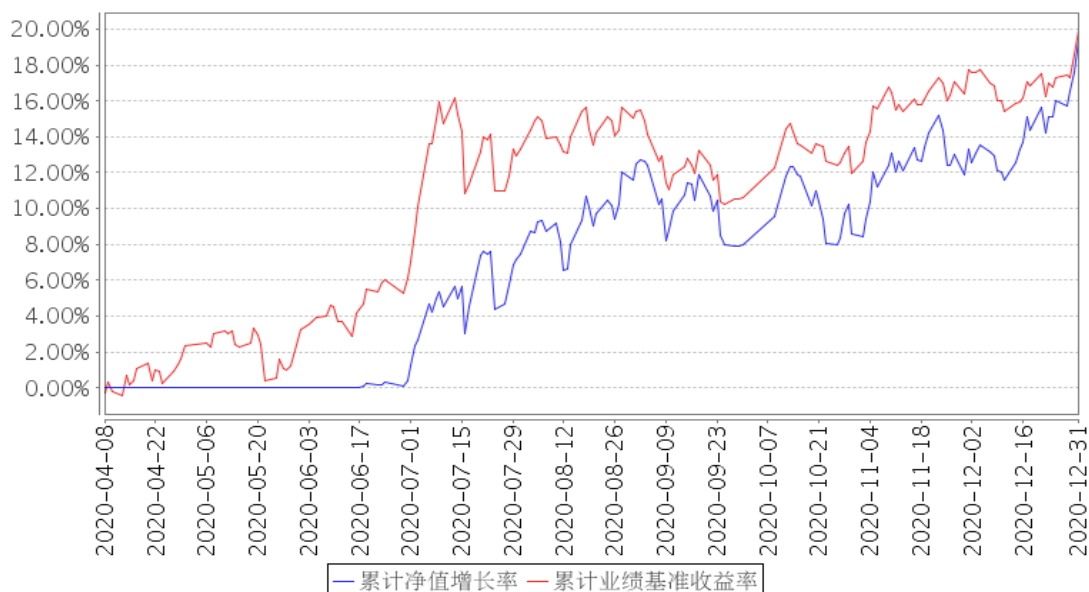
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.57%	0.87%	8.40%	0.64%	2.17%	0.23%
过去六个月	18.97%	0.96%	12.96%	0.84%	6.01%	0.12%
自基金合同生效起 至今	19.39%	0.80%	19.89%	0.78%	-0.50%	0.02%

海通核心优势 C

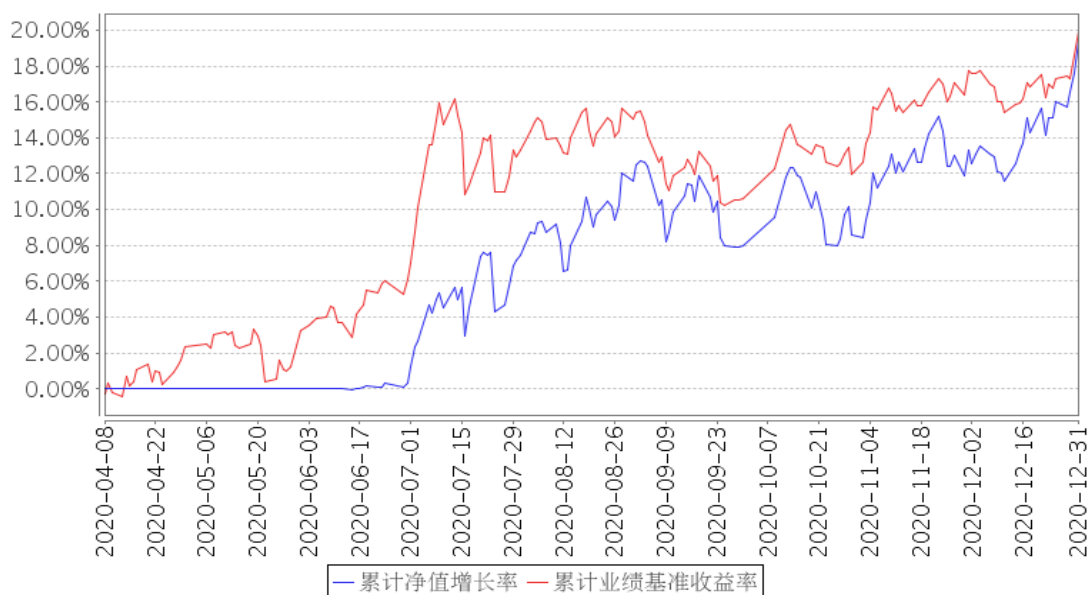
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.43%	0.87%	8.40%	0.64%	2.03%	0.23%
过去六个月	18.68%	0.96%	12.96%	0.84%	5.72%	0.12%
自基金合同生效起 至今	19.02%	0.80%	19.89%	0.78%	-0.87%	0.02%

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

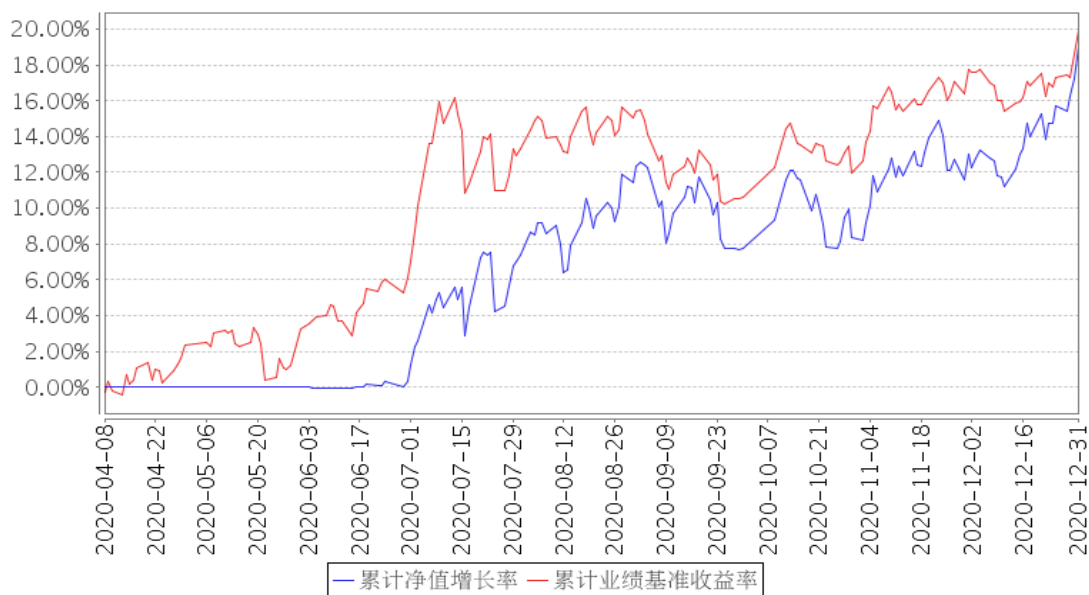
海通核心优势A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



海通核心优势B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



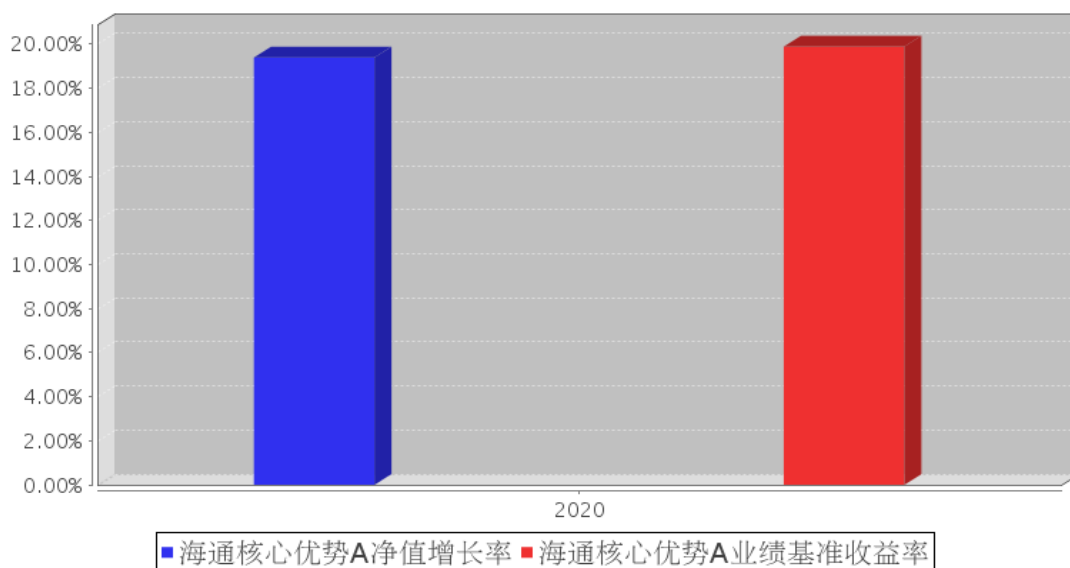
海通核心优势C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



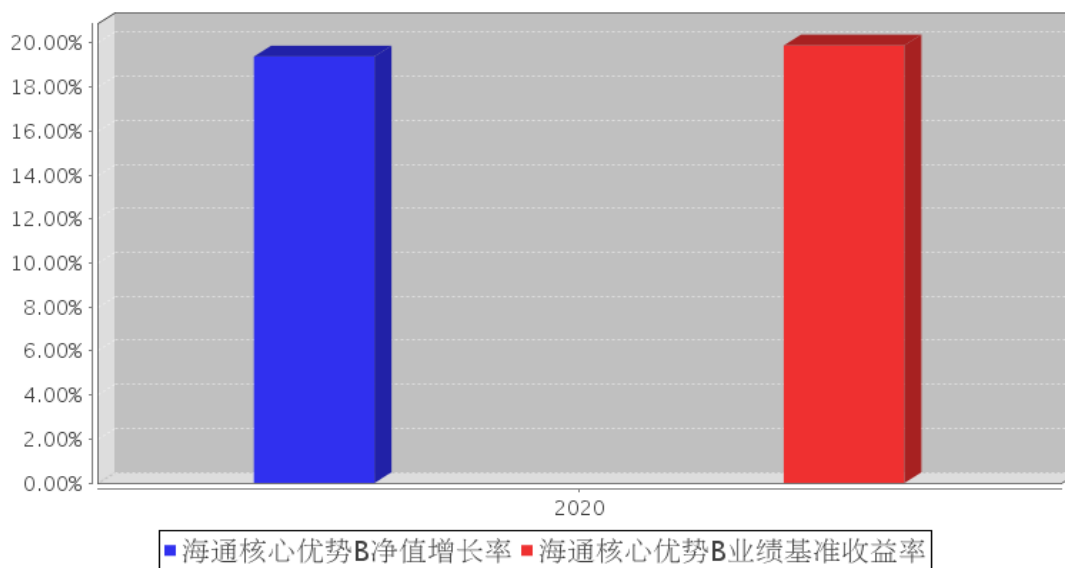
注：图示日期为 2020 年 4 月 8 日至 2020 年 12 月 31 日。按集合计划合同规定，本集合计划自合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告日本集合计划的各项投资比例已达到集合计划合同第十二部分（二）投资范围：本集合计划股票资产占集合计划总资产的 50%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的 0%-50%），投资于本集合计划界定的核心优势相关证券的比例不低于非现金集合计划资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的保证金后，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

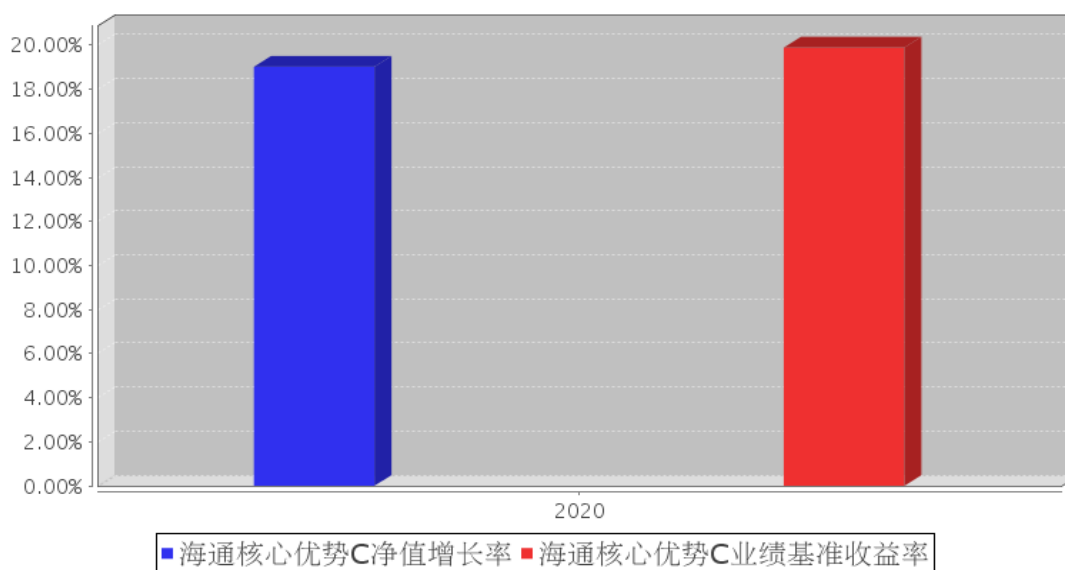
海通核心优势A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



海通核心优势B基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



海通核心优势C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

海通核心优势 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020 年	-	0.00	-	0.00	-
合计	-	0.00	-	0.00	-

海通核心优势 B

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020 年	-	0.00	-	0.00	-

合计	-	0.00	-	0.00	-
----	---	------	---	------	---

海通核心优势 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020 年	-	0.00	-	0.00	-
合计	-	0.00	-	0.00	-

注：本集合计划2020年4月8日（合同生效日）至2020年12月31日未进行利润分配。

§ 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

本集合资产管理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。公司的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，覆盖主动权益、固收、量化、现金管理、另类投资、ABS、QDII 等全业务产品线。

截至 2020 年 12 月 31 日，集合资产管理计划管理人共管理 1 只公募集合资产管理计划，即海通核心优势一年持有期混合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		
李天舒	权益二部总监	2017 年 5 月 16 日	-	11 年	李天舒女士，厦门大学经济学学士、中山大学管理学硕士、CPA。2014 年 11 月加入海通资管，现任权益二部总监，海通核心优势、海通海蓝内需价值优选、海通滴石 2 号集合计划投资主办人，曾任海富系列、海汇系列、海通博观睿选集合计划投资主办人。曾先后就职于安永咨询、海通证券股份有限公司，积累了丰富的财务咨询、投资银行、资产管理专业经验。具备扎实的投资管理理论基础，和对资本市场全产业链的深刻理解。 李天舒女士自 2017 年 5 月 16 日任职海通新兴成长集合计划投资主办人，海通新兴成长集合计划经证监会批准参公运作并更名为海通核心优势一年持有期混合型集合

					资产管理计划，海通核心优势资产管理合同于 2020 年 4 月 8 日生效。
--	--	--	--	--	--

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
李天舒	公募基金	1	3,231,467,976.16	2017 年 5 月 16 日
	私募资产管理计划	2	184,054,586.16	2017 年 9 月 4 日
	其他组合	-	-	-
	合计	3	3,415,522,562.32	-

4.1.4 基金经理薪酬机制

公司用薪酬管理办法作为薪酬管理机制，根据员工不同的工作内容及工作职责，设立不同序列、不同职级以及不同职等。基金经理薪酬严格按照薪酬管理办法进行管理。

基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，该基金经理的薪酬激励不直接与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的具体要求，建立了与公平交易相关的管理制度，通过集中交易和公平的交易分配制度，确保管理的各产品享有公平的交易执行机会，同时定期对同向交易、反向交易等进行监控和分析，通过对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，确保公司在投资管理活动中公平对待各投资组合，避免利益冲突、切实防范利益输送行为。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本集合计划的管理人严格按照《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等有关法规要求加强对兼任私募资产管理计划的投资经理的投资交易行为管理和公平交易监控，确保公平对待所管理的公私募投资组合，防范利益输送行为，避免利益冲突。

4.3.3 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

本集合计划于 2020 年 6 月 10 日完成公募化改造后的首次集中募集，并于次日开始股票建仓。建仓初期，我们在化工、建材等顺周期行业做了优先布局，后续在消费、医药、先进制造等长线看好方向择机加仓。因为公募化改造后首次集中募集时间里，资金配置在不同久期的中短债、银行存单等，建仓后按资金回流分批建仓，报告期内取得了较为良好的回报，未能跑赢同期业绩比较基准。

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 1.1940 元，B 份额净值为 1.1939 元，C 份额净值为 1.1902 元。本报告期集合计划三类份额净值增长率分别为 19.40%、19.39%、19.02%，业绩比较基准收益率为 19.89%。

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 2021 年，我们认为中国经济增长将继续维持全球领先，欧美等国家在春季疫情小高峰过后有望延续经济复苏。根据央行易纲行长公开发言以及中央经济工作会议，中国货币政策或将比 2020 年稍微收紧，但收紧幅度预计将较为温和，中国经济增长节奏全年看将呈现前高后低走势。股票市场短期上涨过快积累的估值泡沫，预期将通过 2021 年的上市公司业绩抬升修复，2021 年股票预期回报率应有所下调，同时波动可能加大，但资本市场对外开放、全面注册制、居民理财方式的转变等趋势未变，中国股票市场长期慢牛的趋势仍在序幕中。2021 年，我们将继续顺周期打底、逐步加仓优质长线成长股，在消费升级、制造业升级这两个我们长期看好的方向持续深耕，在选股上并非简单的“以大为美”，尽可能多地围绕成长空间、竞争格局、公司竞争优势、公司治理有效性等维度做价值发现的工作，力争为投资者创造长期超额回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本管理人从合法合规运作、切实维护投资人合法利益的角度出发，持续推进全面风险管理理念，优化公司内部控制体系，更新完善相关内控制度和业务流程，强化员工合规和

风险意识，不断推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。本管理人秉持客观、公正的原则，通过系统监控、合规审核、信息披露、现场检查等一系列方式开展监察稽核工作，加强了风险控制与合规管理的力度，推动了内控管理体系的落实。

本集合计划管理人将继续本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理集合计划资产，加强风险控制与合规管理，确保集合计划份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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

2020 年度，集合计划托管人在海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害集合计划持有人利益的行为。

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

2020 年度，上海海通证券资产管理有限公司在海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划投资运作、集合计划资产净值的计算、集合计划份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害集合计划持有人利益的行为。

本报告期内本集合计划未进行收益分配，符合集合计划合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2020 年度，由上海海通证券资产管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2021]第 ZA30160 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	我们审计了上海海通证券资产管理有限公司（以下简称“集合计划管理人”）作为集合计划管理人的海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划（以下简称“海通核心优势”）的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年 4 月 8 日（合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日的利润表、所有者权益（集合计划净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的行业实务操作编制，公允反映了海通核心优势 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 4 月 8 日（合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于海通核心优势，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	集合计划管理人对其他信息负责。其他信息包括海通核心优势 2020 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，

	<p>在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>集合计划管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，集合计划管理人管理层负责评估海通核心优势的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>集合计划管理人治理层负责监督海通核心优势的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（三）评价集合计划管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四）对集合计划管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对海通核心优势持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致海通核心优势不能持续经营。</p> <p>（五）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，</p>

	并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与集合计划管理人就审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	黄晔	迟媛
会计师事务所的地址	上海市黄浦区南京东路 61 号 4 楼	
审计报告日期	2021 年 3 月 30 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	4,986,597.93
结算备付金		25,471,189.93
存出保证金		481,964.46
交易性金融资产	7.4.7.2	3,014,443,688.47
其中：股票投资		2,852,977,505.69
基金投资		-
债券投资		161,466,182.78
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	200,000,000.00
应收证券清算款		284,446.76
应收利息	7.4.7.5	3,279,593.82
应收股利		212,462.92
应收申购款		48,737.55
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		3,249,208,681.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-

卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		303.45
应付赎回款		-
应付管理人报酬		2,088,319.37
应付托管费		313,247.93
应付销售服务费		62,023.82
应付交易费用	7.4.7.7	4,912.76
应交税费		15,133,898.35
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	138,000.00
负债合计		17,740,705.68
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	2,706,868,503.68
未分配利润	7.4.7.10	524,599,472.48
所有者权益合计		3,231,467,976.16
负债和所有者权益总计		3,249,208,681.84

注：（1）报告截止日 2020 年 12 月 31 日，海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划 A 类份额净值 1.1940 元，份额总额 2,510,031,383.79 份。海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划 B 类份额净值 1.1939 元，份额总额 67,261,590.39 份，海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划 C 类份额净值 1.1902 元，份额总额 129,575,529.50 份。

（2）本财务报表的实际编制期间为 2020 年 4 月 8 日（合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		536,145,862.76
1. 利息收入		13,460,764.24
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,118,074.37
债券利息收入		7,281,767.98
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		5,060,921.89
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		21,128,802.04
其中：股票投资收益	7.4.7.12	11,995,715.78

基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,688,794.93
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	10,821,881.19
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	501,556,296.48
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-
减：二、费用		17,477,596.68
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	13,599,191.84
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,039,878.82
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	401,330.47
4. 交易费用	7.4.7.19	1,216,719.07
5. 利息支出		7,867.52
其中：卖出回购金融资产支出		7,867.52
6. 税金及附加		67,442.93
7. 其他费用	7.4.7.20	145,166.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		518,668,266.08
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		518,668,266.08

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	72,102,254.55	-	72,102,254.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	518,668,266.08	518,668,266.08
三、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）	2,634,766,249.13	5,931,206.40	2,640,697,455.53
其中：1. 基金申购款	2,639,606,913.29	6,110,146.43	2,645,717,059.72

2. 基金赎回款	-4,840,664.16	-178,940.03	-5,019,604.19
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,706,868,503.68	524,599,472.48	3,231,467,976.16

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于 2020 年 3 月 13 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2020]535 号）批准，《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》于 2020 年 4 月 8 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，托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海通核心优势一年持有期混合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股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、债券回购、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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：股票资产占集合计划总资产的 50%-95%（投资于港股通标的

股票的比例合计占股票资产的 0%-50%)，投资于本集合计划界定的核心优势相关证券的比例不低于非现金集合计划资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的保证金后，现金或到期日在一年期以内的政府债券不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。本集合计划将港股通标的股票投资的比例下限设为零，本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股通标的股票或选择不将集合计划资产投资于港股通标的股票，集合计划资产并非必然投资港股通标的股票。

如果法律法规或监管机构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证 800 指数收益率×50%+中证港股通综合指数收益率×20%+中证全债指数收益率×30%。

7.4.2 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》、《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划 2020 年 4 月 8 日(计划合同生效日)至 2020 年 12 月 31 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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 4 月 8 日(计划合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和集合计划净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.4.1 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 2020 年 4 月 8 日(计划合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划的记账本位币为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本集合计划对金融资产的持有意图和持有能力。本集合计划现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本集合计划目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本集合计划持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。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及其他金融负债。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。本集合计划持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本集合计划成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本集合计划将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，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，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算计划持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬、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。

7.4.4.11 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可进行收益分配，具体分红方案见管理人根据集合计划运作情况届时不定期发布的相关分红公告，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；若投资者选择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，再投资集合计划份额的持有期限与原持有集合计划份额相同（红利再投资取得的 A 类份额和 C 类份额，其锁定持有期的起算日与原持有集合计划份额相同）；

（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、B 类和 C 类份额的费用收取方式存在不同，集合计划各份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本集合计划每一类别下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。

7.4.4.12 外币交易

本集合计划本报告期无外币交易。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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。

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。

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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《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[2016]36号文《财政部、国家税务总局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号文《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号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本集合计划适用的主要税项列示如下：

(1)对集合计划管理人运用集合计划买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(2)自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日(含)以后，集合计划管理人(以下称管理人)运营集合计划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。对集合计划在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。

对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(3)集合计划作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对

价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 集合计划卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 对投资者从集合计划分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(6) 对集合计划在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照集合计划管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	4,986,597.93
定期存款	-
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	-
合计	4,986,597.93

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,336,805,867.77	2,852,977,505.69	516,171,637.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	30,992,182.78	1,217,127.45
	银行间市场	130,474,000.00	-785,780.00
	合计	161,466,182.78	431,347.45
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,497,840,703.10	3,014,443,688.47	516,602,985.37

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	200,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	200,000,000.00	-

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	636.01
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	12,750.10
应收债券利息	3,322,026.16
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-56,054.42
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	235.97
合计	3,279,593.82

注：其他包括应收结算保证金利息、应收沪港通风控资金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本集合计划本报告期末其他资产无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	4,912.76
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,912.76

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	-
预提费用	138,000.00
合计	138,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

海通核心优势 A

项目	本期 2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	2,510,031,383.79	2,510,031,383.79
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
-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	2,510,031,383.79	2,510,031,383.79

海通核心优势 B

项目	本期 2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	72,102,254.55	72,102,254.55
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-4,840,664.16	-4,840,664.16
-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	67,261,590.39	67,261,590.39

海通核心优势 C

项目	本期 2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	129,575,529.50	129,575,529.50
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
-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	129,575,529.50	129,575,529.50

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

海通核心优势 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	-	-	-
本期利润	16,224,026.99	465,325,768.60	481,549,795.59
本期基金份额交易产生的变动数	1,052,165.27	4,306,618.17	5,358,783.44
其中：基金申购款	1,052,165.27	4,306,618.17	5,358,783.44
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,276,192.26	469,632,386.77	486,908,579.03

海通核心优势 B

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	470,026.55	12,751,310.49	13,221,337.04
本期基金份额交易产生的变动数	-11,689.41	-167,250.62	-178,940.03
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-11,689.41	-167,250.62	-178,940.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	458,337.14	12,584,059.87	13,042,397.01

海通核心优势 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	417,916.06	23,479,217.39	23,897,133.45
本期基金份额交易产生的变动数	32,144.35	719,218.64	751,362.99

动数			
其中：基金申购款	32,144.35	719,218.64	751,362.99
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	450,060.41	24,198,436.03	24,648,496.44

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
活期存款利息收入		405,472.27
定期存款利息收入		428,899.44
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		277,025.65
其他		6,677.01
合计		1,118,074.37

注：其他包括结算保证金利息收入、沪港通风控资金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
卖出股票成交总额		27,022,501.04
减：卖出股票成本总额		15,026,785.26
买卖股票差价收入		11,995,715.78

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额		1,057,422,329.72
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额		1,022,165,186.20
减：应收利息总额		36,945,938.45

买卖债券差价收入	-1,688,794.93
----------	---------------

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本集合计划本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 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。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	10,821,881.19
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	10,821,881.19

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	516,602,985.37
股票投资	516,171,637.92
债券投资	431,347.45
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	15,046,688.89
合计	501,556,296.48

7.4.7.18 其他收入

注：本集合计划本报告期无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	1,213,044.07
银行间市场交易费用	3,675.00
合计	1,216,719.07

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日
审计费用	14,753.79
信息披露费	119,552.24
证券出借违约金	-
银行费用	1,560.00
账户维护费	9,300.00
合计	145,166.03

7.4.7.21 分部报告

本集合计划本报告期无分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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”）	集合计划管理人、集合计划销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	集合计划托管人、集合计划代销机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	集合计划管理人的股东、集合计划代销机构

7.4.10 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。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
海通证券	2,378,855,154.07	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
海通证券	464,330,182.60	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
海通证券	35,079,264,000.00	100.00

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31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	318,707.61	100.00	4,912.76	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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	13,599,191.84
其中：支付销售机构的客户维护费	6,214,411.02

注：本集合计划的固定管理费按前一日集合计划资产净值的 0.8% 年费率计提。固定管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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

集合计划固定管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

在本集合计划投资者赎回日和集合计划终止日，管理人将根据投资者的期间年化收益率，对 B 类计划份额期间年化收益率超过 10% 以上部分按照 20% 的比例收取管理人业绩报酬；对 A 类或 C 类计划份额期间年化收益率超过 8% 以上部分按照 20% 的比例收取业绩报酬。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,039,878.82

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.12% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.12\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各	本期
	2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日

关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	海通核心优势 A	海通核心优势 B	海通核心优势 C	合计
海通证券	-	-	385,420.00	385,420.00
海通资管直销	-	-	359.81	359.81
合计	-	-	385,779.81	385,779.81

注：C类份额的销售服务费按前一日C类份额资产净值的0.5%年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本集合计划本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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 2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日	本期 2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日	本期 2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日
	海通核心优势 A	海通核心优势 B	海通核心优势 C
基金合同生效日 （2020年4月8日）	-	9,255,132.76	-

日)持有的基金份额			
报告期初持有的基金份额	-	9,255,132.76	-
报告期间申购/买入总份额	199,980,002.00	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	199,980,002.00	9,255,132.76	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.97%	13.76%	-

7.4.10.5.2 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

海通核心优势 A

关联方名称	本期末 2020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 (%)
海通证券股份有限公司	49,995,000.50	1.99

份额单位: 份

海通核心优势 B

关联方名称	本期末 2020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 (%)
海通证券股份有限公司	47,166,761.51	70.12

7.4.10.6 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 2020年4月8日(基金合同生效日)至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	4,986,597.93	405,472.27

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位: 人民币元

本期 2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额
海通证券股份有限公司	688981	中芯国际	网上新股申购	500	13,730.00

注：关联方海通证券股份有限公司为中芯国际科创板首次公开发行股票并上市的联席保荐机构（主承销商）之一。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

注：本集合计划本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	15.18	15.18	129	1,958.22	1,958.22	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股未上市	15.27	15.27	110	1,679.70	1,679.70	-
300860	锋尚文化	2020年8月6日	2021年2月24日	新股流通受限	138.02	126.67	372	51,343.44	47,121.24	-
300867	圣元环保	2020年8月12日	2021年2月24日	新股流通受限	19.34	31.97	1,451	28,062.34	46,388.47	-
300868	杰美特	2020年8月12日	2021年2月24日	新股流通受限	41.26	43.28	461	19,020.86	19,952.08	-
300870	欧陆通	2020年8月13日	2021年2月24日	新股流通受限	36.81	65.67	383	14,098.23	25,151.61	-
300881	盛德鑫泰	2020年8月25日	2021年3月1日	新股流通受限	14.17	32.31	245	3,471.65	7,915.95	-

		日	日								
300882	万胜智能	2020年 8月27 日	2021年 3月10 日	新股流 通受限	10.33	25.79	336	3,470.88	8,665.44		-
300886	华业香料	2020年 9月8日	2021年 3月16 日	新股流 通受限	18.59	45.67	121	2,249.39	5,526.07		-
300887	谱尼测试	2020年 9月9日	2021年 3月16 日	新股流 通受限	44.47	74.52	166	7,382.02	12,370.32		-
300893	松原股份	2020年 9月17 日	2021年 3月24 日	新股流 通受限	13.47	35.08	212	2,855.64	7,436.96		-
300894	火星人	2020年 12月24 日	2021年 7月1 日	新股流 通受限	14.07	36.97	266	3,742.62	9,834.02		-
300895	铜牛信息	2020年 9月17 日	2021年 3月24 日	新股流 通受限	12.65	45.30	233	2,947.45	10,554.90		-
300902	国安达	2020年 10月22 日	2021年 4月29 日	新股流 通受限	15.38	24.26	317	4,875.46	7,690.42		-
300908	仲景食品	2020年 11月13 日	2021年 5月24 日	新股流 通受限	39.74	60.44	139	5,523.86	8,401.16		-
300909	汇创达	2020年 11月11 日	2021年 5月18 日	新股流 通受限	29.57	40.67	150	4,435.50	6,100.50		-
300910	瑞丰新材	2020年 11月20 日	2021年 5月27 日	新股流 通受限	30.26	47.87	208	6,294.08	9,956.96		-
300917	特发服务	2020年 12月14 日	2021年 6月21 日	新股流 通受限	18.78	31.94	116	2,178.48	3,705.04		-
300918	南山智尚	2020年 12月15 日	2021年 6月22 日	新股流 通受限	4.97	8.94	546	2,713.62	4,881.24		-
300919	中伟股份	2020年 12月15 日	2021年 6月23 日	新股流 通受限	24.60	61.51	342	8,413.20	21,036.42		-
300922	天秦装备	2020年 12月18 日	2021年 6月25 日	新股流 通受限	16.05	31.58	152	2,439.60	4,800.16		-
300926	博俊科	2020年	2021年	新股未	10.76	10.76	1,801	19,378.76	19,378.76		-

	技	12月29日	1月7日	上市						
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年1月7日	新股未上市	13.39	13.39	1,000	13,390.00	13,390.00	-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	16.95	16.95	134	2,271.30	2,271.30	-

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本集合计划本报告期末无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 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未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 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 2020年12月31日
AAA	3,094,972.78
AAA 以下	-
未评级	-
合计	3,094,972.78

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合计划份额持有人可随时要求赎回其持有的集合计划份额，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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

7.4.13.3.2 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、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 7.4.12 中列示的部分集合计划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。

7.4.13.4 市场风险

市场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。

7.4.13.4.1 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。

本集合计划的管理人定期对本集合计划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。

本集合计划持有银行存款、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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	4,986,597.93	-	-	-	4,986,597.93
结算备付金	25,471,189.93	-	-	-	25,471,189.93
存出保证金	481,964.46	-	-	-	481,964.46
交易性金融资产	161,466,182.78	-	-	-2,852,977,505.69	3,014,443,688.47
买入返售金融资产	200,000,000.00	-	-	-	200,000,000.00
应收利息	-	-	-	3,279,593.82	3,279,593.82
应收股利	-	-	-	212,462.92	212,462.92
应收申购款	-	-	-	48,737.55	48,737.55
应收证券清算款	-	-	-	284,446.76	284,446.76
资产总计	392,405,935.10	-	-	-2,856,802,746.74	3,249,208,681.84
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,088,319.37	2,088,319.37
应付托管费	-	-	-	313,247.93	313,247.93
应付证券清算款	-	-	-	303.45	303.45
应付销售服务费	-	-	-	62,023.82	62,023.82
应付交易费用	-	-	-	4,912.76	4,912.76
应交税费	-	-	-	15,133,898.35	15,133,898.35
其他负债	-	-	-	138,000.00	138,000.00
负债总计	-	-	-	17,740,705.68	17,740,705.68
利率敏感度缺口	392,405,935.10	-	-	-2,839,062,041.06	3,231,467,976.16

注：上表统计了本集合计划面临的利率风险敞口，表中所示为本集合计划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。

7.4.13.4.1.2 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（2020年12月31日）	

分析	市场利率上升 25 个基点	-9,485.00
	市场利率下降 25 个基点	9,627.54

7.4.13.4.2 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。本集合计划持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本集合计划的管理人每日对本集合计划的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	702,458,506.61	-	702,458,506.61
资产合计	-	702,458,506.61	-	702,458,506.61
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	702,458,506.61	-	702,458,506.61

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的市场变量保持不变	
	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（2020年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	35,122,925.33
	所有外币相对人民币贬值 5%	-35,122,925.33

7.4.13.4.3 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，本集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划总资产的 50%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的 0%-50%），投资于本集合计划界定的核心优势相关证券的比例不低于非现金集合计划资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的保证金后，现金或到期日在一年期以内的政府债券不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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,852,977,505.69	88.29
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	2,852,977,505.69	88.29

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票价格以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2020 年 12 月 31 日）

分析	股票价格上升 5%	142,648,875.28
	股票价格下降 5%	-142,648,875.28

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 以公允价值计量的资产和负债

下表列示了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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2020 年 12 月 31 日，本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 2,855,766,311.53 元，第二层次的余额为人民币 158,677,376.94 元，无属于第三层次的余额。

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本集合计划投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本集合计划不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本集合计划综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本集合计划无非持续的以公允价值计量的金融工具。

(2) 其他金融工具的公允价值（非以公允价值计量的项目）

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。

(3) 除以上事项外，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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	2,852,977,505.69	87.81
	其中：股票	2,852,977,505.69	87.81

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	161,466,182.78	4.97
	其中：债券	161,466,182.78	4.97
	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	200,000,000.00	6.16
	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	30,457,787.86	0.94
8	其他各项资产	4,307,205.51	0.13
9	合计	3,249,208,681.84	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,614,852,134.50	49.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	102,109,449.78	3.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,554.90	0.00
J	金融业	188,663,173.02	5.84
K	房地产业	90,224,077.94	2.79
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	21,628,540.32	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	70,176,815.47	2.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	62,854,253.15	1.95
S	综合	-	-
	合计	2,150,518,999.08	66.55

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	105,438,959.09	3.26

非日常生活消费品	5,082,916.45	0.16
日常消费品	228,973,481.17	7.09
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	84,482,266.17	2.61
工业	-	-
信息技术	215,618,388.14	6.67
原材料	62,862,495.59	1.95
房地产	-	-
公用事业	-	-
合计	702,458,506.61	21.74

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600486	扬农化工	1,131,600	149,371,200.00	4.62
2	600309	万华化学	1,558,504	141,886,204.16	4.39
3	000786	北新建材	3,462,729	138,682,296.45	4.29
4	01810	小米集团-W	4,850,000	135,520,872.80	4.19
5	300760	迈瑞医疗	299,200	127,459,200.00	3.94
6	603833	欧派家居	946,412	127,292,414.00	3.94
7	601012	隆基股份	1,323,800	122,054,360.00	3.78
8	00291	华润啤酒	1,996,000	119,945,819.62	3.71
9	601318	中国平安	1,377,999	119,858,353.02	3.71
10	600276	恒瑞医药	955,680	106,520,092.80	3.30
11	00772	阅文集团	2,058,800	105,438,959.09	3.26
12	600009	上海机场	1,349,583	102,109,449.78	3.16
13	06186	中国飞鹤	6,432,000	98,307,861.20	3.04
14	000858	五粮液	315,914	92,199,500.90	2.85
15	000002	万科A	3,143,567	90,220,372.90	2.79
16	000739	普洛药业	3,805,148	88,583,845.44	2.74
17	02013	微盟集团	6,827,000	80,097,515.34	2.48
18	01177	中国生物制药	12,589,500	79,468,700.85	2.46
19	600585	海螺水泥	1,514,200	78,163,004.00	2.42
20	600887	伊利股份	1,718,069	76,230,721.53	2.36
21	603916	苏博特	3,119,891	71,663,896.27	2.22
22	600323	瀚蓝环境	2,826,700	70,130,427.00	2.17
23	600030	中信证券	2,340,300	68,804,820.00	2.13
24	03323	中国建材	8,014,000	62,862,495.59	1.95
25	300788	中信出版	1,480,951	62,807,131.91	1.94
26	002798	帝欧家居	2,555,357	52,384,818.50	1.62

27	600426	华鲁恒升	1,342,700	50,082,710.00	1.55
28	603755	日辰股份	541,400	42,299,582.00	1.31
29	603601	再升科技	2,469,815	33,712,974.75	1.04
30	603899	晨光文具	332,000	29,401,920.00	0.91
31	603181	皇马科技	1,427,960	27,531,068.80	0.85
32	002967	广电计量	589,800	21,616,170.00	0.67
33	603737	三棵树	123,340	18,686,010.00	0.58
34	688050	爱博医疗	62,208	10,760,739.84	0.33
35	09633	农夫山泉	232,000	10,719,800.35	0.33
36	603596	伯特利	297,345	10,175,145.90	0.31
37	600745	闻泰科技	82,100	8,127,900.00	0.25
38	688363	华熙生物	39,303	5,755,138.29	0.18
39	300896	爱美客	8,600	5,633,172.00	0.17
40	03690	美团-W	20,500	5,082,916.45	0.16
41	00853	微创医疗	142,000	5,013,565.32	0.16
42	300860	锋尚文化	372	47,121.24	0.00
43	300867	圣元环保	1,451	46,388.47	0.00
44	300870	欧陆通	383	25,151.61	0.00
45	300919	中伟股份	342	21,036.42	0.00
46	300868	杰美特	461	19,952.08	0.00
47	300926	博俊科技	1,801	19,378.76	0.00
48	300927	江天化学	1,000	13,390.00	0.00
49	300887	谱尼测试	166	12,370.32	0.00
50	300895	铜牛信息	233	10,554.90	0.00
51	300910	瑞丰新材	208	9,956.96	0.00
52	300894	火星人	266	9,834.02	0.00
53	300882	万胜智能	336	8,665.44	0.00
54	300908	仲景食品	139	8,401.16	0.00
55	300881	盛德鑫泰	245	7,915.95	0.00
56	300902	国安达	317	7,690.42	0.00
57	300893	松原股份	212	7,436.96	0.00
58	300909	汇创达	150	6,100.50	0.00
59	300886	华业香料	121	5,526.07	0.00
60	605179	一鸣食品	293	5,174.38	0.00
61	300918	南山智尚	546	4,881.24	0.00
62	300922	天秦装备	152	4,800.16	0.00
63	300917	特发服务	116	3,705.04	0.00
64	605155	西大门	99	3,017.52	0.00
65	605277	新亚电子	134	2,271.30	0.00
66	003030	祖名股份	129	1,958.22	0.00
67	003031	中瓷电子	110	1,679.70	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

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	占期末基金资产净值比例(%)
1	01177	中国生物制药	111,898,915.49	3.46
2	300760	迈瑞医疗	102,406,443.00	3.17
3	00772	阅文集团	100,247,356.32	3.10
4	601318	中国平安	100,219,984.40	3.10
5	00291	华润啤酒	96,895,606.83	3.00
6	600009	上海机场	94,066,187.76	2.91
7	600486	扬农化工	92,288,867.68	2.86
8	000739	普洛药业	90,187,936.61	2.79
9	06186	中国飞鹤	89,604,838.76	2.77
10	002798	帝欧家居	88,252,753.22	2.73
11	600276	恒瑞医药	85,945,223.69	2.66
12	603916	苏博特	82,259,328.00	2.55
13	603833	欧派家居	81,989,499.63	2.54
14	600585	海螺水泥	81,954,575.03	2.54
15	000786	北新建材	81,654,838.99	2.53
16	000002	万科A	80,931,098.64	2.50
17	600309	万华化学	77,633,739.87	2.40
18	300788	中信出版	72,498,421.40	2.24
19	601012	隆基股份	70,820,474.68	2.19
20	600323	瀚蓝环境	64,399,188.03	1.99

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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

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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601012	隆基股份	8,993,472.64	0.28
2	688561	奇安信	2,730,960.00	0.08
3	688608	恒玄科技	1,605,541.50	0.05
4	688063	派能科技	831,193.10	0.03
5	688586	江航装备	788,640.00	0.02
6	300860	锋尚文化	756,648.00	0.02
7	688336	三生国健	637,152.00	0.02
8	688311	盟升电子	611,876.00	0.02
9	688339	亿华通	607,614.00	0.02
10	688057	金达莱	524,443.34	0.02
11	300867	圣元环保	503,999.46	0.02
12	688338	赛科希德	403,090.00	0.01
13	688286	敏芯股份	370,756.00	0.01

14	688596	正帆科技	355,954.91	0.01
15	688508	芯朋微	348,944.00	0.01
16	300862	蓝盾光电	327,303.80	0.01
17	688526	科前生物	312,670.50	0.01
18	688408	中信博	303,902.00	0.01
19	688330	宏力达	298,767.00	0.01
20	300868	杰美特	281,407.48	0.01

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	2,351,832,653.03
卖出股票收入（成交）总额	27,022,501.04

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。

8.5 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	27,897,210.00	0.86
2	央行票据	-	-
3	金融债券	130,474,000.00	4.04
	其中：政策性金融债	130,474,000.00	4.04
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,094,972.78	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	161,466,182.78	5.00

8.6 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	180409	18 农发 09	500,000	50,355,000.00	1.56
2	160416	16 农发 16	500,000	50,125,000.00	1.55
3	200309	20 进出 09	300,000	29,994,000.00	0.93
4	019627	20 国债 01	279,000	27,897,210.00	0.86
5	113038	隆 20 转债	17,540	3,091,600.40	0.10

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本集合计划本报告期末未持有股指期货合约。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、合约选择，谨慎地进行投资，旨在通过股指期货实现组合风险敞口管理的目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本集合计划合同，本集合计划暂不投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本集合计划本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本集合计划合同，本集合计划暂不投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	481,964.46
2	应收证券清算款	284,446.76
3	应收股利	212,462.92
4	应收利息	3,279,593.82
5	应收申购款	48,737.55
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,307,205.51

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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(%)
海通核心优势A	26,055	96,335.88	324,552,394.57	12.93	2,185,478,989.22	87.07
海通核心优势B	109	617,078.81	56,562,155.85	84.09	10,699,434.54	15.91
海通核心优势C	2,191	59,139.90	5,300,042.09	4.09	124,275,487.41	95.91
合	28,355	95,463.53	386,414,592.51	14.28	2,320,453,911.17	85.72

计						
---	--	--	--	--	--	--

注：本表集合计划机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、B、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）。

9.2 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	海通核心优势 A	24,042,925.30	0.9579
	海通核心优势 B	138,261.99	0.2056
	海通核心优势 C	105,048.92	0.0811
	合计	24,286,236.21	0.8972

9.3 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	海通核心优势 A	>100
	海通核心优势 B	10~50
	海通核心优势 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	海通核心优势 A	>100
	海通核心优势 B	-
	海通核心优势 C	-
	合计	>100

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
李天舒	公募基金	>100
	私募资产管理计划	50~100
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海通核心优势 A	海通核心优势 B	海通核心优势 C
基金合同生效日（2020 年 4 月 8 日）基金份额总额	-	72,102,254.55	-

基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	2,510,031,383.79	-	129,575,529.50
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	-	4,840,664.16	-
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期末基金份额总额	2,510,031,383.79	67,261,590.39	129,575,529.50

注：因四舍五入原因，持有份额总数占集合计划总份额比例的分项之和与合计可能存在尾差。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）。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本报告期内，集合计划管理人、托管人的专门集合计划托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本集合计划本报告期内无涉及集合计划投资策略的改变。

11.5 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。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	2,378,855,154.07	100.00%	318,707.61	100.00%	-

11.7.2 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	464,330,182.60	100.00%	35,079,264,000.00	100.00%	-	-

11.8 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	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划暂停申购（赎回、转换、定期定额投资）业务的公告	证券时报及公司网站	2020年4月8日
2	海通新兴成长集合资产管理计划正式变更为海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划及合同生效的公告	证券时报及公司网站	2020年4月8日
3	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划份额折算结果公告	证券时报及公司网站	2020年4月10日
4	海通核心优势一年持有期混合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	证券时报及公司网站	2020年4月28日
5	上海海通证券资产管理有限公司关于海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划A类份额参加部分代销机构申购费率优惠活动的公告	证券时报及公司网站	2020年5月7日
6	海通证券资产管理有限公司关于旗下海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划增加部分渠道为代理销售机构的公告	证券时报及公司网站	2020年5月7日
7	关于海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划参与直销渠道开展	证券时报及公司网站	2020年5月12日

	申购费率优惠活动的公告		
8	上海海通证券资产管理有限公司关于旗下海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划新增大同证券有限责任公司为代理销售机构的公告	证券时报及公司网站	2020年5月19日
9	关于海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划管理人固有资金参与的公告	证券时报及公司网站	2020年5月27日
10	上海海通证券资产管理有限公司关于旗下海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划新增中国建设银行股份有限公司为代理销售机构的公告	证券时报及公司网站	2020年6月9日
11	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划节假日暂停申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告	证券时报及公司网站	2020年6月22日
12	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划节假日暂停申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告	证券时报及公司网站	2020年6月30日
13	上海海通证券资产管理有限公司关于旗下海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划新增上海浦东发展银行股份有限公司为代理销售机构的公告	证券时报及公司网站	2020年7月1日
14	上海海通证券资产管理有限公司关于旗下海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划关联交易的公告	证券时报及公司网站	2020年7月13日
15	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划节假日暂停申购、转换转入、赎回、转换转出、定期定额投资业务的公告	证券时报及公司网站	2020年9月28日
16	【重阳节放假】海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划节假日暂停申购、转换转入、赎回、转换转出、定期定额投资业务的公告	证券时报及公司网站	2020年10月23日
17	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划节假日暂停申购、转换转入、赎回、转换转出、定期定额投资业务的公告	证券时报及公司网站	2020年12月23日
18	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划节假日暂停申购、转换转入、赎回、转换转出、定期定额投资业务的公告	证券时报及公司网站	2020年12月30日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)《关于准予海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划合同变更的回函》；
- (二)《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- (三)《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书》；
- (四)《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议》；
- (五)本报告期内在中国证监会规定报纸上公开披露的各项公告。

13.2 存放地点

集合计划管理人和集合计划托管人的住所。

13.3 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

2021 年 3 月 30 日