

海通量化成长精选一年持有期混合型集合
资产管理计划
2022 年第 1 季度报告

2022 年 3 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 4 月 22 日

§ 1 重要提示

集合计划管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

集合计划托管人中国工商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 4 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期为 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 海通量化成长精选 |
| 基金主代码 | 850010 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 12 月 23 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 68,286,022.97 份 |
| 投资目标 | 本集合计划通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现集合计划资产的增值。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>大类资产配置不作为本集合计划的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考虑系统性风险、各类资产收益风险比、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对集合计划资产配置做出适当调整。</p> <p>2、以超越业绩基准为目的的股票投资策略</p> <p>本集合计划基于长期量化研究构建投资模型，坚持数据驱动，挖掘市场中的潜在逻辑，通过优化量化投资模型来规避情绪带来的负面影响，力图获得超越业绩基准的投资回报。</p> <p>本集合计划基于实证检验，选取出符合 A 股投资逻辑的因子，并根据对经济周期和资本市场发展的不同阶段的分析和判断动态调整因子权重，从而构建多因子选股体系。</p> |

策略组合构建方法：**(1) 筛选有效因子**

基于对国内外证券市场运行特征的长期跟踪研究以及大量历史数据的实证检验，选取出符合 A 股投资逻辑的因子。因子库主要包括成长类因子、估值类因子、财务质量类因子、流动性因子、市场预期类因子等。其中成长因子包括但不限于主营收入增长率、净利润增长率、净资产增长率、一致预期净利润增长率、PEG 等；估值因子包括但不限于市盈率、市净率、市现率、市销率等；质量因子包括但不限于总资产收益率、净资产收益率、销售毛利率、营业总收入、每股收益、资产负债率、总资产周转率等；市场因子包括但不限于成交量、换手率、流通市值等。

投研团队将定期或不定期地对多因子选股体系进行复核与检验，适时剔除失效因子、酌情纳入重新发挥作用的有效因子或者由市场上新出现的投资逻辑归纳而来的有效因子，通过不断改善多因子选股体系的有效性与稳定性，使得产品能够持续的完成投资目标。

(2) 动态优化因子权重

作为在投资决策时的可观测指标，不同因子从不同的侧面反映了投资标的真实运行状态。同一时点多个因子（及其近期值）所形成的向量，是影响这只股票市场表现的重要因素，这些因素的综合影响方式可能非常复杂，但是随着时间的推移也许有迹可循。数量模式的一个工作重点就在于动态追查这些痕迹，并从过往的轨迹中总结出有可能带来收益的量化投资模式并固定下来，从而有效避免主观情绪可能带来的负面影响，严格执行投资逻辑。整个过程具体来讲就是，通过历史数据建立因子矩阵和权重矩阵，并根据最新数据不断进行修正。

(3) 生成股票组合并优化股票权重

在因子权重确定后，多因子选股体系对全市场股票进行综合评分，根据最新数据筛选出备选股票组合，同时综合风险收益目标、风险敞口约束和换仓成本优化备选组合内的个股权重。

在实际运行过程中，管理人将紧密追踪组合和市场的互动表现，及时对多因子选股体系定期或不定期地进行修正，优化股票投资组合。为控制组合风险，在个股偏离度和行业偏离度上也会设置阈值。

(4) 港股投资策略

本集合计划将仅通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本集合计划重点投资于基本面良好、主要收入来自于中国内地、相对 A 股市场估值合理，具有持续领先优势或核心竞争力

及注重现金分红的上市公司进行长期投资。

3、债券投资策略

本集合计划债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时有效利用集合资产提高集合计划收益。通过研究国内外宏观经济、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期，采取自上而下的方式确定组合久期，进而根据期限结构配置、信用利差、信用风险评估、现金管理等手段进行个券选择。

4、股指期货投资策略

本集合计划进行股指期货投资的主要目的是对股票组合进行套期保值，通过对国内外宏观经济运行趋势、财政以及货币政策、市场资金供需状况、股票市场估值水平、固定收益类资产收益水平等因素进行分析，结合对股票头寸的流动性、风险程度等因素的测评，以确定需要进行套期保值的股票组合和套期保值期限。根据公募基金相关法规和资产管理合同的规定，管理人可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。若相关法律法规发生变化，管理人在进行股指期货投资管理时遵从最新规定。

5、股票期权投资策略

本集合计划投资股票期权将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。本集合计划将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与期权交易的投资时机和投资比例。

6、存托凭证投资策略

本集合计划将根据本集合计划的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

7、资产支持证券投资策略

本集合计划投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

8、融资业务投资策略

本集合计划将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资业务。

9、其他金融衍生产品的投资策略

本集合计划将根据集合计划的特点和要求，结合该类金融衍生产品的特征，在进行充分风险控制和遵守法律法规的前提下，制定合适的投资策略，以控制并降低投资组合风险，提高投资效率，降低跟踪误差，从

| | | | |
|-----------------|---|-----------------|----------------|
| | 而更好地实现本集合计划的投资目标。 | | |
| 业绩比较基准 | 80%×中证 500 指数收益率+20%×商业银行活期存款利率（税后） | | |
| 风险收益特征 | 本集合计划为混合型集合资产管理计划，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划。 本集合计划可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 | | |
| 基金管理人 | 上海海通证券资产管理有限公司 | | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 海通量化成长精选 A | 海通量化成长精选 B | 海通量化成长精选 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 851088 | 850010 | 851099 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 37,245,798.22 份 | 27,937,095.32 份 | 3,103,129.43 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2022 年 1 月 1 日-2022 年 3 月 31 日） | | |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|--------------|
| | 海通量化成长精选 A | 海通量化成长精选 B | 海通量化成长精选 C |
| 1. 本期已实现收益 | -274,501.58 | -294,640.71 | -57,548.73 |
| 2. 本期利润 | -2,079,394.82 | -3,191,167.73 | -193,402.03 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.1124 | -0.1104 | -0.1050 |
| 4. 期末基金资产净值 | 40,117,309.16 | 30,089,616.66 | 3,341,120.97 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0771 | 1.0770 | 1.0767 |

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、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。

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

海通量化成长精选 A

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | ①—③ | ②—④ |
|----|--------|---------------|----------------|----------------|-----|-----|
|----|--------|---------------|----------------|----------------|-----|-----|

| | | | | 准差④ | | |
|----------------|--------|-------|---------|-------|-------|-------|
| 过去三个月 | -9.28% | 1.31% | -11.30% | 1.20% | 2.02% | 0.11% |
| 自基金合同 生效起至今 | -8.24% | 1.25% | -10.75% | 1.15% | 2.51% | 0.10% |

海通量化成长精选 B

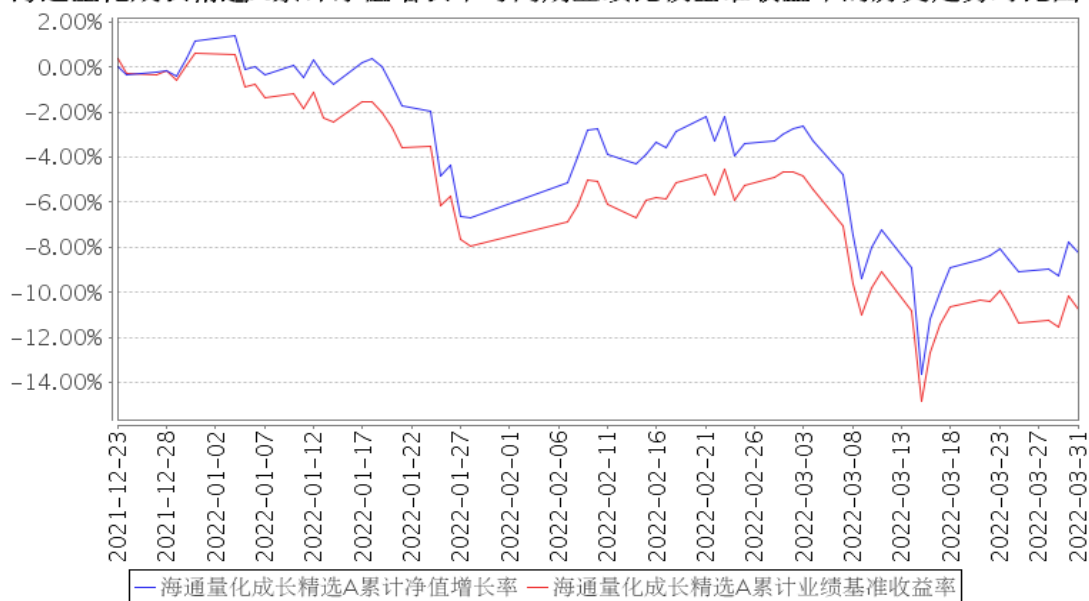
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | -9.29% | 1.31% | -11.30% | 1.20% | 2.01% | 0.11% |
| 自基金合同 生效起至今 | -8.25% | 1.25% | -10.75% | 1.15% | 2.50% | 0.10% |

海通量化成长精选 C

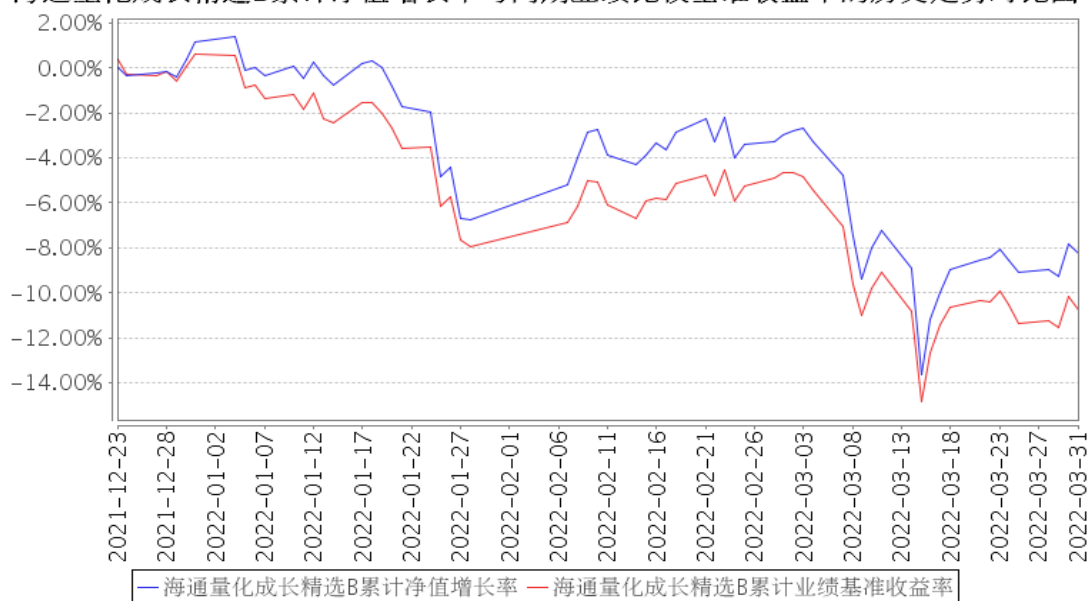
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | -9.32% | 1.31% | -11.30% | 1.20% | 1.98% | 0.11% |
| 自基金合同 生效起至今 | -8.27% | 1.25% | -10.75% | 1.15% | 2.48% | 0.10% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

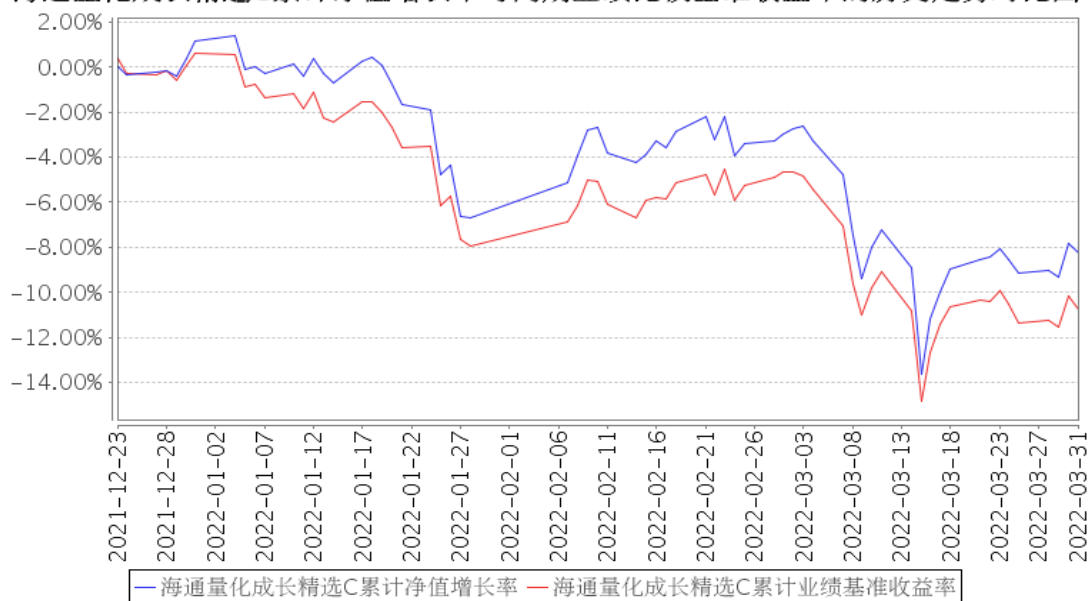
海通量化成长精选A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



海通量化成长精选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



海通量化成长精选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 2021 年 12 月 23 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。

3.3 其他指标

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------------|------------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 胡倩 | 总经理助理，投资经理 | 2021 年 12 月 23 日 | - | 20 | 胡倩女士：上海财经大学经济学博士，现任上海海通证券资产管理有限公司总经理助理。曾任海通证券首席分析师，长信基金金融工程总监、基金经理。 |

4.1.1 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 |
|----|----------|---------|----------------|------------------|
| 胡倩 | 公募基金 | 2 | 194,094,450.19 | 2021 年 12 月 23 日 |
| | 私募资产管理计划 | 2 | 103,527,090.16 | 2016 年 4 月 15 日 |
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 4 | 297,621,540.35 | - |

注：以上兼任“私募资产管理计划”仅为人数不受 200 人限制且待公募化改造的集合资产管理计划。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关规定，通过各项内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有投资组合，切实防范利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本集合计划进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年一季度，外部冲击不断。俄乌冲突叠加美国加息，扰动全球市场。与此同时，国内经济受到疫情反弹影响，外资加速流出。上证综指下跌 10.65%，沪深 300 下跌 14.53%。目前市场仍然未能从一季度的冲击中恢复。

展望 2022 年二季度，2021 年以蓝筹股为代表的优质资产持续下跌，已经刺破了部分泡沫。截至 2022 年一季度末，主要指数跌幅已经接近 2018 年熊市。情绪释放结束后，权益资产投资价值会被更多的投资者发掘。但是这注定是一个漫长的过程，市场恢复的时点和节奏都很难预测。

在投资层面，我们将通过多层次的量化策略体系探究获取超额收益和绝对收益的路径，以抓住市场中的机会。

4.5 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 1.0771 元，B 份额净值为 1.0770 元，C 份额净值为 1.0767 元。本报告期集合计划三类份额净值增长率分别为：-9.28%，-9.29%，-9.32%，业绩比较基准收益率为 -11.30%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本集合计划于 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 2 月 17 日出现了集合计划资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 61,089,902.65 | 82.60 |
| | 其中：股票 | 61,089,902.65 | 82.60 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 11,928,525.51 | 16.13 |
| 8 | 其他资产 | 936,680.92 | 1.27 |
| 9 | 合计 | 73,955,109.08 | 100.00 |

注：本集合计划通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 625,532.01 元，占资产净值比例为 0.85%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 409,921.00 | 0.56 |
| B | 采矿业 | 2,661,876.00 | 3.62 |
| C | 制造业 | 37,270,035.85 | 50.67 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,708,950.10 | 2.32 |
| E | 建筑业 | 1,344,313.82 | 1.83 |
| F | 批发和零售业 | 4,153,501.80 | 5.65 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,281,988.00 | 3.10 |
| H | 住宿和餐饮业 | 21,408.00 | 0.03 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,810,976.86 | 3.82 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| J | 金融业 | 3,229,355.80 | 4.39 |
| K | 房地产业 | 1,530,595.23 | 2.08 |
| L | 租赁和商务服务业 | 923,560.00 | 1.26 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 275,460.00 | 0.37 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 219,053.52 | 0.30 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 136,452.04 | 0.19 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,291,433.02 | 1.76 |
| S | 综合 | 195,489.60 | 0.27 |
| | 合计 | 60,464,370.64 | 82.21 |

5.2.2 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（%） |
|---------|------------|--------------|
| 基础材料 | - | - |
| 消费者非必需品 | - | - |
| 消费者常用品 | - | - |
| 能源 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 医疗保健 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 信息技术 | 625,532.01 | 0.85 |
| 电信服务 | - | - |
| 公用事业 | - | - |
| 房地产 | - | - |
| 合计 | 625,532.01 | 0.85 |

注：1、以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

2、以上行业分类的统计中已包含港股通投资的股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 000686 | 东北证券 | 108,920 | 843,040.80 | 1.15 |
| 2 | 600056 | 中国医药 | 22,580 | 821,008.80 | 1.12 |
| 3 | 600511 | 国药股份 | 23,900 | 700,987.00 | 0.95 |
| 4 | 002440 | 闰土股份 | 80,100 | 690,462.00 | 0.94 |
| 5 | 600787 | 中储股份 | 127,400 | 681,590.00 | 0.93 |
| 6 | 000039 | 中集集团 | 48,700 | 676,443.00 | 0.92 |
| 7 | 000709 | 河钢股份 | 270,700 | 644,266.00 | 0.88 |
| 8 | 600705 | 中航产融 | 154,100 | 637,974.00 | 0.87 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 9 | 600623 | 华谊集团 | 74,700 | 632,709.00 | 0.86 |
| 10 | 002203 | 海亮股份 | 59,900 | 630,148.00 | 0.86 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/ 卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动 （元） | 风险说明 |
|-------------------|--------|--------------|--------------|---------------|-------------|
| IC2206 | IC2206 | 2 | 2,498,640.00 | -265,351.11 | - |
| IC2209 | IC2209 | 3 | 3,683,040.00 | -146,880.00 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | -412,231.11 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | -42,715.55 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | -522,044.45 |

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

监测股指期货基差，适时使用股指期货代替现货持仓。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

-

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

-

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 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

报告期内，本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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 875,646.45 |
| 2 | 应收证券清算款 | 61,034.47 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | 0.00 |
| 8 | 合计 | 936,680.92 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 海通量化成长精 选 A | 海通量化成长精 选 B | 海通量化成长 精选 C |
|----|----------------|----------------|----------------|
| | | | |

| | | | |
|---------------------------|---------------|---------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | - | 29,781,603.61 | - |
| 报告期期间基金总申购份额 | 37,245,800.77 | - | 3,103,131.13 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 2.55 | 1,844,508.29 | 1.70 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 37,245,798.22 | 27,937,095.32 | 3,103,129.43 |

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 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位: 份

| 项目 | 海通量化成长精选 A | 海通量化成长精选 B | 海通量化成长精选 C |
|--------------------------|--------------|------------|------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | - | - | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 7,755,089.15 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 7,755,089.15 | - | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 20.82 | - | - |

注: 本表报告期末持有的基金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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率(%) |
|----|------|-----------|--------------|--------------|---------|
| 1 | 申购 | 2022-1-12 | 5,095,990.49 | 6,000,000.00 | - |
| 2 | 申购 | 2022-2-24 | 2,659,098.66 | 3,000,000.00 | 0.8000 |
| 合计 | | | 7,755,089.15 | 9,000,000.00 | |

注: 序号 1 的申购适用费率为固定费用, 费用为 1,000.00 元。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准海通海蓝宝银集合资产管理计划资产管理合同变更的文件
- (二) 《海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》
- (三) 《海通量化成长精选一年持有期混合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

9.2 存放地点

集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所。

9.3 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 4 月 22 日