

# 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 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：上海海通证券资产管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

集合计划托管人中国工商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	7
2.4 信息披露方式 .....	8
2.5 其他相关资料 .....	8
<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
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
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 .....	13
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
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 .....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	14
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的真实、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>15</b>
6.1 资产负债表 .....	15
6.2 利润表 .....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	19
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	46
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 .....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	57
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 .....	57
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 .....	57
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 .....	57

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 .....	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	57
7.12 投资组合报告附注 .....	57
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>58</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	58
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 .....	59
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>59</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>60</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	60
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 .....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
10.4 基金投资策略的改变 .....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
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 .....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
10.8 其他重大事件 .....	61
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</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 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录 .....	61
12.2 存放地点 .....	62
12.3 查阅方式 .....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划		
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		
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		
报告期末基金份额总额	67,880,010.72 份		
基金合同存续期	不定期		
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	37,304,405.99 份	27,456,385.73 份	3,119,219.00 份

### 2.2 基金产品说明

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> <p>策略组合构建方法：</p> <p>（1）筛选有效因子</p> <p>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。</p> <p>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</p>

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本合同的规定，管理人可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。

	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	<p><math>80\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 20\% \times \text{商业银行活期存款利率（税后）}</math>。</p> <p>中证 500 指数是中证指数有限公司编制，样本股选自沪深两个证券市场，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体状况。</p> <p>若未来法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本集合计划的业绩基准的指数，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布时，管理人在与托管人协商一致并在按照监管部门要求履行适当程序后，可调整或变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开集合计划份额持有人大会。</p>
风险收益特征	<p>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。</p> <p>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。</p>

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海海通证券资产管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露	姓名	吴文然	余宏伟
负责人	联系电话	021-23154762	021-68089632

电子邮箱	htam@htsec.com	yuhongwei1@sh.icbc.com.cn
客户服务电话	95553、4008888001	95588
传真	021-63410460	010-66105798
注册地址	上海市广东路 689 号海通证券大厦 32 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市广东路 689 号海通证券大厦 32 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200001	100140
法定代表人	裴长江	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.htsamc.com">http://www.htsamc.com</a>
基金中期报告备置地点	集合计划管理人及集合计划托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间	报告期(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)		
数据和指标	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
本期已实现收益	-3,810,456.86	-2,943,786.05	-355,966.63
本期利润	-1,382,803.53	-2,689,563.75	-138,950.43
加权平均基金份额本期利润	-0.0478	-0.0949	-0.0541
本期加权平均净值利润率	-4.55%	-8.81%	-5.13%
本期基金份额净值增长	-7.71%	-7.70%	-7.86%



率			
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	1,776,700.41	2,634,422.93	148,904.39
期末可供分配基金份额利润	0.0476	0.0959	0.0477
期末基金资产净值	40,875,590.62	30,090,808.66	3,412,294.57
期末基金份额净值	1.0957	1.0959	1.0940
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	-6.65%	-6.64%	-6.80%

注：1、本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海通量化成长精选 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	6.31%	0.96%	5.67%	0.88%	0.64%	0.08%
过去三个月	1.73%	1.49%	1.79%	1.40%	-0.06%	0.09%
过去六个月	-7.71%	1.40%	-9.71%	1.30%	2.00%	0.10%

自基金合同生效起 至今	-6.65%	1.36%	-9.14%	1.27%	2.49%	0.09%
----------------	--------	-------	--------	-------	-------	-------

## 海通量化成长精选 B

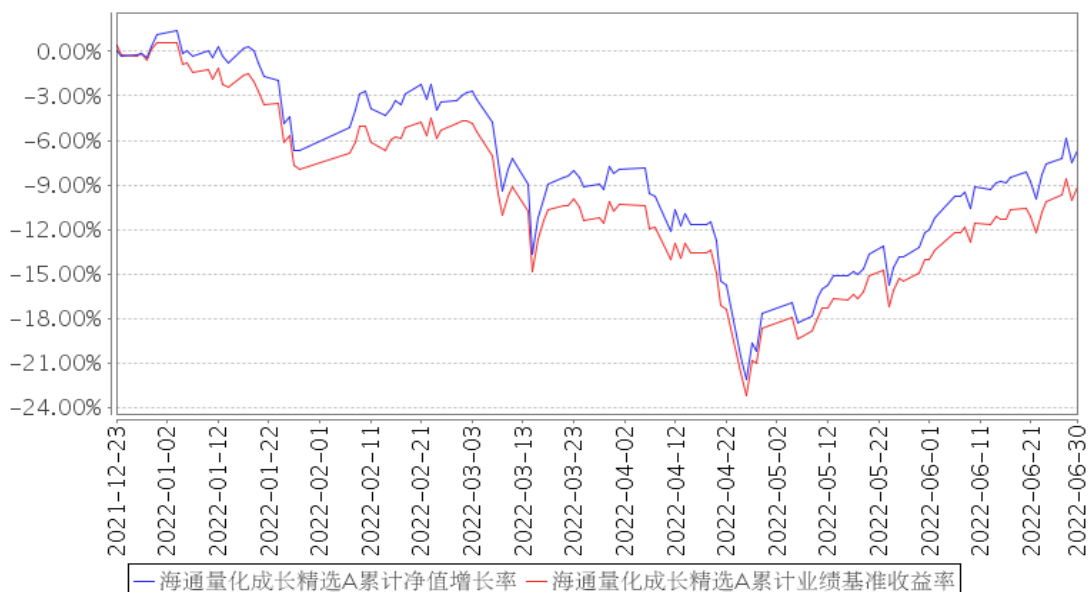
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.31%	0.97%	5.67%	0.88%	0.64%	0.09%
过去三个月	1.75%	1.49%	1.79%	1.40%	-0.04%	0.09%
过去六个月	-7.70%	1.40%	-9.71%	1.30%	2.01%	0.10%
自基金合同生效起 至今	-6.64%	1.36%	-9.14%	1.27%	2.50%	0.09%

## 海通量化成长精选 C

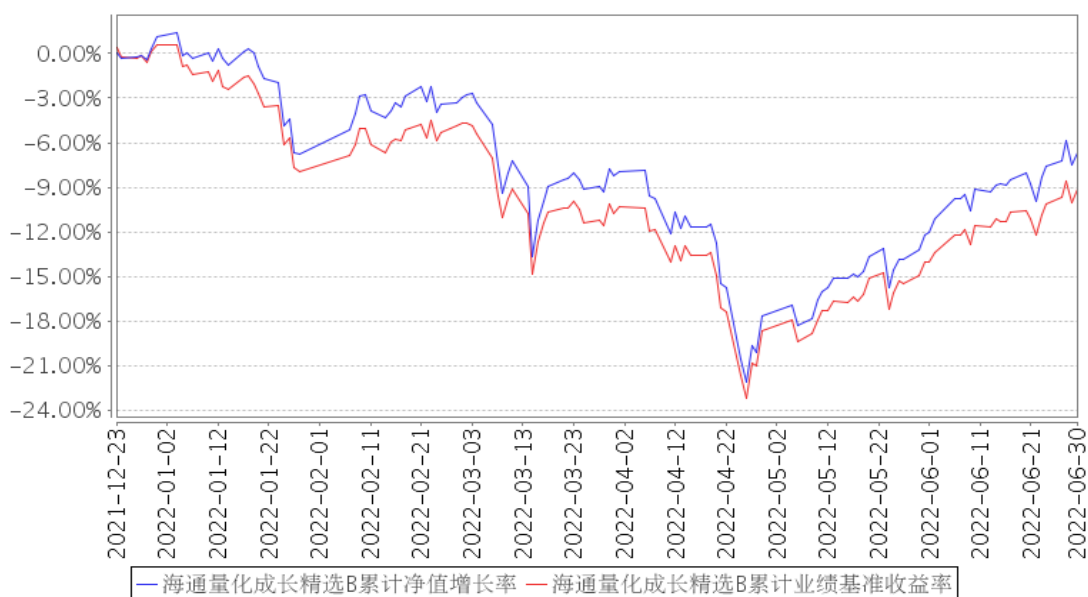
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.27%	0.96%	5.67%	0.88%	0.60%	0.08%
过去三个月	1.61%	1.48%	1.79%	1.40%	-0.18%	0.08%
过去六个月	-7.86%	1.40%	-9.71%	1.30%	1.85%	0.10%
自基金合同生效起 至今	-6.80%	1.36%	-9.14%	1.27%	2.34%	0.09%

### 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

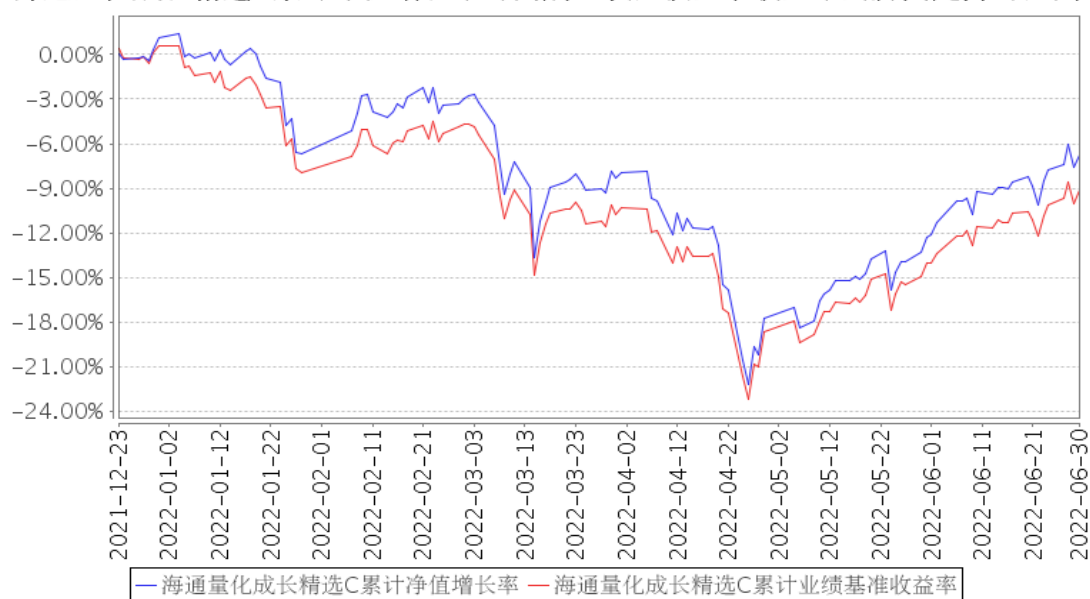
海通量化成长精选A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本集合计划管理人上海海通证券资产管理有限公司前身为海通证券客户资产管理部，2002 年开始从事持牌受托投资管理业务（证监机构字【2001】265 号），2012 年 6 月经核准成为资管子公司，秉承海通证券资产管理牌照和业务，注册资本 10 亿元，注册地上海市。经过多次增资，目前注册资本为 22 亿元人民币整。公司经营范围为证券资产管理业务，包括：单一业务、集合业务、专项业务、QDII 业务和创新业务等，覆盖传统权益、固收、量化、现金管理、另类投资、QDII 等全业务产品线。

截至 2022 年 6 月 30 日，本集合计划管理人共管理 15 只公募集合资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡倩	总经理助理，投资经理	2021 年 12 月 23 日	-	20 年	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。

#### 4.1.3 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

胡倩	公募基金	2	196,083,280.59	2021年2月24日
	私募资产管理计划	2	93,227,086.69	2016年4月15日
	其他组合	-	-	-
	合计	4	289,310,367.28	-

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本集合计划进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年四月份，市场触底，上证综指短暂跌破 2900 点。之后市场逐渐走出前期的悲观情绪，主要指数估值迅速修复，目前本轮反弹暂未结束。部分热门标的已经创出历史新高，但同时大部分行业还处在弱势反弹阶段。

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的路径，以抓住市场中的机会。

### 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 1.0957 元，B 份额净值为 1.0959 元，C 份额净值为 1.0940 元。本报告期集合计划三类份额净值增长率分别为：-7.71%，-7.70%，-7.86%，业绩比较基准收益率为-9.71%。

#### 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 2022 年三季度，市场在悲观情绪释放结束后，已经逐渐恢复。但是市场情绪的恢复，和经济状况的改善注定是一个漫长的过程，时点和节奏都很难预测。未来半年，市场或许会被悲观情绪暂时左右，但是权益资产投资价值已经显现。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本集合计划管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及集合计划合同对估值程序的相关约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、集合计划份额净值的计算由集合计划管理人独立完成，并与集合计划托管人进行账务核对，经集合计划托管人复核无误后，由集合计划管理人对外公布。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

- 一、本集合计划本报告期内无应分配的收益。
- 二、已实施的利润分配：无。
- 三、不存在应分配但尚未实施的利润。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，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 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，本托管人在对海通量化成长精选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《证券投资基金法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在任何损害资产管理计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同和托管协议的规定，对本资产管理计划管理人的投资运作进行了必要的监督，对资产净值的计算、份额参与与退出价格计算、以及费用开支等方面进行了认真地复核。

本报告期内，未发现本计划管理人存在损害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

本报告期内，本托管人依法对上海海通证券资产管理有限公司编制和披露的海通量化成长精

选一年持有期混合型集合资产管理计划 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告中账务数据内容进行了核查，以上内容真实、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：海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	9,832,287.46	3,176,998.35
结算备付金		2,687,735.79	1,648,151.54
存出保证金		888,182.96	406,188.57
交易性金融资产	6.4.7.2	61,122,011.72	30,218,550.71
其中：股票投资		61,122,011.72	30,218,550.71
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
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		-	846,127.47
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		74,530,217.93	36,296,016.64
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.16	796,621.37
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		45,264.76	36,599.06
应付托管费		8,941.13	7,660.66
应付销售服务费		1,363.20	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	69,747.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	95,954.83	26,657.48
负债合计		151,524.08	937,286.35
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	67,880,010.72	29,781,603.61
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	6,498,683.13	5,577,126.68
净资产合计		74,378,693.85	35,358,730.29
负债和净资产总计		74,530,217.93	36,296,016.64

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，集合计划份额总额 67,880,010.72 份，其中海通量化成长精选 A 份额净值（暂估业绩报酬前）1.0957 元，份额总额 37,304,405.99 份，资产净值（暂估业绩报酬前）40,875,590.62 元，于 2022 年 6 月 30 日，相关暂估业绩报酬余额为 1,504.84 元，资产净值（暂估业绩报酬后）40,874,085.78 元；海通量化成长精选 B 份额净值（暂估业绩报酬前）1.0959 元，份额总额 27,456,385.739 份，资产净值（暂估业绩报酬前）30,090,808.66 元，于 2022 年 6 月 30 日，相关暂估业绩报酬余额为 140,854.41 元，资产净值（暂估业绩报酬后）29,949,954.25 元；海通量化成长精选 C 份额净值（暂估业绩报酬前）1.0940 元，份额总额 3,119,219.00 份，资产净值（暂估业绩报酬前）3,412,294.57 元，于 2022 年 6 月 30 日，相关暂估业绩报酬余额为 3,340.68 元，资产净值（暂估业绩报酬后）3,408,953.89 元。该暂估业绩报酬余额是各集合计划份额持有人于期末时点的暂估业绩报酬的合计，各集合计划份额持有人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认，可能与上述暂估业绩报酬金额存在差异。

## 6.2 利润表

会计主体：海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日



<b>一、营业总收入</b>		-3,851,991.07
1. 利息收入		17,253.89
其中：存款利息收入	6.4.7.13	17,253.89
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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,768,136.84
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-7,028,517.41
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
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	-412,464.04
股利收益	6.4.7.19	672,844.61
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	2,898,891.83
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	0.05
<b>减：二、营业总支出</b>		359,326.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	234,720.39
2. 托管费	6.4.10.2.2	45,993.09
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	6,411.52
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	72,201.64
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-4,211,317.71
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-4,211,317.71
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-4,211,317.71

注：本集合计划合同生效日为 2021 年 12 月 23 日，无上年度同期对比数据。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	29,781,603.61	-	5,577,126.68	35,358,730.29
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)	29,781,603.61	-	5,577,126.68	35,358,730.29
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	38,098,407.11	-	921,556.45	39,019,963.56
(一)、综合收益总额	-	-	-4,211,317.71	-4,211,317.71
(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)	38,098,407.11	-	5,132,874.16	43,231,281.27
其中：1. 基金申购款	40,423,629.24	-	5,386,014.88	45,809,644.12
2	-2,325,222.13	-	-253,140.72	-2,578,362.85

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)	67,880,010.72	-	6,498,683.13	74,378,693.85

注：本集合计划合同生效日为 2021 年 12 月 23 日，无上年度同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

海通量化成长精选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 2021 年 11 月 26 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予海通海蓝宝银集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2021]3697 号）批准，《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》于 2021 年 12 月 23 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，托管人为中国工商银行股份有限公司。

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》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（包含主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、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、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、银行存款、同业存单、债券回购、股指期货、股票期权、资产支持证券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的相关规定）。

本集合计划根据法律法规的规定参与融资业务。在法律法规允许的情况下并履行适当程序后，本集合计划可以参与融券业务和转融通证券出借业务。在法律法规允许的情况下，本集合计划可以投资各类期权品种。

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：本集合计划投资于股票资产（含存托凭证）的比例占集合计划资产的 60%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的 0%-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的保证金后，现金或到期日在一年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。

本集合计划的业绩比较基准为  $80\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 20\% \times \text{商业银行活期存款利率}$ （税后）。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海通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》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 6.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

#### 6.4.4.2 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。

#### 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基金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。

#### 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

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，且本基金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，虽然本基金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。

#### 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

本集合计划持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本集合计划 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金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基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本集合计划的收益分配政策为：

1、在符合有关集合计划收益分配条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《资产管理合同》生效不满 3 个月可不

进行收益分配；

2、本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；因红利再投资转换的份额类别，与集合计划份额持有人在收益分配基准日持有的份额同属一个类别；如集合计划份额持有人持有多个类别份额的，则根据不同类别收益分配方案分别计算该类别红利再投资份额；如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，其最短持有期限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 类份额、B 类份额不收取销售服务费，C 类份额收取销售服务费，各类别集合计划份额对应的可分配收益将有所不同，本集合计划同一类别的每一份集合计划份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 外币交易

本集合计划本报告期无外币交易。

#### 6.4.4.13 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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。

#### 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

执行《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》和《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（2017 年修订）（以下合称“新金融工具准则”）

财政部于 2017 年度修订了《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》和《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》。修订后的准则规定，对于首次执行日尚未终止确认的金融工具，之前的确认和计量与修订后的准则要求不一致的，应当追溯调整。涉及前期比较财务报表数据与修订后的准则要求不一致的，无需调整。

根据《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22 号）等有关规定，并与集合计划托管人协商一致，本集合计划自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具相关会计准则，因追溯调整产生的累积影响数调整 2022 年年初留存收益和其他综合收益，2021 年度的财务报表未做调整。执行新金融工具准则未对本集合计划的财务状况和集合计划净值产生重大影响。

##### 执行新金融工具准则

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收证券清算款和应收利息，金额分别为 3,176,694.78 元、1,647,994.35 元、406,185.60 元、846,127.47 元和 463.73 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收清算款和其他资产-应收利息，金额分别为 3,176,998.35 元、1,648,151.54 元、406,188.57 元、846,127.47 元和 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 30,218,550.71 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 30,218,550.71 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托

管费、应付交易费用和其他负债-预提费用，金额分别为 796,621.37 元、36,599.06 元、7,660.66 元、16,353.20 元和 10,304.28 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-预提费用，金额分别为 796,621.37 元、36,599.06 元、7,660.66 元、16,353.20 元和 10,304.28 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本集合计划持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本集合根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资管理运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

(4) 本集合计划的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	9,832,287.46
等于：本金	9,831,322.94
加：应计利息	964.52
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	9,832,287.46

##### 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	57,388,672.10	-	61,122,011.72	3,733,339.62
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	57,388,672.10	-	61,122,011.72	3,733,339.62

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	5,895,966.67	-	-	
其中：股指期货 投资	5,895,966.67	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	5,895,966.67	-	-	

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持有股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0元。

本期末 2022 年 6 月 30 日股指期货投资具体如下：

项目 持仓量（买/卖） 合约名义金额（元） 合约市值（元） 公允价值变动（元）

IC2112 5 5,895,966.67 6,260,200.00 364,233.33

总额合计：364,233.33 元

减：可抵销期货暂收款：364,233.33 元

股指期货投资净额：0.00 元

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2212	IC2212	5.00	6,260,200.00	364,233.33
合计				364,233.33
减：可抵销期货				364,233.33

暂收款				
净额				-

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本集合计划本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本集合计划本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本集合计划本报告期末其他资产无余额。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	23,220.03
其中：交易所市场	23,220.03
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	72,734.80
合计	95,954.83

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 海通量化成长精选 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	37,304,408.54	37,304,408.54
本期赎回（以“-”号填列）	-2.55	-2.55
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	37,304,405.99	37,304,405.99

## 海通量化成长精选 B

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,781,603.61	29,781,603.61
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-2,325,217.88	-2,325,217.88
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	27,456,385.73	27,456,385.73

## 海通量化成长精选 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	3,119,220.70	3,119,220.70
本期赎回（以“-”号填列）	-1.70	-1.70
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	3,119,219.00	3,119,219.00

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

## 6.4.7.11 其他综合收益

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 海通量化成长精选 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-3,810,456.86	2,427,653.33	-1,382,803.53
本期基金份额交易产生的变动数	5,587,157.27	-633,169.11	4,953,988.16
其中：基金申购款	5,587,157.70	-633,169.12	4,953,988.58
基金赎回款	-0.43	0.01	-0.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,776,700.41	1,794,484.22	3,571,184.63

## 海通量化成长精选 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	8,536,211.48	-2,959,084.80	5,577,126.68
本期利润	-2,943,786.05	254,222.30	-2,689,563.75
本期基金份额交易产生的变动数	-612,788.01	359,648.01	-253,140.00
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-612,788.01	359,648.01	-253,140.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,979,637.42	-2,345,214.49	2,634,422.93

## 海通量化成长精选 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-355,966.63	217,016.20	-138,950.43
本期基金份额交易产生的变动数	504,871.02	-72,845.02	432,026.00
其中：基金申购款	504,871.33	-72,845.03	432,026.30
基金赎回款	-0.31	0.01	-0.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	148,904.39	144,171.18	293,075.57

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	14,981.93
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	2,188.62
其他	83.34
合计	17,253.89

注：其他包括结算保证金利息收入、港股通风控资金利息收入。

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-7,028,517.41
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-7,028,517.41

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	139,453,028.68
减：卖出股票成本总额	146,275,537.68
减：交易费用	206,008.41
买卖股票差价收入	-7,028,517.41

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本集合计划本报告期无债券投资收益。

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。



## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本集合计划本报告期末产生衍生工具收益。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	-412,464.04

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	672,844.61
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	672,844.61

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	2,608,511.41
股票投资	2,608,511.41
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	254,419.99
权证投资	-
期货投资	254,419.99

3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-35,960.43
合计	2,898,891.83

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	0.05
合计	0.05

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本集合计划本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	4,354.86
信息披露费	58,075.66
证券出借违约金	-
银行费用	156.00
账户维护费	9,600.00
组合费	15.12
合计	72,201.64

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本集合计划并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海海通证券资产管理有限公司（“海通资管”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

1、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。

2、本集合计划合同生效日为 2021 年 12 月 23 日，无上年度同期对比数据。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
海通证券	314,023,515.96	100.00

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
海通证券	39,059.63	100.00	23,220.03	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	234,720.39
其中：支付销售机构的客户维护费	75,454.17

注：本集合计划本期共发生应支付的固定管理费 230,152.31 元（其中 A 类份额 113,886.92 元，B 类份额 106,007.15 元，C 类份额 10,258.24 元）。本集合计划 A 类份额和 C 类份额的固定管理费按 A 类份额和 C 类份额前一日集合计划资产净值的 0.8% 年费率计提，B 类份额的固定管理费按 B

类份额前一日集合计划资产净值的 0.7%年费率计提。固定管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{各类份额的年固定管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为各类份额每日应计提的集合计划管理费

E 为各类份额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。

2. 本集合计划本期共发生应支付的业绩报酬 4,568.08 元。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 5% 以上部分按照 10% 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。

A 类或 C 类份额业绩报酬的计算公式为：

当年化收益率  $R \geq 8\%$  = 每笔参与份额在上一个业绩报酬计提日的资产净值总额 \* (年化收益率  $R - 8.0\%$ ) \* 20% \* 投资者上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的年限（1 年按 365 天计算）

B 类份额业绩报酬的计算公式为：

当年化收益率  $R \geq 5\%$  = 每笔参与份额在上一个业绩报酬计提日的资产净值总额 \* (年化收益率  $R - 5.0\%$ ) \* 10% \* 投资者上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的年限（1 年按 365 天计算）

每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如该笔参与份额未发生业绩报酬计提，存续期内申购的，以申购当日为上一个业绩报酬计提日）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。

3. 实际支付销售机构的客户维护费以本集合计划管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	45,993.09

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	海通量化成长精选 A	海通量化成长精选 B	海通量化成长精选 C	合计
工商银行	-	-	1,413.31	1,413.31
海通证券	-	-	4,994.00	4,994.00
海通资管	-	-	0.21	0.21
合计	-	-	6,407.52	6,407.52

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：

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

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本集合计划报告期末与关联方通过银行间同业市场进债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本集合计划本报告期末与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本集合计划本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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
基金合同生效日 (2021 年 12 月 23 日)持有的基金份额	0.00	0.00	0.00
报告期初持有的基 金份额	0.00	0.00	0.00
报告期内申购/买入 总份额	7,755,089.15	0.00	0.00
报告期内因拆分变 动份额	0.00	0.00	0.00
减: 报告期内赎回/ 卖出总份额	0.00	0.00	0.00
报告期末持有的基 金份额	7,755,089.15	0.00	0.00
报告期末持有的基 金份额 占基金总份额比例	20.7900%	0.0000%	0.0000%

注: 本表报告期末持有的集合计划份额占总份额比例的计算中, A、B、C 级比例分母为各自级别的份额。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注: 本报告期末有除管理人之外其他关联方投资本集合计划的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	9,832,287.46	14,981.93

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本集合计划均无其他关联交易事项的说明。

#### 6.4.11 利润分配情况

注: 本集合计划本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注: 本集合计划本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末无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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本集合计划本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本集合计划管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、合规与风险控制委员会、合规负责人、风控与稽核部和合规与法务部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本集合计划投资于一家上市公司发行的证券市值不超过集合计划资产净值的 10%，且本集合计划与由本集合计划管理人管理的其他全部公开募集性质的集合计划共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本集合计划在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；集合计划在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。由于国债、央行票据和政策性金融债的信用风险很低，故不在下表进行列示。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理。

本集合计划的管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本集合计划的申购赎回情况进行监控，保持投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本集合计划资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本集合计划的管理人在合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障持有人利益。

本集合计划所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过资产净值的 15%。此外，本集合计划可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过集合计划持有的债券资产的公允价值。



本集合计划本报告期末无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本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。

##### 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	9,832,287.46	-	-	-	9,832,287.46
结算备付金	2,687,735.79	-	-	-	2,687,735.79
存出保证金	888,182.96	-	-	-	888,182.96
交易性金融资产	-	-	-	61,122,011.72	61,122,011.72
资产总计	13,408,206.21	-	-	61,122,011.72	74,530,217.93
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	45,264.76	45,264.76
应付托管费	-	-	-	8,941.13	8,941.13
应付清算款	-	-	-	0.16	0.16
应付销售服务费	-	-	-	1,363.20	1,363.20
其他负债	-	-	-	95,954.83	95,954.83
负债总计	-	-	-	151,524.08	151,524.08
利率敏感度缺口	13,408,206.21	-	-	60,970,487.64	74,378,693.85
上年度末 2021年12月31日					
资产					
银行存款	3,176,694.78	-	-	-	3,176,694.78
结算备付金	1,647,994.35	-	-	-	1,647,994.35
存出保证金	406,185.60	-	-	-	406,185.60
交易性金融资产	-	-	-	30,218,550.71	30,218,550.71
应收清算款	-	-	-	846,127.47	846,127.47

其他资产	-	-	-	463.73	463.73
资产总计	5,230,874.73	-	-	31,065,141.91	36,296,016.64
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	36,599.06	36,599.06
应付托管费	-	-	-	7,660.66	7,660.66
应付清算款	-	-	-	796,621.37	796,621.37
应交税费	-	-	-	69,747.78	69,747.78
其他负债	-	-	-	26,657.48	26,657.48
负债总计	-	-	-	937,286.35	937,286.35
利率敏感度缺口	5,230,874.73	-	-	30,127,855.56	35,358,730.29

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
	相关风险变量的变 动	本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月 31日）
分析	市场利率上升 25 个 基点	-	-
	市场利率下降 25 个 基点	-	-

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划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基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			合计
	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	
以外币计价的 资产				
交易性金融资	-	699,630.94	-	699,630.94

产				
资产合计	-	699,630.94	-	699,630.94
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	-	699,630.94	-	699,630.94
项目	上年度末 2021 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				
资产合计	-	-	-	-
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	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.2.2 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）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	所有外币相对人民 币升值 5%	34,981.55	-
	所有外币相对人民 币贬值 5%	-34,981.55	-

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本集合计划主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特

殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，本集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于股票（含存托凭证）的比例占集合计划资产的 60%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的 0%-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的保证金后，现金或到期日在一年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。本集合计划通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本集合计划的管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	61,122,011.72	82.18	30,218,550.71	85.46
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	61,122,011.72	82.18	30,218,550.71	85.46

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注 6.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间抵销后的净额为 0。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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）	上年度末（2021年12月31日）	

分析	股票价格上升 5%	3,056,100.59	1,510,927.54
	股票价格下降 5%	-3,056,100.59	-1,510,927.54

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	61,122,011.72	30,218,550.71
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	61,122,011.72	30,218,550.71

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	61,122,011.72	82.01
	其中：股票	61,122,011.72	82.01
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	12,520,023.25	16.80
8	其他各项资产	888,182.96	1.19
9	合计	74,530,217.93	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 699,630.94 元，占资产净值比例为 0.94%。

### 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

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	623,514.00	0.84
B	采矿业	3,414,109.00	4.59
C	制造业	38,649,183.72	51.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,056,140.80	2.76
E	建筑业	1,166,471.01	1.57
F	批发和零售业	2,296,038.00	3.09
G	交通运输、仓储和邮政业	3,205,229.00	4.31
H	住宿和餐饮业	27,280.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,114,244.10	4.19
J	金融业	2,789,943.37	3.75
K	房地产业	959,569.00	1.29
L	租赁和商务服务业	794,261.00	1.07
M	科学研究和技术服务业	58,025.00	0.08

N	水利、环境和公共设施管理业	112,283.14	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,722.20	0.03
R	文化、体育和娱乐业	798,776.44	1.07
S	综合	338,591.00	0.46
	合计	60,422,380.78	81.24

### 7.2.2 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	699,630.94	0.94
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	699,630.94	0.94

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。

### 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

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	600648	外高桥	69,000	938,400.00	1.26
2	603379	三美股份	33,600	747,600.00	1.01
3	600566	济川药业	26,800	727,888.00	0.98
4	603355	莱克电气	28,180	710,981.40	0.96
5	00981	中芯国际	45,000	699,630.94	0.94
6	001872	招商港口	44,100	687,960.00	0.92
7	002815	崇达技术	53,600	686,616.00	0.92
8	600901	江苏租赁	130,000	666,900.00	0.90
9	600167	联美控股	77,900	583,471.00	0.78
10	600216	浙江医药	42,500	580,125.00	0.78
11	601298	青岛港	103,900	568,333.00	0.76
12	600580	卧龙电驱	38,300	552,286.00	0.74
13	603605	珀莱雅	3,320	548,397.60	0.74
14	600390	五矿资本	111,300	544,257.00	0.73

15	000559	万向钱潮	88,400	525,096.00	0.71
16	603456	九洲药业	10,000	517,000.00	0.70
17	603868	飞科电器	6,800	515,100.00	0.69
18	600732	爱旭股份	15,500	511,810.00	0.69
19	300308	中际旭创	16,100	499,905.00	0.67
20	603658	安图生物	10,200	498,678.00	0.67
21	002372	伟星新材	20,600	495,224.00	0.67
22	601615	明阳智能	14,600	493,480.00	0.66
23	000709	河钢股份	216,900	490,194.00	0.66
24	601869	长飞光纤	15,500	479,260.00	0.64
25	600967	内蒙一机	52,500	478,800.00	0.64
26	601958	金钼股份	53,300	471,172.00	0.63
27	002180	纳思达	9,300	470,766.00	0.63
28	002152	广电运通	50,400	467,208.00	0.63
29	688099	晶晨股份	4,598	464,398.00	0.62
30	600380	健康元	37,600	464,360.00	0.62
31	600392	盛和资源	20,400	461,040.00	0.62
32	000415	渤海租赁	212,200	460,474.00	0.62
33	002128	电投能源	30,900	442,488.00	0.59
34	600623	华谊集团	52,700	437,410.00	0.59
35	000878	云南铜业	37,900	431,681.00	0.58
36	000402	金融街	72,000	428,400.00	0.58
37	300832	新产业	9,400	424,034.00	0.57
38	603198	迎驾贡酒	6,300	410,382.00	0.55
39	600835	上海机电	29,300	402,289.00	0.54
40	600486	扬农化工	3,000	399,840.00	0.54
41	603790	雅运股份	37,000	393,310.00	0.53
42	000060	中金岭南	86,600	386,236.00	0.52
43	600970	中材国际	39,800	385,662.00	0.52
44	300257	开山股份	24,600	368,016.00	0.49
45	601106	中国一重	119,800	367,786.00	0.49
46	600985	淮北矿业	25,000	364,000.00	0.49
47	600563	法拉电子	1,700	348,772.00	0.47
48	603613	国联股份	3,885	344,211.00	0.46
49	000028	国药一致	11,300	336,627.00	0.45
50	000563	陕国投 A	107,500	335,400.00	0.45
51	002371	北方华创	1,200	332,544.00	0.45
52	600667	太极实业	44,500	328,410.00	0.44
53	600998	九州通	27,100	322,761.00	0.43
54	601969	海南矿业	37,400	321,266.00	0.43
55	600737	中粮糖业	42,200	317,344.00	0.43
56	000009	中国宝安	23,500	317,015.00	0.43



57	300037	新宙邦	6,000	315,360.00	0.42
58	002390	信邦制药	45,500	314,405.00	0.42
59	603589	口子窖	5,300	310,633.00	0.42
60	601118	海南橡胶	64,700	309,266.00	0.42
61	603267	鸿远电子	2,300	308,959.00	0.42
62	600157	永泰能源	191,100	303,849.00	0.41
63	002595	豪迈科技	13,435	300,137.90	0.40
64	601608	中信重工	78,700	298,273.00	0.40
65	300017	网宿科技	55,400	296,944.00	0.40
66	000717	韶钢松山	84,600	296,100.00	0.40
67	600728	佳都科技	45,400	293,284.00	0.39
68	600299	安迪苏	30,400	291,232.00	0.39
69	600765	中航重机	8,980	288,976.40	0.39
70	002155	湖南黄金	23,700	287,718.00	0.39
71	600598	北大荒	19,400	286,344.00	0.38
72	600704	物产中大	55,600	285,228.00	0.38
73	002138	顺络电子	10,400	283,400.00	0.38
74	600867	通化东宝	26,812	277,236.08	0.37
75	600879	航天电子	42,600	276,474.00	0.37
76	002506	协鑫集成	72,400	269,328.00	0.36
77	601098	中南传媒	28,500	269,040.00	0.36
78	600259	广晟有色	5,300	268,445.00	0.36
79	300009	安科生物	26,500	267,915.00	0.36
80	600350	山东高速	51,000	267,750.00	0.36
81	002831	裕同科技	9,000	265,950.00	0.36
82	000089	深圳机场	34,300	264,796.00	0.36
83	000869	张裕 A	8,900	264,686.00	0.36
84	000050	深天马 A	26,500	264,205.00	0.36
85	600373	中文传媒	26,361	263,346.39	0.35
86	600871	石化油服	138,200	261,198.00	0.35
87	600339	中油工程	89,800	259,522.00	0.35
88	000519	中兵红箭	8,700	253,605.00	0.34
89	688819	天能股份	7,300	252,434.00	0.34
90	300652	雷迪克	10,200	249,594.00	0.34
91	000997	新大陆	18,700	247,027.00	0.33
92	600166	福田汽车	85,300	241,399.00	0.32
93	002250	联化科技	14,700	240,639.00	0.32
94	002387	维信诺	35,700	239,904.00	0.32
95	002294	信立泰	8,500	238,850.00	0.32
96	002092	中泰化学	30,000	232,800.00	0.31
97	688090	瑞松科技	7,500	231,975.00	0.31
98	688181	八亿时空	5,355	231,871.50	0.31

99	601179	中国西电	49,100	229,788.00	0.31
100	002597	金禾实业	5,300	229,649.00	0.31
101	600120	浙江东方	57,200	229,372.00	0.31
102	600325	华发股份	30,300	229,371.00	0.31
103	600739	辽宁成大	15,600	227,448.00	0.31
104	601228	广州港	61,900	227,173.00	0.31
105	000959	首钢股份	47,400	225,624.00	0.30
106	000738	航发控制	8,000	224,800.00	0.30
107	600862	中航高科	8,000	224,800.00	0.30
108	600968	海油发展	86,900	224,202.00	0.30
109	300097	智云股份	30,100	223,041.00	0.30
110	600885	宏发股份	5,320	222,642.00	0.30
111	002913	奥士康	7,000	221,550.00	0.30
112	000937	冀中能源	29,500	220,070.00	0.30
113	600482	中国动力	14,000	219,940.00	0.30
114	002081	金螳螂	42,300	214,884.00	0.29
115	003033	征和工业	8,000	214,400.00	0.29
116	300618	寒锐钴业	3,700	214,304.00	0.29
117	688500	慧辰股份	9,550	212,487.50	0.29
118	601598	中国外运	54,400	211,072.00	0.28
119	002841	视源股份	2,800	210,896.00	0.28
120	300341	麦克奥迪	23,200	210,888.00	0.28
121	600177	雅戈尔	31,700	210,171.00	0.28
122	300418	昆仑万维	13,100	209,600.00	0.28
123	600717	天津港	51,800	207,718.00	0.28
124	600905	三峡能源	33,000	207,570.00	0.28
125	688777	中控技术	2,805	204,091.80	0.27
126	000983	山西焦煤	15,200	203,528.00	0.27
127	600006	东风汽车	26,800	202,340.00	0.27
128	600372	中航电子	10,400	201,656.00	0.27
129	002065	东华软件	31,900	201,608.00	0.27
130	300669	沪宁股份	21,300	201,072.00	0.27
131	601003	柳钢股份	49,600	200,880.00	0.27
132	605088	冠盛股份	14,900	200,852.00	0.27
133	002028	思源电气	5,600	199,696.00	0.27
134	002203	海亮股份	17,100	197,505.00	0.27
135	601916	浙商银行	59,000	195,880.00	0.26
136	600823	世茂股份	65,100	193,998.00	0.26
137	000932	华菱钢铁	37,700	191,893.00	0.26
138	600875	东方电气	11,400	187,530.00	0.25
139	000633	合金投资	25,300	186,714.00	0.25
140	300396	迪瑞医疗	13,000	185,120.00	0.25

141	601568	北元集团	28,710	182,021.40	0.24
142	600642	申能股份	31,500	178,920.00	0.24
143	300699	光威复材	3,000	176,610.00	0.24
144	600271	航天信息	16,100	176,134.00	0.24
145	688390	固德威	560	175,285.60	0.24
146	600233	圆通速递	8,500	173,315.00	0.23
147	600152	维科技术	28,300	172,913.00	0.23
148	000156	华数传媒	21,500	171,355.00	0.23
149	603601	再升科技	26,900	171,084.00	0.23
150	300724	捷佳伟创	1,900	169,765.00	0.23
151	002966	苏州银行	27,770	169,397.00	0.23
152	600415	小商品城	30,000	167,100.00	0.22
153	000960	锡业股份	9,900	166,023.00	0.22
154	002054	德美化工	20,600	165,624.00	0.22
155	300626	华瑞股份	18,600	165,354.00	0.22
156	002381	双箭股份	25,700	164,994.00	0.22
157	300474	景嘉微	2,400	164,136.00	0.22
158	002796	世嘉科技	21,100	163,736.00	0.22
159	300448	浩云科技	30,500	163,480.00	0.22
160	002224	三力士	35,200	163,328.00	0.22
161	603238	诺邦股份	15,400	163,240.00	0.22
162	300267	尔康制药	46,400	161,008.00	0.22
163	300067	安诺其	45,600	160,968.00	0.22
164	600819	耀皮玻璃	31,000	160,270.00	0.22
165	002465	海格通信	17,600	159,984.00	0.22
166	300391	康跃科技	14,200	157,620.00	0.21
167	601333	广深铁路	71,700	156,306.00	0.21
168	002391	长青股份	22,000	156,200.00	0.21
169	300135	宝利国际	60,100	155,058.00	0.21
170	600315	上海家化	3,600	153,900.00	0.21
171	603188	亚邦股份	36,600	153,720.00	0.21
172	601326	秦港股份	53,500	151,405.00	0.20
173	600722	金牛化工	27,800	151,232.00	0.20
174	603000	人民网	13,400	150,080.00	0.20
175	601128	常熟银行	19,400	148,216.00	0.20
176	688122	西部超导	1,600	147,520.00	0.20
177	000547	航天发展	12,300	146,862.00	0.20
178	603707	健友股份	5,200	146,640.00	0.20
179	300357	我武生物	2,800	145,684.00	0.20
180	002842	翔鹭钨业	16,900	144,326.00	0.19
181	002174	游族网络	14,700	143,619.00	0.19
182	688002	睿创微纳	3,608	143,309.76	0.19

183	600236	桂冠电力	23,500	143,115.00	0.19
184	002625	光启技术	8,200	141,614.00	0.19
185	002985	北摩高科	2,290	134,148.20	0.18
186	002946	新乳业	10,200	132,498.00	0.18
187	000690	宝新能源	29,800	130,524.00	0.18
188	600917	重庆燃气	17,800	128,516.00	0.17
189	000988	华工科技	5,500	127,435.00	0.17
190	600038	中直股份	2,800	126,560.00	0.17
191	603866	桃李面包	7,420	122,801.00	0.17
192	601077	渝农商行	33,000	122,100.00	0.16
193	000999	华润三九	2,600	117,000.00	0.16
194	002867	周大生	7,400	114,922.00	0.15
195	000825	太钢不锈	20,700	112,815.00	0.15
196	002396	星网锐捷	4,800	108,672.00	0.15
197	600064	南京高科	9,800	107,800.00	0.14
198	601992	金隅集团	37,600	104,152.00	0.14
199	601872	招商轮船	17,700	101,952.00	0.14
200	000598	兴蓉环境	19,900	101,689.00	0.14
201	000596	古井贡酒	400	99,864.00	0.13
202	000568	泸州老窖	400	98,616.00	0.13
203	600809	山西汾酒	300	97,440.00	0.13
204	002616	长青集团	19,400	93,314.00	0.13
205	603369	今世缘	1,809	92,259.00	0.12
206	000407	胜利股份	24,700	91,884.00	0.12
207	601868	中国能建	38,573	91,418.01	0.12
208	600979	广安爱众	27,600	88,596.00	0.12
209	002936	郑州银行	32,300	86,887.00	0.12
210	600039	四川路桥	8,100	85,293.00	0.11
211	601860	紫金银行	29,700	85,239.00	0.11
212	002223	鱼跃医疗	3,200	82,112.00	0.11
213	601997	贵阳银行	14,100	81,921.00	0.11
214	002281	光迅科技	4,600	80,868.00	0.11
215	600498	烽火通信	5,400	78,192.00	0.11
216	000930	中粮科技	8,600	77,744.00	0.10
217	600582	天地科技	15,734	75,208.52	0.10
218	601828	美凯龙	11,700	70,902.00	0.10
219	601717	郑煤机	4,900	70,609.00	0.09
220	002048	宁波华翔	4,300	68,886.00	0.09
221	002430	杭氧股份	2,200	68,772.00	0.09
222	601866	中远海发	22,900	68,700.00	0.09
223	002191	劲嘉股份	6,300	67,536.00	0.09
224	000987	越秀金控	9,585	67,382.55	0.09

225	600060	海信视像	5,300	66,250.00	0.09
226	000513	丽珠集团	1,800	65,178.00	0.09
227	600195	中牧股份	5,200	63,752.00	0.09
228	000785	居然之家	14,300	63,635.00	0.09
229	000729	燕京啤酒	6,500	62,790.00	0.08
230	603927	中科软	2,640	61,564.80	0.08
231	002756	永兴材料	400	60,884.00	0.08
232	002221	东华能源	6,500	60,515.00	0.08
233	600801	华新水泥	3,100	60,481.00	0.08
234	600522	中天科技	2,600	60,060.00	0.08
235	600297	广汇汽车	22,300	58,203.00	0.08
236	300012	华测检测	2,500	58,025.00	0.08
237	000581	威孚高科	2,900	55,825.00	0.08
238	300363	博腾股份	700	54,593.00	0.07
239	000401	冀东水泥	5,100	53,652.00	0.07
240	300182	捷成股份	9,600	52,800.00	0.07
241	002701	奥瑞金	10,100	52,520.00	0.07
242	002233	塔牌集团	5,900	52,215.00	0.07
243	000553	安道麦 A	4,200	50,862.00	0.07
244	600637	东方明珠	7,100	50,765.00	0.07
245	601991	大唐发电	20,500	49,815.00	0.07
246	002078	太阳纸业	4,000	49,240.00	0.07
247	002318	久立特材	3,000	47,970.00	0.06
248	600567	山鹰国际	17,300	47,921.00	0.06
249	600839	四川长虹	16,300	46,944.00	0.06
250	600597	光明乳业	3,500	44,205.00	0.06
251	601156	东航物流	2,200	43,560.00	0.06
252	603156	养元饮品	1,900	43,168.00	0.06
253	601928	凤凰传媒	5,907	42,235.05	0.06
254	603885	吉祥航空	2,300	41,377.00	0.06
255	603317	天味食品	1,440	40,996.80	0.06
256	300769	德方纳米	100	40,868.00	0.05
257	600348	华阳股份	2,600	40,196.00	0.05
258	600398	海澜之家	8,200	38,950.00	0.05
259	601456	国联证券	3,000	36,810.00	0.05
260	000887	中鼎股份	2,000	36,480.00	0.05
261	600487	亨通光电	2,500	36,350.00	0.05
262	300073	当升科技	400	36,136.00	0.05
263	600096	云天化	1,100	34,628.00	0.05
264	600859	王府井	1,300	33,774.00	0.05
265	603345	安井食品	200	33,574.00	0.05
266	300888	稳健医疗	500	33,250.00	0.04

267	600546	山煤国际	1,700	33,082.00	0.04
268	300146	汤臣倍健	1,500	32,475.00	0.04
269	603983	丸美股份	1,200	32,160.00	0.04
270	002010	传化智联	5,000	32,150.00	0.04
271	002422	科伦药业	1,700	31,790.00	0.04
272	600256	广汇能源	3,000	31,620.00	0.04
273	600027	华电国际	8,000	31,440.00	0.04
274	600820	隧道股份	5,000	30,600.00	0.04
275	601611	中国核建	3,600	30,204.00	0.04
276	688006	杭可科技	400	28,024.00	0.04
277	600258	首旅酒店	1,100	27,280.00	0.04
278	600507	方大特钢	3,800	26,562.00	0.04
279	300390	天华超净	300	26,220.00	0.04
280	600499	科达制造	1,200	24,768.00	0.03
281	600673	东阳光	2,400	21,576.00	0.03
282	002056	横店东磁	800	21,296.00	0.03
283	300630	普利制药	600	21,090.00	0.03
284	002384	东山精密	900	20,637.00	0.03
285	002797	第一创业	3,100	19,871.00	0.03
286	600160	巨化股份	1,500	19,725.00	0.03
287	300168	万达信息	2,000	18,880.00	0.03
288	000831	五矿稀土	600	18,750.00	0.03
289	300244	迪安诊断	602	18,722.20	0.03
290	600497	驰宏锌锗	3,600	18,684.00	0.03
291	002624	完美世界	1,300	18,681.00	0.03
292	300070	碧水源	3,500	18,235.00	0.02
293	002468	申通快递	1,500	17,880.00	0.02
294	002004	华邦健康	3,200	17,856.00	0.02
295	002399	海普瑞	1,000	17,580.00	0.02
296	300253	卫宁健康	2,000	17,560.00	0.02
297	002030	达安基因	1,000	17,190.00	0.02
298	000998	隆平高科	1,000	16,660.00	0.02
299	600863	内蒙华电	4,500	16,425.00	0.02
300	600435	北方导航	1,900	16,378.00	0.02
301	300482	万孚生物	400	16,284.00	0.02
302	600079	人福医药	1,000	16,000.00	0.02
303	600037	歌华有线	1,700	15,963.00	0.02
304	600787	中储股份	2,800	15,932.00	0.02
305	002458	益生股份	1,200	11,244.00	0.02
306	002925	盈趣科技	80	1,721.60	0.00
307	603816	顾家家居	26	1,472.38	0.00
308	603568	伟明环保	22	734.14	0.00

309	603893	瑞芯微	7	636.58	0.00
310	000685	中山公用	35	268.80	0.00
311	600864	哈投股份	34	171.02	0.00
312	000686	东北证券	20	139.80	0.00
313	600008	首创环保	20	58.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600648	外高桥	1,262,324.00	3.57
2	002815	崇达技术	1,173,974.00	3.32
3	000598	兴蓉环境	1,005,879.00	2.84
4	601615	明阳智能	997,516.00	2.82
5	000709	河钢股份	977,985.00	2.77
6	000930	中粮科技	952,649.00	2.69
7	000686	东北证券	939,354.20	2.66
8	000559	万向钱潮	931,721.00	2.64
9	001872	招商港口	928,147.00	2.62
10	600867	通化东宝	919,836.40	2.60
11	000988	华工科技	915,570.00	2.59
12	600967	内蒙一机	897,597.00	2.54
13	002203	海亮股份	883,667.00	2.50
14	600597	光明乳业	878,621.00	2.48
15	300037	新宙邦	877,233.00	2.48
16	002152	广电运通	847,309.00	2.40
17	600566	济川药业	842,032.33	2.38
18	000060	中金岭南	819,117.00	2.32
19	600737	中粮糖业	813,484.00	2.30
20	601077	渝农商行	806,547.00	2.28
21	600728	佳都科技	801,863.00	2.27
22	603927	中科软	797,122.00	2.25
23	002440	闰土股份	787,653.00	2.23
24	600528	中铁工业	786,431.00	2.22
25	603156	养元饮品	782,013.00	2.21
26	603456	九洲药业	777,569.00	2.20
27	603379	三美股份	775,530.00	2.19
28	603707	健友股份	774,028.00	2.19
29	601958	金铂股份	742,040.00	2.10
30	600885	宏发股份	737,668.00	2.09
31	300699	光威复材	735,224.00	2.08
32	600623	华谊集团	733,485.00	2.07

33	600392	盛和资源	732,321.00	2.07
34	600901	江苏租赁	730,563.00	2.07
35	688099	晶晨股份	730,381.71	2.07
36	600216	浙江医药	730,124.00	2.06
37	600739	辽宁成大	724,952.00	2.05
38	600563	法拉电子	724,060.00	2.05
39	600348	华阳股份	723,885.00	2.05
40	600126	杭钢股份	716,851.00	2.03

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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000598	兴蓉环境	1,051,773.00	2.97
2	600528	中铁工业	993,905.29	2.81
3	002440	闰土股份	952,779.00	2.69
4	000988	华工科技	932,193.00	2.64
5	603927	中科软	923,293.80	2.61
6	000733	振华科技	910,771.00	2.58
7	000686	东北证券	907,099.00	2.57
8	600126	杭钢股份	872,392.00	2.47
9	600867	通化东宝	860,743.00	2.43
10	603156	养元饮品	856,688.00	2.42
11	600597	光明乳业	854,108.00	2.42
12	000930	中粮科技	833,831.00	2.36
13	002430	杭氧股份	800,323.00	2.26
14	000039	中集集团	790,784.00	2.24
15	600728	佳都科技	748,128.00	2.12
16	600056	中国医药	733,745.80	2.08
17	300763	锦浪科技	733,195.00	2.07
18	600348	华阳股份	726,907.00	2.06
19	600705	中航产融	722,282.00	2.04
20	000709	河钢股份	719,978.00	2.04
21	600188	兖矿能源	715,923.00	2.02
22	600787	中储股份	714,450.00	2.02
23	002399	海普瑞	708,551.00	2.00

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。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	174,570,487.28
卖出股票收入（成交）总额	139,453,028.68



注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

### 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

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有权证。

### 7.10 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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本产品暂不涉及国债期货投资。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本产品暂不涉及国债期货投资。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 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。

#### 7.12.2 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。

#### 7.12.3 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	888,182.96
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	888,182.96

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 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。

#### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
海通量化成长精选 A	477	78,206.30	7,755,089.15	20.79	29,549,316.84	79.21
海通量化成长精选 B	146	188,057.44	0.00	0	27,456,385.73	100
海通量化成长精选 C	94	33,183.18	0.00	0	3,119,219.00	100
合计	717	94,672.26	7,755,089.15	11.42	60,124,921.57	88.58

注：本表机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、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）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管	海通量化成长精选 A	555,881.87	1.4901

理人所有从业人员持有本基金	海通量化成长精选 B	773,971.11	2.8189
	海通量化成长精选 C	1,743.55	0.0559
	合计	1,331,596.53	1.9617

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海通量化成长精选 A	50~100
	海通量化成长精选 B	50~100
	海通量化成长精选 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	海通量化成长精选 A	0
	海通量化成长精选 B	50~100
	海通量化成长精选 C	0
	合计	50~100

## § 9 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
基金合同生效日（2021年12月23日）基金份额总额	-	29,781,603.61	-
本报告期期初基金份额总额	-	29,781,603.61	-
本报告期基金总申购份额	37,304,408.54	-	3,119,220.70
减：本报告期基金总赎回份额	2.55	2,325,217.88	1.70
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	37,304,405.99	27,456,385.73	3,119,219.00

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无集合计划份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2022 年 3 月 11 日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司第四届第三十四次董事会审议通过，周陶女士自 2022 年 3 月 10 日起不再担任公司合规总监，由总经理李井伟先生代任公司合规总监。

2、2022 年 5 月 20 日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司第四届第三十四次董事会审议通过，吴文然女士自 2022 年 5 月 18 日起担任公司合规总监。

3、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

1、因金融委托理财合同纠纷，四川信托有限公司向四川省成都市中级人民法院起诉，要求上海海通证券资产管理有限公司、海通证券股份有限公司等 13 个被告返还或赔偿原告委托财产 51,455 万元及相应利息。截止本报告披露日，该案尚未开庭审理。

2、报告期内未发生涉及基金托管业务的重大诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

基金投资策略未有重大变化

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内集合计划管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，集合计划管理人、集合计划托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
海通证券	2	314,023,515.96	100.00	39,059.63	100.00	-

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
海通证券	-	-	-	-	-	-

## 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	上海海通证券资产管理有限公司旗下参公集合资产管理计划转换业务规则说明	规定披露媒介	2022 年 3 月 30 日
2	上海海通证券资产管理有限公司关于开通旗下部分集合资产管理计划转换业务及费率优惠活动的公告	规定披露媒介	2022 年 3 月 30 日
3	上海海通证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	规定披露媒介	2022 年 5 月 20 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期无单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，未发现影响投资者决策的其他重要信息。
--------------------------

## § 12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准海通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

## 12.2 存放地点

集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所。

## 12.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人网站([www.htsamc.com](http://www.htsamc.com))查阅，或在营业时间内至集合计划管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本集合计划管理人：上海海通证券资产管理有限公司

客户服务中心电话：95553

上海海通证券资产管理有限公司

2022 年 8 月 31 日