

海通核心优势一年持有期混合型集合资产 管理计划 2022 年年度报告

2022 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：2023 年 3 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、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 2023 年 3 月 27 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 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	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
§ 4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	26
§ 8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	61

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	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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	68
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	68
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	68
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	68
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12 投资组合报告附注	69
§ 9 基金份额持有人信息	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
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	70
§ 10 开放式基金份额变动	70
§ 11 重大事件揭示	71
11.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4 基金投资策略的改变	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
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	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
11.8 其他重大事件	72
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	73
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	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§ 13 备查文件目录	73
13.1 备查文件目录	73
13.2 存放地点	73
13.3 查阅方式	74

§ 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	544,868,818.18份		
基金合同存续期	不定期		
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	467,027,729.42份	55,652,331.88份	22,188,756.88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。 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。

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	吴文然	陆志俊
	联系电话	021-23154762	95559
	电子邮箱	htam@haitong.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		95553、4008888001	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	2022 年			2021 年			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	海通核心 优势 A	海通核心 优势 B	海通核心 优势 C	海通核心优 势 A	海通核心 优势 B	海通核心 优势 C

标									
本期已实现收益	-80,878,942.16	-9,225,101.97	-3,924,451.67	192,932,959.86	18,156,737.34	8,544,417.38	16,224,026.99	470,026.55	417,916.06
本期利润	-153,727,877.81	-16,565,336.21	-7,447,268.12	-196,112,196.69	-11,950,198.98	-9,708,424.71	481,549,795.59	13,221,337.04	23,897,133.45
加权平均基金份额本期利润	-0.3040	-0.2963	-0.3084	-0.1262	-0.1844	-0.1247	0.2439	0.1914	0.2353
本期加权平均净值利润率	-36.44%	-35.65%	-37.35%	-10.67%	-16.26%	-10.59%	22.40%	17.91%	21.66%
本期基金份额净值增长	-29.16%	-29.15%	-29.51%	-14.84%	-14.84%	-15.27%	19.40%	19.39%	19.02%

率									
3.1 3.2 期末 数据和 指标	2022 年末			2021 年末			2020 年末		
期末 可供 分配 利润	-130,611, 765.75	-15,566, 320.93	-6,414,9 59.19	9,569,928 .66	937,982. 17	236,439. 79	17,276,192 .26	458,337. 14	450,060. 41
期末 可供 分配 基金 份额 利润	-0.2797	-0.2797	-0.2891	0.0168	0.0167	0.0085	0.0069	0.0068	0.0035
期末 基金 资产 净值	336,415,9 63.67	40,086,0 10.95	15,773,7 97.69	579,931,2 20.32	57,032,2 81.90	28,081,62 97.91	2,996,939, 962.82	80,303,9 87.40	154,224, 025.94
期末 基金 份额 净	0.7203	0.7203	0.7109	1.0168	1.0167	1.0085	1.1940	1.1939	1.1902

值									
3.1 3.3 累计 期末 指标	2022 年末			2021 年末			2020 年末		
基金 份额 累计 净值 增长 率	-27.97%	-27.97%	-28.91%	1.68%	1.67%	0.85%	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	-6.13%	1.12%	4.06%	0.92%	-10.19%	0.20%
过去六个月	-18.49%	1.18%	-6.81%	0.79%	-11.68%	0.39%
过去一年	-29.16%	1.37%	-11.69%	0.92%	-17.47%	0.45%
自基金合同生效	-27.97%	1.19%	4.31%	0.82%	-32.28%	0.37%

起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

海通核心优势 B

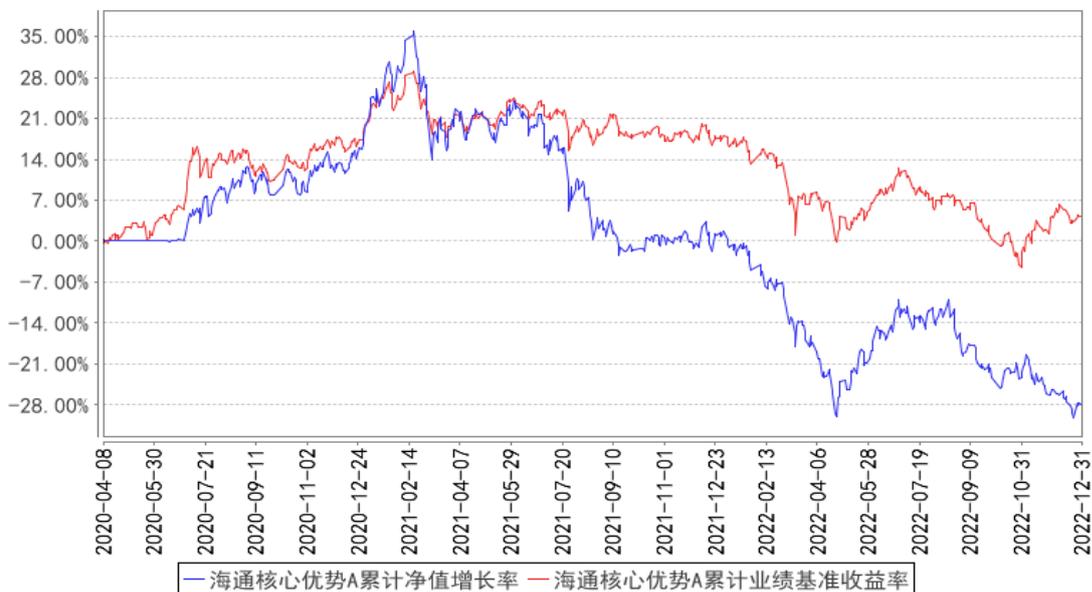
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.13%	1.12%	4.06%	0.92%	-10.19%	0.20%
过去六个月	-18.48%	1.18%	-6.81%	0.79%	-11.67%	0.39%
过去一年	-29.15%	1.37%	-11.69%	0.92%	-17.46%	0.45%
自基金合同生效 起至今	-27.97%	1.19%	4.31%	0.82%	-32.28%	0.37%

海通核心优势 C

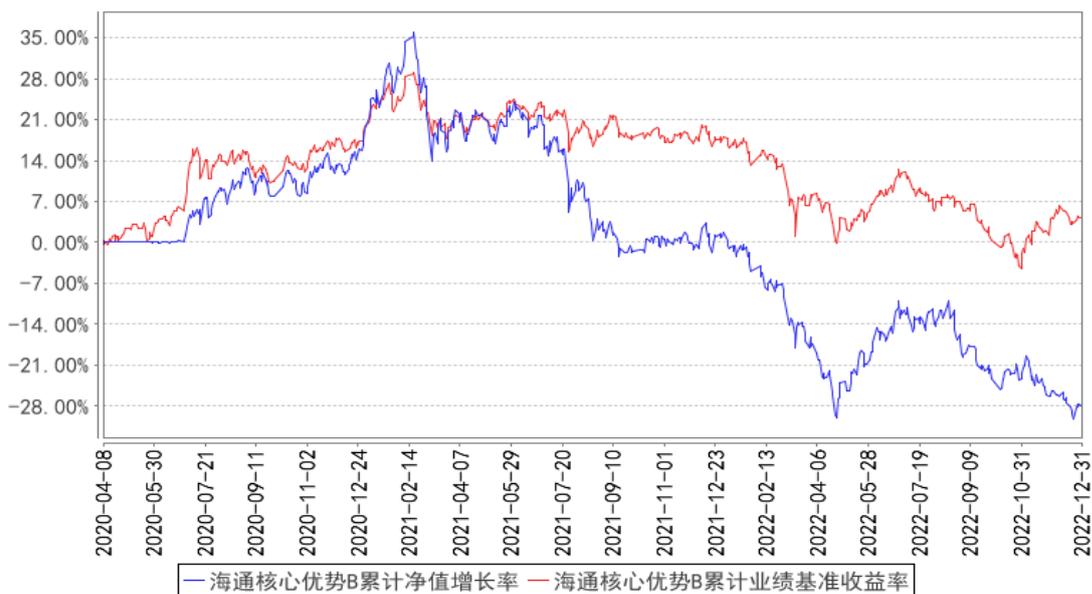
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.24%	1.12%	4.06%	0.92%	-10.30%	0.20%
过去六个月	-18.69%	1.18%	-6.81%	0.79%	-11.88%	0.39%
过去一年	-29.51%	1.37%	-11.69%	0.92%	-17.82%	0.45%
自基金合同生效 起至今	-28.91%	1.19%	4.31%	0.82%	-33.22%	0.37%

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

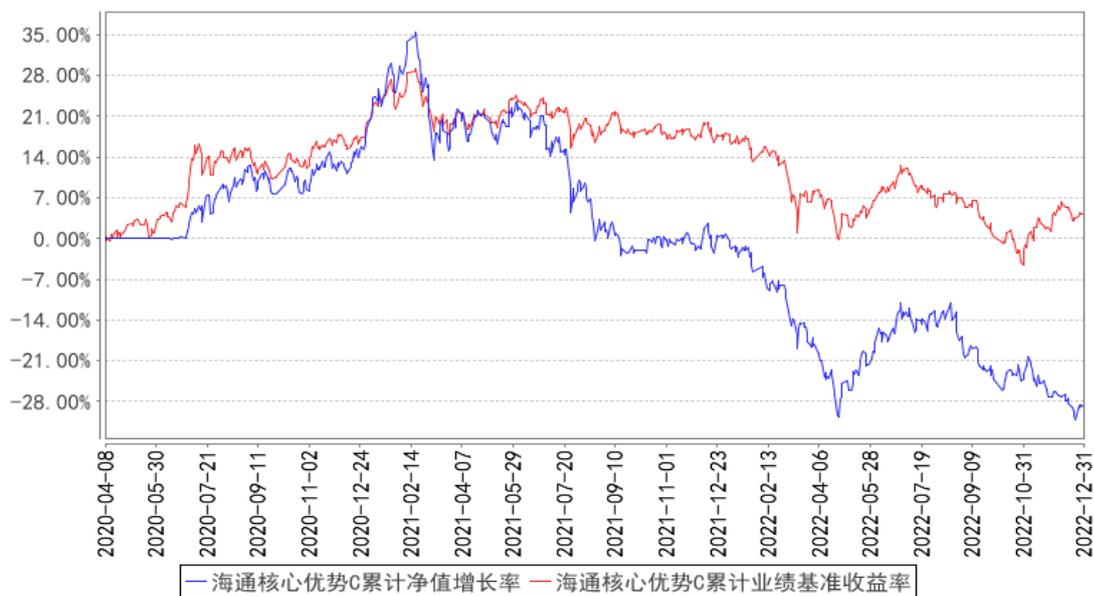
海通核心优势A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

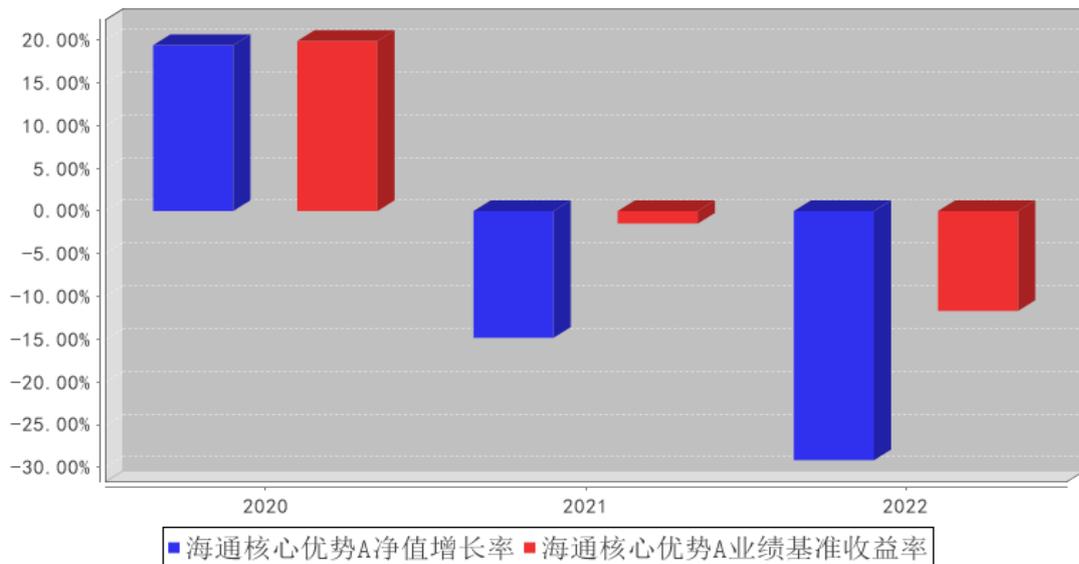


海通核心优势C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

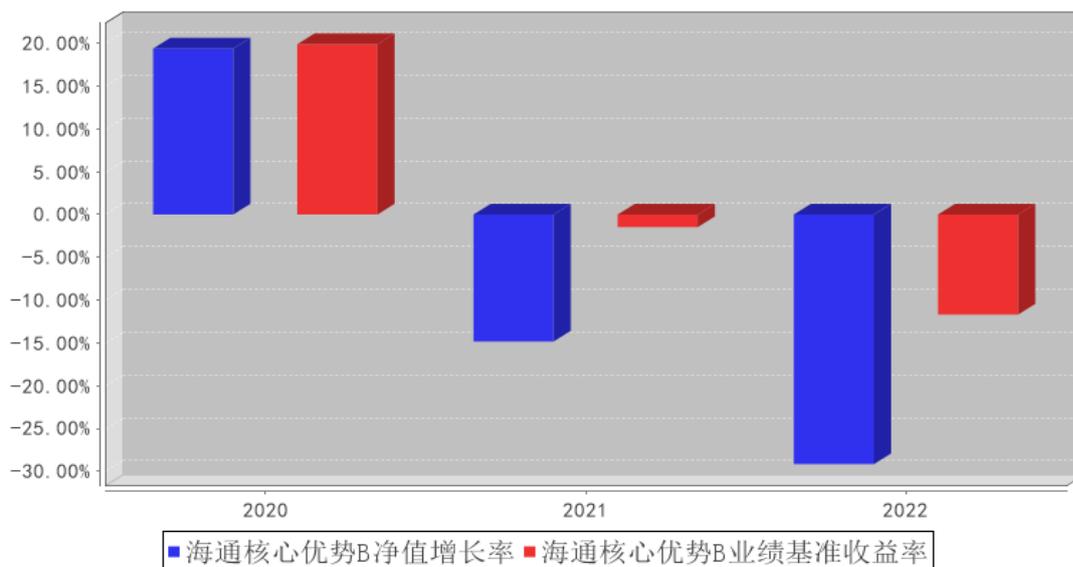


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

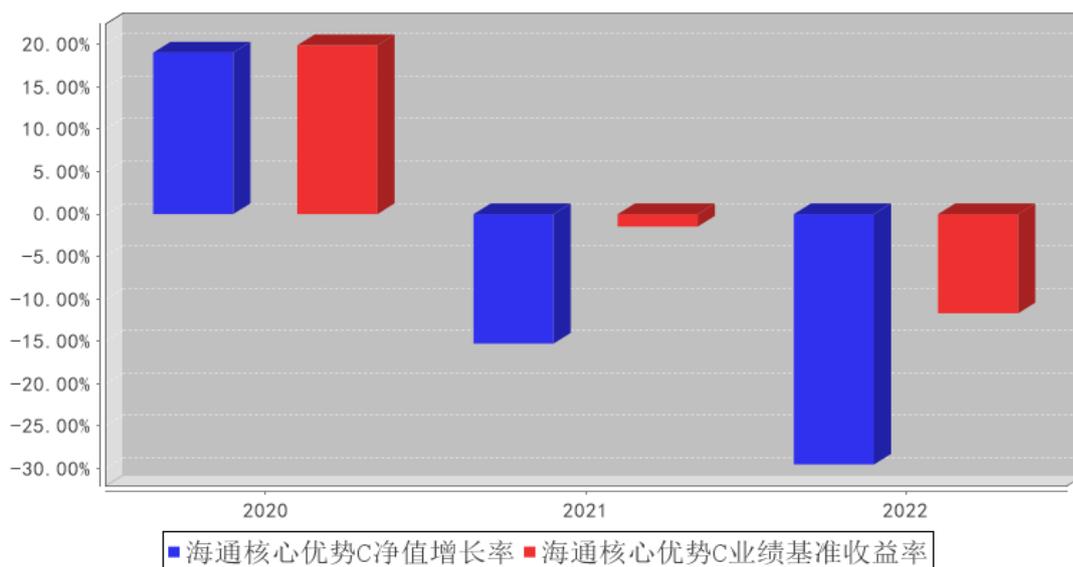
海通核心优势A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



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 过去三年基金的利润分配情况

注：本集合计划2020年4月8日（集合计划合同生效日）至2022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 2022 年 12 月 31 日，集合资产管理计划管理人共管理 17 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		
李晨	投资经理	2021 年 12 月 29 日	-	6 年	6 年证券从业经验，2016 年加入上海海通证券资产管理有限公司，曾任权益研究部研究员、专户权益部投资经理助理，现任公募权益部投资经理。
于志浩	投资经理	2021 年 12 月 29 日	-	6 年	6 年证券从业经验，曾就职于中国第一重型机械集团、WOOD GROUP（戈朗（上海）海事技术咨询有限公司），2016 年加入上海海通证券资产管理有限公司，曾任权益研究部研究员，现任公募权益部投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规以及集合计划合同、招募说明书的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在控制风险的基础上，为计划份额持有人谋求最大利益，没有发生损害计划份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2.1 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

2022 年在内外部环境冲击下，宏观经济波动显著，市场主要指数经历了一轮回调，上证指数全年下跌 15.13%，深证成指全年下跌 25.85%，创业板指全年下跌 29.37%。

从基本面看，2022 年市场面临着一些内外部的压力。2022 年房地产持续低迷，房地产开发投资额累计同比减少 10.0%；俄乌冲突导致能源价格抬升，海外通胀处于高位，美联储开启加息周期，全年累计加息 7 次；中国的出口在 2022 年下半年受到了海外需求走弱的影响，8 月份同比增速显著回落，10 月同比增速转负。2022 年，申万一级行业中煤炭录得 10.95%的正收益，社会服务、交通运输以及金融板块相对抗跌，电子、建筑材料、传媒、计算机等板块跌幅较多。

海通核心优势产品在 1 季度逐渐将主要仓位布局在制造与科技领域，持仓上秉承长期视角，挖掘良好的商业模式、较大成长空间中具有核心竞争力的公司。在公司布局的节奏上，也会考虑行业与公司所处的周期位置，包括产业生命周期、企业产能周期、产品周期等。

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 0.7203 元，B 份额净值为 0.7203 元，C 份额净值为 0.7109 元。本报告期集合计划三类份额净值增长率分别为 -29.16%、-29.15%、-29.51%，业绩比较基准收益率为-11.69%。

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 2023 年，国内方面，经济复苏是今年的主要逻辑方向，在这个过程中可能会有一些节奏上的扰动，比如某一两个月的经济数据较弱，或者某一个阶段市场对部分细分方向的预期过于充分，超出了经济复苏的强度，短期会有一个回调的过程，但大的方向上预计经济复苏仍将是全年的主要逻辑线。海外方面，2023 年美国通胀数据和就业数据以及与之相关的美国加息节奏仍然是影响市场的重要变量。我们将聚焦于中国工业中的优势产业和核心产业，重点布局制造和科技领域。中期维度，我们重点关注以下几个方面：

国内通用制造业的景气度处于缓慢复苏过程中，1 月份国内制造业 PMI 回升至 50.1%，2022

年 12 月国内制造业务产成品库存同比增长 9.8%，当前仍处于去库存阶段，12 月通用设备制造业产成品库存同比增长 1.5%，已处于较低位置。出口的景气度回落是压制制造业复苏的一个变量因素，在制造业务弱复苏的背景下，预计公司的业绩将出现一些分化，关注具有产业技术升级与国产替代逻辑的工控自动化、工业软件等细分方向。

当前半导体行业处于景气筑底阶段。2022 年 12 月中国半导体销售额同比减少 26.4%，降幅环比 11 月扩大 5.2 个百分点，以手机/PC 为代表的消费类需求疲弱，汽车/光伏需求相对较强。关注需求和库存边际变化，逢低布局模拟芯片、数字芯片、被动元器件等领域的景气拐点机会。

光伏行业预计随着硅料新产能在年中加速释放，价格中枢或将再次下移，需求方面也呈现向好态势。短期关注上半年盈利可能超预期的组件、储能、逆变器等，中期重点跟踪硅料降价后的组件价格是否能维持中高价位，关注中下游环节，包括组件、辅材、EPC 等；此外，长期仍需重视低渗透的新技术，包括 POE、电镀铜、钙钛矿等相关方向。锂电池与新能源车行业逐渐走向成熟稳健发展，左侧开始重点关注通过品牌建设、研发迭代、制造优势成为龙头的企业以及部分受益于技术发展的设备材料公司。

展望未来，中央经济工作会议上已经对 2023 年恢复社会信心、稳经济、扩内需做了定调，尽管经济发展面临的困难挑战仍较多，但在政策持续加码下，经济复苏应是大势所趋。中长期角度，我们将继续重点关注竞争壁垒强，收入、利润可以持续成长的公司。

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

本报告期内，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

本报告期内，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、集合计划费用开支、集合计划收益分配等问题上，托管人未发现损害集合计划持有人利益的行为。

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

本报告期内，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[2023]第 ZA30354 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

	<p>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 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>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财政部、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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>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 2022 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。</p> <p>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。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，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>
管理层和治理层对财务报表的责任	<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的规定编制财务报表，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>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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</p>

	<p>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>(1) 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>(2) 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>(3) 评价集合计划管理人管理层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>(4) 对集合计划管理人管理层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>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与集合计划管理人治理层就计划的审计范围、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。</p>
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	2023 年 3 月 29 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：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	101,313,166.03	86,611,415.51
结算备付金		2,705,272.87	11,429,739.37

存出保证金		338,105.40	375,267.92
交易性金融资产	7.4.7.2	289,876,412.08	393,148,653.29
其中：股票投资		289,876,412.08	393,146,477.61
基金投资		-	-
债券投资		-	2,175.68
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	5,998,218.08	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		1,265,308.62	185,073,216.86
应收股利		-	-
应收申购款		29,336.65	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-44,412.18
资产总计		401,525,819.73	676,593,880.77
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021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		-	-
应付清算款		8,546,428.84	7,682,815.28
应付赎回款		203,678.05	-
应付管理人报酬		270,294.32	461,913.59
应付托管费		40,544.15	69,287.04
应付销售服务费		6,794.30	12,206.38
应付投资顾问费		-	-
应交税费		500.25	3,146,481.96
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	181,807.51	175,976.39
负债合计		9,250,047.42	11,548,680.64
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	544,868,818.18	654,300,849.51
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-152,593,045.87	10,744,350.62

净资产合计		392,275,772.31	665,045,200.13
负债和净资产总计		401,525,819.73	676,593,880.77

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，集合计划份额总额 544,868,818.18 份，其中海通核心优势 A 份额净值（暂估业绩报酬前）0.7203 元，份额总额 467,027,729.42 份，资产净值（暂估业绩报酬前）336,415,963.67 元，相关暂估业绩报酬余额 0.00 元（于 2021 年 12 月 31 日 1,859.95 元），资产净值（暂估业绩报酬后）336,415,963.67 元。海通核心优势 B 份额净值（暂估业绩报酬前）0.7203 元，份额总额 55,652,331.88 份，资产净值（暂估业绩报酬前）40,086,010.95 元，相关暂估业绩报酬余额 0.00 元（于 2021 年 12 月 31 日 0.00 元），资产净值（暂估业绩报酬后）40,086,010.95 元。海通核心优势 C 份额净值（暂估业绩报酬前）0.7109 元，份额总额 22,188,756.88 份，资产净值（暂估业绩报酬前）15,773,797.69 元，相关暂估业绩报酬余额 0.00 元（于 2021 年 12 月 31 日 179.77 元），资产净值（暂估业绩报酬后）15,773,797.69 元。暂估业绩报酬为假设本集合计划于本报告期末按照当日的集合计划份额净值（计提业绩报酬前）清算，根据集合计划份额持有人持有的集合计划份额（包括未到期份额）至该日持有期间的收益情况估算的业绩报酬。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。

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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-172,830,997.82	-154,697,640.18
1. 利息收入		1,307,992.68	5,590,714.73
其中：存款利息收入	7.4.7.13	718,418.60	701,661.78
债券利息收入		-	2,420,576.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		589,574.08	2,468,476.49
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-90,459,366.49	275,901,168.16

其中：股票投资收益	7.4.7.14	-93,515,699.52	257,454,774.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	62,994.82	19,590.22
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	2,993,338.21	18,426,803.47
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）	7.4.7.20	-83,711,986.34	-437,404,934.96
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	32,362.33	1,215,411.89
减：二、营业总支出		4,909,484.32	63,073,180.20
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,922,201.37	54,856,350.19
2. 托管费	7.4.10.2.2	588,330.31	2,437,188.89
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	100,242.63	465,912.31
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		127,489.97	936,571.79
8. 其他费用	7.4.7.23	171,220.04	4,377,157.02
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-177,740,482.14	-217,770,820.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-177,740,482.14	-217,770,820.38
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-177,740,482.14	-217,770,820.38

7.3 净资产（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：2022年1月1日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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)	654,300,849.51	-	10,744,350.62	665,045,200.13
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)	654,300,849.51	-	10,744,350.62	665,045,200.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-109,432,031.33	-	-163,337,396.49	-272,769,427.82
(一)、综合收益总额	-	-	-177,740,482.14	-177,740,482.14
(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)	-109,432,031.33	-	14,403,085.65	-95,028,945.68
其中:1.基金申购款	4,993,900.03	-	-853,950.68	4,139,949.35
2.基金赎回款	-114,425,931.36	-	15,257,036.33	-99,168,895.03
(三)、	-	-	-	-

本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	544,868,818.18	-	-152,593,045.87	392,275,772.31
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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)	2,706,868,503.68	-	524,599,472.48	3,231,467,976.16
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)	2,706,868,503.68	-	524,599,472.48	3,231,467,976.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,052,567,654.17	-	-513,855,121.86	-2,566,422,776.03

(一)、综合收益总额	-	-	-217,770,820.38	-217,770,820.38
(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)	-2,052,567,654.17	-	-296,084,301.48	-2,348,651,955.65
其中:1.基金申购款	44,988,832.00	-	9,840,995.87	54,829,827.87
2.基金赎回款	-2,097,556,486.17	-	-305,925,297.35	-2,403,481,783.52
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	654,300,849.51	-	10,744,350.62	665,045,200.13

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

基金管理人负责人

陈颖

主管会计工作负责人

刘雯

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”）由海通新兴成长集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来。原集合计划为非限定性集合资产管理计划，于 2010 年 2 月 11 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2010〕180 号核准设立，自 2010 年 4 月 6 日起开始募集并于 2010 年 5 月 21 日结束募集，于 2010 年 5 月 26 日成立。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》（以下简称“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。

本集合计划根据申购费用、赎回费用、销售服务费、业绩报酬收取方式的不同，将集合计划份额分为不同的类别。

A 类份额：投资人申购时收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别集合计划资产中计提销售服务费。

B 类份额：原集合计划份额自本资产管理合同生效之日起全部自动转换为 B 类份额。资产管理合同生效后，管理人不办理 B 类份额的申购业务，红利再投资份额除外。对 B 类份额不设置锁定持有期，根据资产管理合同在每个开放日办理赎回业务。

C 类份额：从本类别集合计划资产中计提销售服务费而不收取申购费用，投资人赎回时根据持有期限收取赎回费用。

每份 A 类份额和 C 类份额均设定 1 年的锁定持有期。

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”）、2022 年中国证监会颁布的修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、2022 年财政部颁布的《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14 号）、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

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

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

自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止为一个会计年度。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划采用人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本集合计划成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本集合计划管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本集合计划现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本集合计划持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本集合计划管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本集合计划持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本集合计划将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本集合计划将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本集合计划于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本集合计划以前年度的如下会计政策。

(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、资产支持证券投资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款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

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本集合计划对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本集合计划考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本集合计划对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本集合计划按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本集合计划按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本集合计划按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本集合计划假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本集合计划对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本集合计划将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本集合计划于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本集合计划以前年度的如下会计政策。

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。当本集合计划依法有权抵销债权债务且该法定权利现在是可执行的，同时交易双方准备按净额进行结算，或同时结清资产和负债时，金融资产和负债以抵销后的净额在财务报表中列示。

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

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由本集合计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本集合计划于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本集合计划以前年度的如下会计政策。

存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提。

买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提。

股票投资收益/(损失)以卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)以卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本和应收利息的差额确认。

资产支持证券投资收益/(损失)为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本和应收利息的差额确认。

基金投资收益/(损失)以卖出/赎回基金交易日的成交总额扣除应结转的基金投资成本的差额确认。

基金红利收入按持有份额计算红利收入金额，于红利日确认并计入投资收益。

股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算，于除息日确认并计入投资收益。

公允价值变动损益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期转出时计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬（包括管理费和业绩报酬）、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按资产管理合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的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

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

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

根据本集合计划的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本集合计划确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本集合计划根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

(3) 根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”), 在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外), 采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

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》(以下合称“新金融工具准则”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《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), 本集合计划自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外, 中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》, 本集合计划的管理人已采用上述准则及通知编制本集合计划 2022 年度财务报表, 对本集合计划财务报表的影响列示如下:

(1) 执行新金融工具准则

根据新金融工具准则的相关规定, 本集合计划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。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。

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 86,611,415.51 元、11,429,739.37 元、375,267.92 元、185,073,216.86 元和-44,412.18 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、买入返售金融资产、应收清算款和其他资产-应收利息, 金额分别为 86,631,037.10 元、11,435,204.15 元、375,453.43 元、-69,684.37 元、185,073,216.86 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 393,148,653.29 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 393,148,653.60 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、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-预提费用，金额分别为 7,682,815.28 元、461,913.59 元、69,287.04 元、12,206.38 元、37,976.39 元和 138,000.00 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、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-预提费用，金额分别为 7,682,815.28 元、461,913.59 元、69,287.04 元、12,206.38 元、37,976.39 元和 138,000.00 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”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”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”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

“预期信用损失”模型适用于本集合计划持有的以摊余成本计量的金融资产。采用“预期信用损失”模型未对本集合计划 2022 年年初留存收益产生重大影响。

(2) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本集合计划的管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本集合计划财务报表产生重大影响。

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

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

1、增值税

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

根据财税[2017]56号文件的规定,2018年1月1日(含)以后,资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,以管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财税[2017]90号文件的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:(一)提供贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额;(二)转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本集合计划增值税的附加税费,包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等,按照实际缴纳增值税税额的适用比例计算,由管理人申报缴纳。

2、印花税

比照《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》(财税字[1998]55号)和《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税[2002]128号)文件的规定,基金管理人运用资产管理计划买卖股票,卖出股票按1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

3、所得税

根据《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税[2008]1号)的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,从基金分配中取得的收入,债券的利息收入以及其他收入,暂不征收企业所得税。

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	101,313,166.03	86,611,415.51
等于: 本金	101,289,032.95	-
加: 应计利息	24,133.08	-
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	101,313,166.03	86,611,415.51

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	309,437,036.90	-	289,876,412.08	-19,560,624.82
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	309,437,036.90	-	289,876,412.08	-19,560,624.82
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	327,070,750.97	-	393,146,477.61	66,075,726.64
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	1,999.95	2,175.68	175.73
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,999.95	2,175.68	175.73
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	327,072,750.92	-	393,148,653.29	66,075,902.37

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本集合计划本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,998,218.08	-
银行间市场	-	-
合计	5,998,218.08	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

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及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	-44,412.18
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	-44,412.18

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	9.71	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	49,797.80	37,976.39
其中：交易所市场	49,797.80	37,976.39
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	132,000.00	138,000.00
合计	181,807.51	175,976.39

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

海通核心优势 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	570,361,291.66	570,361,291.66
本期申购	4,625,130.72	4,625,130.72
本期赎回（以“-”号填列）	-107,958,692.96	-107,958,692.96
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	467,027,729.42	467,027,729.42

海通核心优势 B

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	56,094,299.73	56,094,299.73
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-441,967.85	-441,967.85
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	55,652,331.88	55,652,331.88

海通核心优势 C

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	27,845,258.12	27,845,258.12
本期申购	368,769.31	368,769.31
本期赎回（以“-”号填列）	-6,025,270.55	-6,025,270.55
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	22,188,756.88	22,188,756.88

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）。

7.4.7.11 其他综合收益

7.4.7.12 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
本期期初	166,297,337.21	-156,727,408.55	9,569,928.66
本期利润	-80,878,942.16	-72,848,935.65	-153,727,877.81
本期基金份额交易产生的变动数	-26,363,583.67	39,909,767.07	13,546,183.40
其中：基金申购款	1,053,027.84	-1,835,725.71	-782,697.87
基金赎回款	-27,416,611.51	41,745,492.78	14,328,881.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	59,054,811.38	-189,666,577.13	-130,611,765.75

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
本期期初	16,351,037.15	-15,413,054.98	937,982.17
本期利润	-9,225,101.97	-7,340,234.24	-16,565,336.21
本期基金份额交易产生的变动数	-92,374.88	153,407.99	61,033.11
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-92,374.88	153,407.99	61,033.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,033,560.30	-22,599,881.23	-15,566,320.93

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
本期期初	7,813,517.05	-7,577,077.26	236,439.79

本期利润	-3,924,451.67	-3,522,816.45	-7,447,268.12
本期基金份额交易产生的变动数	-1,377,112.08	2,172,981.22	795,869.14
其中：基金申购款	74,879.69	-146,132.50	-71,252.81
基金赎回款	-1,451,991.77	2,319,113.72	867,121.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,511,953.30	-8,926,912.49	-6,414,959.19

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	608,081.63	438,833.20
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	105,183.84	256,148.33
其他	5,153.13	6,680.25
合计	718,418.60	701,661.78

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、深港通风控资金利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	3,179,718,146.05	3,069,363,707.18
减：卖出股票成本总额	3,268,581,154.80	2,811,908,932.71
减：交易费用	4,652,690.77	-
买卖股票差价收入	-93,515,699.52	257,454,774.47

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日

债券投资收益——利息收入	62.57	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	62,932.25	19,590.22
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	62,994.82	19,590.22

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	323,997.20	243,655,172.24
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	260,999.95	238,010,680.73
减：应计利息总额	64.68	5,624,901.29
减：交易费用	0.32	-
买卖债券差价收入	62,932.25	19,590.22

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

7.4.7.16.2 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及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利收益	2,993,338.21	18,426,803.47
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	2,993,338.21	18,426,803.47

7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
1. 交易性金融资产	-85,636,527.19	-450,527,083.00
股票投资	-85,636,351.46	-450,095,911.28
债券投资	-175.73	-431,171.72
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	-1,924,540.85	-13,122,148.04
合计	-83,711,986.34	-437,404,934.96

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	32,355.73	1,215,411.89
基金转换费收入	6.60	-
合计	32,362.33	1,215,411.89

7.4.7.22 信用减值损失

注：本集合计划本报告期无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	12,000.00	18,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	740.00	1,765.00
账户维护费	37,200.00	37,200.00
证券组合费	1,280.04	-
交易费用	-	4,200,192.02
合计	171,220.04	4,377,157.02

7.4.7.24 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”）	基金管理人、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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
--------------------	-----------------

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 2022年1月1日至2022年12月 31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例(%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
海通证券	6,424,634,921.60	100.00	3,867,874,861.49	100.00

7.4.10.1.2 权证交易

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 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	809,940.84	100.00	49,797.80	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	509,720.79	100.00	37,976.39	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 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,922,201.37	54,856,350.19
其中：支付销售机构的客户维护费	256,592.13	7,134,428.81

注：1. 本集合计划本期共发生应支付的固定管理费 3,922,201.37 元。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。

2. 本集合计划本期共发生应支付的业绩报酬 0.00 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 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。

A 类或 C 类计划份额业绩报酬的计算公式为：

当年化收益率 $R \geq 8\%$ = 每笔参与在上一个业绩报酬计提日的资产净值总额 * (期间年化收益率 - 8%) * 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 类计划份额业绩报酬的计算公式为：

当年化收益率 $R \geq 10\%$ = 每笔参与在上一个业绩报酬计提日的资产净值总额 * (期间年化收益率 - 10%) * 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)

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，募集期认购的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提日，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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	588,330.31	2,437,188.89

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 关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	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	-	-	79,129.08	79,129.08
海通资管	-	-	278.62	278.62
合计	-	-	79,407.70	79,407.70
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	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	-	-	422,888.63	422,888.63
海通资管	-	-	501.43	501.43
合计	-	-	423,390.06	423,390.06

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及上年度可比期间均未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及上年度可比期间均未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及上年度可比期间均未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。

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	本期	本期
	2022年1月1日至2022年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日	2022年1月1日至2022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）持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日	2021年1月1日至2021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）持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	199,980,002.00	9,255,132.76	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-

报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	199,980,002.00	9,255,132.76	-
报告期末持有的基金份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-

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。

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 B

关联方名称	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021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 (%)	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	47,166,761.51	84.75	47,166,761.51	84.08

注：本表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。

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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	101,313,166.03	608,081.63	86,611,415.51	438,833.20

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

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末进行利润分配。

7.4.12 期末（2022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	受限期	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
301152	天力锂电	2022年8月19日	6个月	新股流通受限	57.00	46.64	139	7,923.00	6,482.96	-
301227	森鹰窗业	2022年9月16日	6个月	新股流通受限	38.25	29.49	111	4,245.75	3,273.39	-
301269	华大九天	2022年7月21日	6个月	新股流通受限	32.69	87.94	555	18,142.95	48,806.70	-
301270	汉仪股份	2022年8月19日	6个月	新股流通受限	25.68	28.37	90	2,311.20	2,553.30	-
301277	新天地	2022年11月9日	6个月	新股流通受限	27.00	25.78	245	6,615.00	6,316.10	-
301283	聚胶股份	2022年8月26日	6个月	新股流通受限	52.69	51.41	133	7,007.77	6,837.53	-
301285	鸿日达	2022年9月21日	6个月	新股流通受限	14.60	12.60	237	3,460.20	2,986.20	-
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月	新股流通受限	43.23	42.29	119	5,144.37	5,032.51	-
301308	江波龙	2022年7月27日	6个月	新股流通受限	55.67	56.72	304	16,923.68	17,242.88	-
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	新股流通受限	39.00	24.46	130	5,070.00	3,179.80	-
301313	凡拓数创	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	25.25	29.14	117	2,954.25	3,409.38	-
301318	维海德	2022年8月3日	6个月	新股流通受限	64.68	41.74	109	7,050.12	4,549.66	-
301356	天振股份	2022年11月3日	6个月	新股流通受限	63.00	43.33	269	16,947.00	11,655.77	-
301365	矩阵股份	2022年11月14日	6个月	新股流通受限	34.72	23.87	239	8,298.08	5,704.93	-

注：此处受限期为证券原流通受限期，非剩余受限期。

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，无抵押债券。

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，无抵押债券。

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无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、经营层及其下设的合规与风险控制委员会、合规与法务部和风控与稽核部、各业务部门和职能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同责任，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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	2,175.68
未评级	-	-
合计	-	2,175.68

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。

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 2022 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	101,313,166.03	-	-	-	101,313,166.03
结算备付金	2,705,272.87	-	-	-	2,705,272.87
存出保证金	338,105.40	-	-	-	338,105.40
交易性金融资产	-	-	-	-289,876,412.08	289,876,412.08
买入返售金融资产	5,998,218.08	-	-	-	5,998,218.08
应收申购款	-	-	-	29,336.65	29,336.65
应收清算款	-	-	-	1,265,308.62	1,265,308.62
资产总计	110,354,762.38	-	-	-291,171,057.35	401,525,819.73

负债					
应付赎回款	-	-	-	203,678.05	203,678.05
应付管理人报酬	-	-	-	270,294.32	270,294.32
应付托管费	-	-	-	40,544.15	40,544.15
应付清算款	-	-	-	8,546,428.84	8,546,428.84
应付销售服务费	-	-	-	6,794.30	6,794.30
应交税费	-	-	-	500.25	500.25
其他负债	-	-	-	181,807.51	181,807.51
负债总计	-	-	-	9,250,047.42	9,250,047.42
利率敏感度缺口	110,354,762.38	-	-	-281,921,009.93	392,275,772.31
上年度末 2021 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	86,611,415.51	-	-	-	86,611,415.51
结算备付金	11,429,739.37	-	-	-	11,429,739.37
存出保证金	375,267.92	-	-	-	375,267.92
交易性金融资产	2,175.68	-	-	-393,146,477.61	393,148,653.29
应收证券清算款	-	-	-	-185,073,216.86	185,073,216.86
其他资产	-	-	-	-44,412.18	-44,412.18
资产总计	98,418,598.48	-	-	-578,175,282.29	676,593,880.77
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	461,913.59	461,913.59
应付托管费	-	-	-	69,287.04	69,287.04
应付证券清算款	-	-	-	7,682,815.28	7,682,815.28
应付销售服务费	-	-	-	12,206.38	12,206.38
应交税费	-	-	-	3,146,481.96	3,146,481.96
其他负债	-	-	-	175,976.39	175,976.39
负债总计	-	-	-	11,548,680.64	11,548,680.64
利率敏感度缺口	98,418,598.48	-	-	-566,626,601.65	665,045,200.13

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	-	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 12 月 31 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	-	-
--	---------------	---	---

注：于 2022 年 12 月 31 日，本集合计划持有的交易性债券投资公允价值占集合计划净资产的比例为 0.00%（2021 年 12 月 31 日：0.0003%），因此市场利率的变动对于本集合计划净资产无重大影响（2021 年 12 月 31 日：同）。

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 2022 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	-	10,439,449.97	-	10,439,449.97
资产合计	-	10,439,449.97	-	10,439,449.97
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	-	10,439,449.97	-	10,439,449.97
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				
交易性金融资产	-	61,570,528.91	-	61,570,528.91
资产合计	-	61,570,528.91	-	61,570,528.91
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	-	61,570,528.91	61,570,528.91

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（2022年12月31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%	521,972.50	3,078,526.45
	所有外币相对人民币 贬值 5%	-521,972.50	-3,078,526.45

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 2022年12月31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	289,876,412.08	73.90	393,146,477.61	59.12

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	289,876,412.08	73.90	393,146,477.61	59.12

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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	股票价格上升 5%	14,493,820.60	19,657,323.88
	股票价格下降 5%	-14,493,820.60	-19,657,323.88

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	289,748,380.97	392,230,566.85
第二层次	-	918,086.44
第三层次	128,031.11	-
合计	289,876,412.08	393,148,653.29

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	0.00	0.00
当期购买	-	257,641.73	257,641.73
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	244,541.90	244,541.90
转出第三层次	-	346,361.31	346,361.31
当期利得或损失总额	-	-27,791.21	-27,791.21
其中：计入损益的利得或损失	-	-27,791.21	-27,791.21
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	128,031.11	128,031.11
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	15,937.74	15,937.74
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	-	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益	-	-	-

的利得或损失			
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：1、于 2022 年 12 月 31 日，本集合计划持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2022 年度，本集合计划从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

2、计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期内股票投资	128,031.11	平均价格亚式期权模型	预期波动率	21.27%-97.55%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 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。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债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相差很小。

7.4.15 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。

§ 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	289,876,412.08	72.19

	其中：股票	289,876,412.08	72.19
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	5,998,218.08	1.49
	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	104,018,438.90	25.91
8	其他各项资产	1,632,750.67	0.41
9	合计	401,525,819.73	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 10,439,449.97 元，占资产净值比例为 2.66%。

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	4,732,793.00	1.21
B	采矿业	3,837,570.00	0.98
C	制造业	216,774,475.29	55.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,659,500.00	1.44
E	建筑业	2,351,733.00	0.60
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,686,315.00	0.43
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,451,597.38	2.41
J	金融业	2,618,513.00	0.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	31,286,727.44	7.98
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,037,738.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	279,436,962.11	71.23
--	----	----------------	-------

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（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	1,716,596.96	0.44
消费者常用品	936,861.58	0.24
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	7,785,991.43	1.98
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	10,439,449.97	2.66

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。

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	300416	苏试试验	544,600	16,419,690.00	4.19
2	605123	派克新材	86,400	11,482,560.00	2.93
3	601012	隆基绿能	262,500	11,093,250.00	2.83
4	002049	紫光国微	83,400	10,993,788.00	2.80
5	002475	立讯精密	292,700	9,293,225.00	2.37
6	300124	汇川技术	125,000	8,687,500.00	2.21
7	600460	士兰微	254,900	8,358,171.00	2.13
8	688599	天合光能	130,000	8,288,800.00	2.11
9	300661	圣邦股份	47,300	8,163,980.00	2.08
10	300012	华测检测	360,000	8,028,000.00	2.05
11	601689	拓普集团	136,300	7,984,454.00	2.04
12	300750	宁德时代	19,000	7,474,980.00	1.91
13	002747	埃斯顿	325,000	7,046,000.00	1.80
14	300775	三角防务	182,200	6,923,600.00	1.76
15	603259	药明康德	84,300	6,828,300.00	1.74
16	002353	杰瑞股份	235,000	6,558,850.00	1.67
17	300699	光威复材	90,000	6,502,500.00	1.66
18	002371	北方华创	28,700	6,466,110.00	1.65
19	300274	阳光电源	54,000	6,037,200.00	1.54
20	00700	腾讯控股	19,800	5,907,373.16	1.51
21	688777	中控技术	65,000	5,903,950.00	1.51

22	688106	金宏气体	301,963	5,664,825.88	1.44
23	600900	长江电力	269,500	5,659,500.00	1.44
24	688122	西部超导	54,093	5,122,066.17	1.31
25	002389	航天彩虹	246,900	5,078,733.00	1.29
26	605111	新洁能	65,000	5,042,700.00	1.29
27	603596	伯特利	60,000	4,788,000.00	1.22
28	300498	温氏股份	241,100	4,732,793.00	1.21
29	000733	振华科技	40,900	4,672,007.00	1.19
30	002430	杭氧股份	105,000	4,132,800.00	1.05
31	601677	明泰铝业	213,000	3,863,820.00	0.98
32	002129	TCL 中环	102,500	3,860,150.00	0.98
33	300763	锦浪科技	20,200	3,637,010.00	0.93
34	688333	铂力特	19,829	2,830,589.75	0.72
35	600988	赤峰黄金	151,400	2,732,770.00	0.70
36	601939	建设银行	465,100	2,618,513.00	0.67
37	300776	帝尔激光	20,000	2,520,000.00	0.64
38	002472	双环传动	96,000	2,443,200.00	0.62
39	300687	赛意信息	80,000	2,360,000.00	0.60
40	601668	中国建筑	433,100	2,351,733.00	0.60
41	300751	迈为股份	5,400	2,223,936.00	0.57
42	688305	科德数控	21,324	1,887,174.00	0.48
43	01024	快手-W	29,600	1,878,618.27	0.48
44	03690	美团-W	11,000	1,716,596.96	0.44
45	600754	锦江酒店	28,900	1,686,315.00	0.43
46	300146	汤臣倍健	73,600	1,679,552.00	0.43
47	600893	航发动力	36,000	1,522,080.00	0.39
48	300973	立高食品	15,300	1,471,554.00	0.38
49	002507	涪陵榨菜	56,800	1,463,736.00	0.37
50	600760	中航沈飞	24,700	1,448,161.00	0.37
51	603658	安图生物	22,200	1,373,070.00	0.35
52	605358	立昂微	29,464	1,255,166.40	0.32
53	300346	南大光电	40,000	1,162,000.00	0.30
54	301162	国能日新	12,900	1,132,878.00	0.29
55	601088	中国神华	40,000	1,104,800.00	0.28
56	603915	国茂股份	51,560	1,074,510.40	0.27
57	300015	爱尔眼科	33,400	1,037,738.00	0.26
58	600276	恒瑞医药	26,200	1,009,486.00	0.26
59	300034	钢研高纳	21,000	962,640.00	0.25
60	603501	韦尔股份	12,400	955,916.00	0.24
61	01579	颐海国际	38,000	936,861.58	0.24
62	002812	恩捷股份	7,000	919,030.00	0.23
63	300863	卡倍亿	10,400	868,608.00	0.22
64	300957	贝泰妮	5,500	820,820.00	0.21

65	688234	天岳先进	10,230	797,940.00	0.20
66	688559	海目星	12,000	694,080.00	0.18
67	600298	安琪酵母	14,500	655,690.00	0.17
68	688677	海泰新光	5,606	633,478.00	0.16
69	300316	晶盛机电	9,500	603,820.00	0.15
70	603363	傲农生物	46,100	594,229.00	0.15
71	600809	山西汾酒	2,000	569,980.00	0.15
72	002594	比亚迪	2,200	565,334.00	0.14
73	000596	古井贡酒	2,100	560,490.00	0.14
74	300760	迈瑞医疗	1,600	505,552.00	0.13
75	300724	捷佳伟创	4,400	501,688.00	0.13
76	002487	大金重工	11,500	475,755.00	0.12
77	000858	五粮液	2,500	451,725.00	0.12
78	002511	中顺洁柔	30,900	424,566.00	0.11
79	688012	中微公司	4,296	421,050.96	0.11
80	688516	奥特维	1,800	361,800.00	0.09
81	600129	太极集团	9,000	270,540.00	0.07
82	300217	东方电热	45,000	255,150.00	0.07
83	000066	中国长城	24,200	246,840.00	0.06
84	301269	华大九天	555	48,806.70	0.01
85	301308	江波龙	304	17,242.88	0.00
86	001301	尚太科技	236	13,933.44	0.00
87	301356	天振股份	269	11,655.77	0.00
88	301283	聚胶股份	133	6,837.53	0.00
89	301152	天力锂能	139	6,482.96	0.00
90	301277	新天地	245	6,316.10	0.00
91	301365	矩阵股份	239	5,704.93	0.00
92	301306	西测测试	119	5,032.51	0.00
93	301318	维海德	109	4,549.66	0.00
94	301313	凡拓数创	117	3,409.38	0.00
95	301227	森鹰窗业	111	3,273.39	0.00
96	301309	万得凯	130	3,179.80	0.00
97	301285	鸿日达	237	2,986.20	0.00
98	301270	汉仪股份	90	2,553.30	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	300274	阳光电源	50,292,954.08	7.56
2	300750	宁德时代	49,234,577.16	7.40
3	688599	天合光能	47,229,583.80	7.10
4	601012	隆基绿能	43,094,595.38	6.48

5	300763	锦浪科技	42,914,730.02	6.45
6	002371	北方华创	35,578,946.74	5.35
7	002475	立讯精密	33,788,673.40	5.08
8	603501	韦尔股份	32,935,582.14	4.95
9	300751	迈为股份	32,430,757.55	4.88
10	300699	光威复材	32,104,409.26	4.83
11	688680	海优新材	31,235,482.22	4.70
12	688408	中信博	30,982,916.87	4.66
13	000733	振华科技	30,567,535.46	4.60
14	300661	圣邦股份	29,543,038.95	4.44
15	002459	晶澳科技	29,164,229.40	4.39
16	000333	美的集团	28,546,441.50	4.29
17	002049	紫光国微	27,029,456.00	4.06
18	605123	派克新材	27,014,553.00	4.06
19	002384	东山精密	25,769,211.96	3.87
20	002271	东方雨虹	25,260,896.70	3.80
21	600519	贵州茅台	24,802,517.20	3.73
22	002812	恩捷股份	24,588,296.06	3.70
23	688598	金博股份	24,319,517.69	3.66
24	600460	士兰微	23,893,954.79	3.59
25	300015	爱尔眼科	23,744,919.54	3.57
26	300316	晶盛机电	23,229,091.00	3.49
27	300724	捷佳伟创	23,166,149.00	3.48
28	688012	中微公司	23,081,744.45	3.47
29	605111	新洁能	22,360,771.60	3.36
30	603596	伯特利	22,337,480.90	3.36
31	300308	中际旭创	21,688,909.40	3.26
32	300416	苏试试验	21,687,956.64	3.26
33	002129	TCL 中环	21,625,624.40	3.25
34	601318	中国平安	20,963,977.52	3.15
35	002487	大金重工	20,900,290.46	3.14
36	002906	华阳集团	20,656,477.29	3.11
37	002747	埃斯顿	20,428,295.00	3.07
38	601669	中国电建	19,881,199.40	2.99
39	603259	药明康德	19,335,451.20	2.91
40	605358	立昂微	19,131,619.12	2.88
41	002466	天齐锂业	19,086,853.01	2.87
42	300850	新强联	18,915,098.00	2.84
43	600760	中航沈飞	18,453,003.15	2.77
44	600011	华能国际	18,087,035.60	2.72
45	688006	杭可科技	18,065,966.93	2.72
46	601865	福莱特	18,014,933.26	2.71
47	300014	亿纬锂能	17,713,701.40	2.66

48	000768	中航西飞	17,693,335.91	2.66
49	601689	拓普集团	17,594,749.80	2.65
50	600690	海尔智家	17,406,503.46	2.62
51	603806	福斯特	17,293,157.00	2.60
52	002036	联创电子	16,644,611.03	2.50
53	601088	中国神华	16,461,691.00	2.48
54	600900	长江电力	16,285,239.00	2.45
55	601111	中国国航	16,284,024.23	2.45
56	688099	晶晨股份	16,235,864.54	2.44
57	002372	伟星新材	15,560,881.20	2.34
58	688187	时代电气	15,504,736.60	2.33
59	002415	海康威视	15,461,043.96	2.32
60	300124	汇川技术	15,415,960.96	2.32
61	300775	三角防务	15,210,035.00	2.29
62	600893	航发动力	14,914,911.00	2.24
63	300776	帝尔激光	14,458,052.00	2.17
64	000887	中鼎股份	14,165,923.74	2.13
65	300450	先导智能	14,043,193.00	2.11
66	002594	比亚迪	13,806,908.00	2.08
67	000786	北新建材	13,733,531.00	2.07
68	688122	西部超导	13,731,382.53	2.06
69	002430	杭氧股份	13,697,233.73	2.06
70	688390	固德威	13,376,472.16	2.01

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	000786	北新建材	57,152,973.67	8.59
2	601012	隆基绿能	45,865,870.50	6.90
3	603833	欧派家居	44,634,642.92	6.71
4	300274	阳光电源	43,455,856.00	6.53
5	688599	天合光能	37,733,555.93	5.67
6	300763	锦浪科技	37,210,216.60	5.60
7	300750	宁德时代	36,520,118.42	5.49
8	600486	扬农化工	34,566,453.60	5.20
9	300760	迈瑞医疗	33,777,206.76	5.08
10	688408	中信博	32,073,126.22	4.82
11	002384	东山精密	31,593,426.00	4.75
12	000333	美的集团	30,862,997.80	4.64
13	01810	小米集团-W	30,813,616.21	4.63
14	600519	贵州茅台	30,730,306.00	4.62
15	300015	爱尔眼科	30,655,271.30	4.61

16	300751	迈为股份	30,563,221.00	4.60
17	000858	五粮液	29,675,604.00	4.46
18	688680	海优新材	29,142,468.99	4.38
19	603501	韦尔股份	29,134,779.15	4.38
20	002459	晶澳科技	29,001,191.20	4.36
21	00700	腾讯控股	28,300,750.57	4.26
22	002371	北方华创	27,038,988.12	4.07
23	002475	立讯精密	26,833,986.68	4.03
24	600660	福耀玻璃	26,758,916.62	4.02
25	002271	东方雨虹	24,621,890.00	3.70
26	300699	光威复材	24,449,671.68	3.68
27	300724	捷佳伟创	24,379,869.00	3.67
28	000733	振华科技	24,363,866.16	3.66
29	300316	晶盛机电	23,085,869.00	3.47
30	688598	金博股份	21,777,610.69	3.27
31	300308	中际旭创	21,006,452.00	3.16
32	300661	圣邦股份	20,814,750.00	3.13
33	688012	中微公司	20,814,678.67	3.13
34	601669	中国电建	20,522,858.00	3.09
35	002487	大金重工	20,424,692.00	3.07
36	002812	恩捷股份	19,595,670.00	2.95
37	601318	中国平安	19,278,711.00	2.90
38	002906	华阳集团	19,132,152.58	2.88
39	601865	福莱特	17,815,917.45	2.68
40	000768	中航西飞	17,529,676.00	2.64
41	603806	福斯特	17,525,484.76	2.64
42	002466	天齐锂业	17,203,730.40	2.59
43	600011	华能国际	17,197,604.00	2.59
44	688006	杭可科技	17,124,619.50	2.57
45	300850	新强联	17,024,245.73	2.56
46	601111	中国国航	16,573,178.88	2.49
47	600760	中航沈飞	16,460,919.03	2.48
48	002747	埃斯顿	16,395,388.23	2.47
49	002129	TCL 中环	16,147,321.00	2.43
50	603596	伯特利	15,941,593.00	2.40
51	688099	晶晨股份	15,819,506.50	2.38
52	601689	拓普集团	15,751,168.78	2.37
53	600690	海尔智家	15,589,165.00	2.34
54	300450	先导智能	15,351,631.00	2.31
55	002372	伟星新材	15,347,694.70	2.31
56	300014	亿纬锂能	15,248,234.03	2.29
57	300896	爱美客	15,188,513.88	2.28
58	605123	派克新材	15,105,691.00	2.27

59	605111	新洁能	14,977,199.35	2.25
60	002508	老板电器	14,970,945.00	2.25
61	601088	中国神华	14,849,003.03	2.23
62	688187	时代电气	14,683,005.91	2.21
63	601966	玲珑轮胎	14,503,989.40	2.18
64	000887	中鼎股份	13,841,734.00	2.08
65	002050	三花智控	13,797,420.56	2.07
66	002049	紫光国微	13,784,171.40	2.07
67	002594	比亚迪	13,605,900.00	2.05
68	003022	联泓新科	13,363,712.10	2.01

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	3,250,028,425.39
卖出股票收入（成交）总额	3,179,718,146.05

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

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

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

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

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 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 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	338,105.40
2	应收清算款	1,265,308.62
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	29,336.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,632,750.67

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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		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	9,300	50,218.04	9,487,556.97	2.03	457,540,172.45	97.97
海通核心 优势 B	67	830,631.82	47,303,838.79	85.00	8,348,493.09	15.00
海通核心 优势 C	1,105	20,080.32	10,405.71	0.05	22,178,351.17	99.95
合计	10,472	52,031.02	56,801,801.47	10.42	488,067,016.71	89.58

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）。

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	3,801,730.99	0.7071
	海通核心优势 B	22,042.23	0.0396
	海通核心优势 C	41,282.09	0.1860
	合计	3,865,055.31	0.6177

注：本表报告期末持有份额总数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。

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	0~10
	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	10~50
	海通核心优势 B	0~10
	海通核心优势 C	0
	合计	10~50

§ 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	-	72,102,254.55	-

月 8 日) 基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	570,361,291.66	56,094,299.73	27,845,258.12
本报告期基金总申购份额	4,625,130.72	-	368,769.31
减: 本报告期基金总赎回份额	107,958,692.96	441,967.85	6,025,270.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	467,027,729.42	55,652,331.88	22,188,756.88

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)。

§ 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

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。

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. 2022 年 12 月 2 日, 上海海通证券资产管理有限公司发布公告, 经公司第四届第四十七次董事会审议通过, 邓航先生自 2022 年 12 月 1 日起不再担任公司副总经理。

4. 本报告期内, 徐铁任交通银行资产托管部总经理。

11.3 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。2022 年 11 月 10 日案件第一次开庭, 开庭结果正等待法院后续通知。

2. 本报告期内无涉及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。本年度应支付的审计费用是 12,000.00 元，目前事务所已提供审计服务的连续年限是 3 年。

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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	6,424,634,921.60	100.00	809,940.84	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	323,997.20	100.00	6,447,000,000.00	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 2023 年非港股通交易日暂停申购、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	2022 年 12 月 30 日
2	上海海通证券资产管理有限公司关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下部分集合资产管理计划代理销售机构的公告	证券时报及公司网站	2022 年 12 月 9 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	证券时报及公司网站	2022 年 12 月 2 日

4	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划 2022 年 8 月 25 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	2022 年 8 月 25 日
5	上海海通证券资产管理有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下部分集合资产管理计划代理销售机构的公告	证券时报及公司网站	2022 年 6 月 14 日
6	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	证券时报及公司网站	2022 年 3 月 30 日
7	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	证券时报及公司网站	2022 年 3 月 30 日
8	上海海通证券资产管理有限公司关于增加北京中植基金销售有限公司为旗下部分集合资产管理计划代理销售机构的公告	证券时报及公司网站	2022 年 3 月 24 日
9	上海海通证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证券时报及公司网站	2022 年 3 月 11 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

2023年3月31日