

海通品质升级一年持有期混合型集合资产 管理计划 2023 年中期报告

2023 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2023 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民生银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2023 年 8 月 25 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	42

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	42
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	42
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	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	43
§ 8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	44
§ 9 开放式基金份额变动	44
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8 其他重大事件	46
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海通品质升级一年持有期混合型集合资产管理计划	
基金简称	海通品质升级	
基金主代码	850013	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 1 月 10 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	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	31,610,784.48 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海通品质升级 A	海通品质升级 C
下属分级基金的交易代码	850013	851399
报告期末下属分级基金的份额总额	31,606,354.18 份	4,430.30 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、保证集合计划资产流动性的前提下，通过对优质企业的全面深入研究，重点投资于品质优秀且未来预期成长性良好的上市公司，分享其在中国经济增长和全球价值链提升的大背景下的可持续性增长，力争实现集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>管理人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内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：本集合计划将采用行业配置和个股精选相结合的方法进行股票投资。核心思路在于：（1）自上而下地分析国内外宏观经济走势、经济结构转型方向、国家经济与产业政策导向及经济周期调整等因素，挖掘未来受益于时代发展和品质升级的投资机会；（2）自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业发展的大趋势，对企业的基本面、成长性和竞争力进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。</p> <p>其他投资策略：债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、存托凭证投资策略、融资业务投资策略。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+中证全债指数收益率×30%
风险收益特征	本集合计划为混合型集合资产管理计划，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票

	型基金、股票型集合资产管理计划。 本集合计划可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--	---

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴文然	罗菲菲
	联系电话	021-23154762	010-58560666
	电子邮箱	htam@haitong.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		95553、4008888001	95568
传真		021-63410460	010-57093382
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 2 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 2 号
邮政编码		200001	100031
法定代表人		裴长江	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.htsamc.com
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 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	海通品质升级 A	海通品质升级 C
本期已实现收益	-2,590,670.03	-380.71
本期利润	-9,818,683.80	-1,709.52
加权平均基金份额本期利润	-0.3009	-0.4261
本期加权平均净值利润率	-10.35%	-14.83%

本期基金份额净值增长率	-10.57%	-10.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利润	51,019,996.62	7,086.14
期末可供分配基金份额利润	1.6142	1.5995
期末基金资产净值	82,626,350.80	11,516.44
期末基金份额净值	2.6142	2.5995
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-20.21%	-20.66%

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

海通品质升级 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	-3.01%	0.88%	1.08%	0.60%	-4.09%	0.28%
过去三个月	-10.18%	0.85%	-2.66%	0.56%	-7.52%	0.29%
过去六个月	-10.57%	0.95%	0.87%	0.56%	-11.44%	0.39%
过去一年	-19.45%	1.22%	-6.81%	0.67%	-12.64%	0.55%

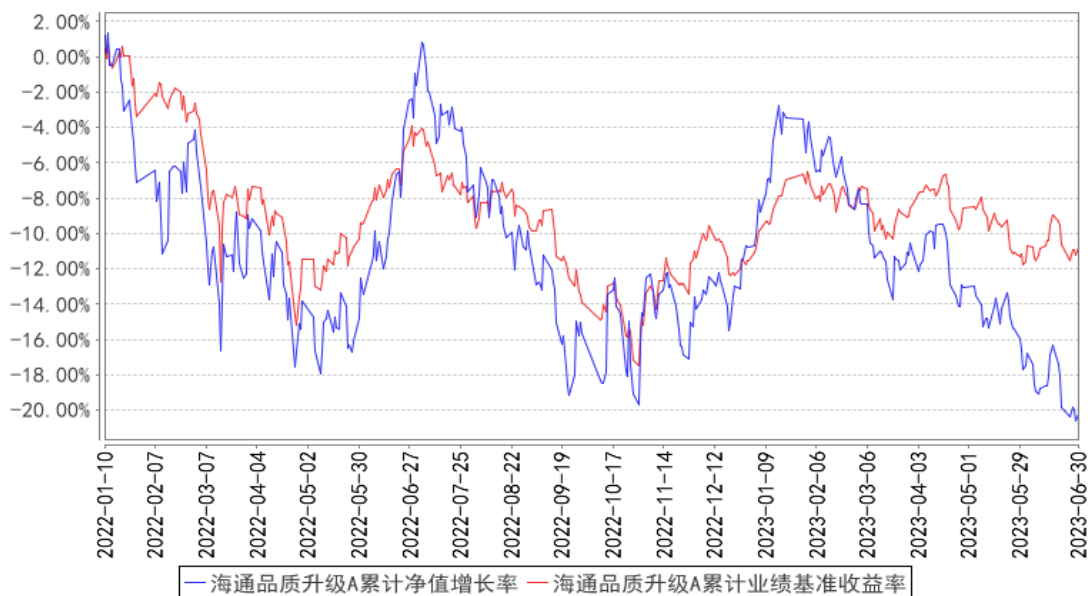
自基金合同生效起 至今	-20.21%	1.39%	-10.78%	0.81%	-9.43%	0.58%
----------------	---------	-------	---------	-------	--------	-------

海通品质升级 C

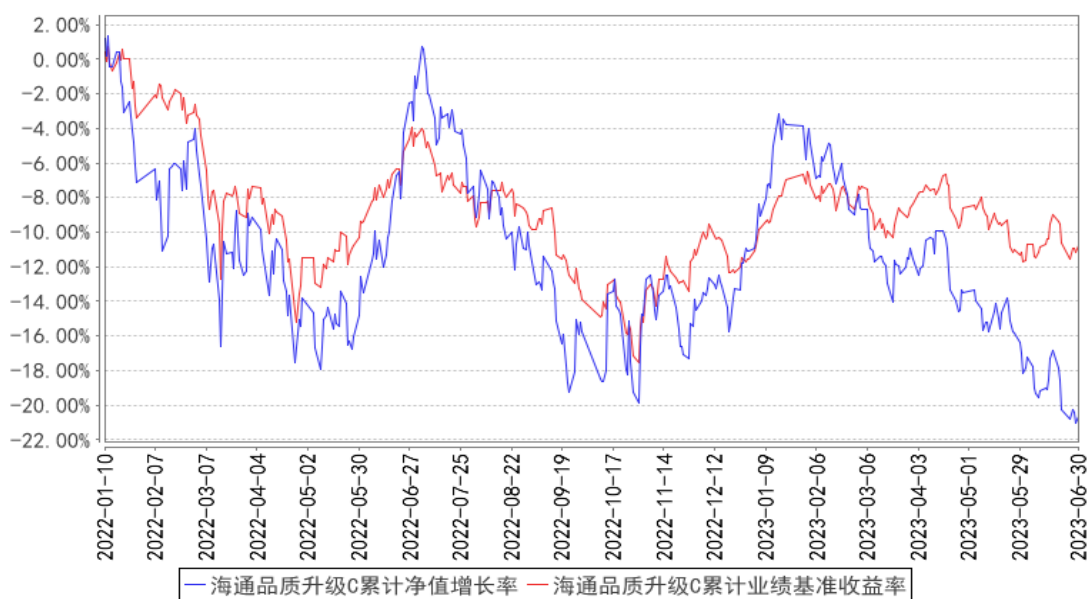
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-3.04%	0.88%	1.08%	0.60%	-4.12%	0.28%
过去三个月	-10.29%	0.85%	-2.66%	0.56%	-7.63%	0.29%
过去六个月	-10.79%	0.95%	0.87%	0.56%	-11.66%	0.39%
过去一年	-19.85%	1.22%	-6.81%	0.67%	-13.04%	0.55%
自基金合同生效起 至今	-20.66%	1.39%	-10.78%	0.81%	-9.88%	0.58%

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

海通品质升级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



海通品质升级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 2023 年 6 月 30 日，本集合计划管理人共管理 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		
钱玲玲	投资经理	2022 年 1 月 10 日	-	7 年	南京大学经济学硕士，2015 年加入上海海通证券资产管理有限公司，曾任管培生、权益投资二部投资经理助理、权益二部投资经理，现任公募权益部总监助理。

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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本集合计划进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本产品聚焦于医药和消费领域，沿着消费升级、健康升级和科技升级的线索不断挖掘具备长期成长性的公司。主要持仓行业为医药生物、食品饮料、美容护理、港股创新药等，上半年在强预期与弱现实的存量博弈中，整体表现不佳。2-3 月份的下跌是对消费复苏不及预期以及消费力下滑的担忧，5-6 月的调整主要是因为护肤品 618 数据疲弱、医美眼科月度环比减弱、CXO 新签订单下滑明显等弱现实进一步压制行业估值，医美护肤、消费医疗、CXO、港股创新药在短期贡献了较大幅度的跌幅。

对长期经济增长中枢的担忧、情绪面的退潮和增量资金偏少等因素持续制约 A 股表现。在上半年分化的市场风格中，本产品选择了坚守初心，并在泛消费板块中进行了细分机会的挖掘，包括避险和保值需求共同催化下的黄金珠宝，海外库存消化需求逐季改善的家电、出行数据持续超预期的酒店以及医药内部的创新药、中药等子行业的权重提升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本集合计划 A 份额净值为 2.6142 元，C 份额净值为 2.5995 元。本报告期集合计划上述两类份额净值增长率分别为-10.57%和-10.79%，业绩比较基准收益率为 0.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着近期政治局会议的召开以及一系列扩大内需的政策举措落地，对于经济复苏的预期开始逐渐转暖，市场情绪已从冰点升温，叠加绝大多数消费医药的估值已处于历史较低水位，我们对下半年的行情保持相对乐观。同时，我们也要认识到经济仍处于弱复苏的趋势中，中国已经进入高质量发展阶段，对于各类资产的预期收益率并不能有过高的期待。

具体来说，医药已处于相对底部区域，随着美联储加息进程进入尾声，对于医药行业的估值压制或将逐步解除，尽管受到医疗反腐升级等事件对投资情绪的影响，但政策鼓励创新的方向以及支持国产替代的方向没有发生变化，真正有好产品好疗效的公司终将获益。此外，医美、近视防控、隐形正畸等消费性医疗需求的渗透率仍低，还处于快速发展的阶段，这也是我们长期看好和坚持的方向。

消费虽然短期受到消费力疲弱的影响，但从旅游出行人数和餐饮数据看，中国陷入低欲望社会的概率并不高，中长期看消费升级的趋势仍在，消费板块仍大有可为。首先关注受益于经济持续复苏的顺周期领域，包括有品牌护城河有区位优势白酒、不断占领消费者心智品牌力不断提升的护肤品小家电，以及受益于旅游出行持续回暖的航空酒店；其次继续关注和挖掘未来成长空间较大的新兴消费板块，包括预制菜、宠物食品、体验消费等。

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，中国民生银行股份有限公司在本集合计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和集合计划合同、托管协议的约定，依法安全保管了集合计划财产，不存在损害集合计划份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了集合计划托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规规定和集合计划合同、托管协议的有关约定，本托管人对本集合计划的投资运作方面进行了监督，对集合计划资产净值计算、集合计划份额申购赎回价格的计算、集合计划费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现集合计划管理人有损害集合计划份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照集合计划合同的约定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、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：海通品质升级一年持有期混合型集合资产管理计划

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,980,924.69	7,077,573.72
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	70,660,154.83	80,990,594.57
其中：股票投资		70,553,316.34	80,990,594.57
基金投资		-	-
债券投资		106,838.49	-
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	5,997,893.99	9,996,829.75
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		109,284.24	-
应收股利		-	-
应收申购款		209.70	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		82,748,467.45	98,064,998.04
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债:			
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		0.98	1.71
应付赎回款		-	1,463.35
应付管理人报酬		55,733.39	64,766.42
应付托管费		10,450.02	12,143.70
应付销售服务费		4.80	3.32
应付投资顾问费		-	-
应交税费		275.98	709.56
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	44,135.04	129,000.00
负债合计		110,600.21	208,088.06
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	31,610,784.48	33,475,796.28
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	51,027,082.76	64,381,113.70
净资产合计		82,637,867.24	97,856,909.98
负债和净资产总计		82,748,467.45	98,064,998.04

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，本集合计划份额总额 31,610,784.48 份，其中海通品质升级 A 份额净值（暂估业绩报酬前）2.6142 元，份额总额 31,606,354.18 份，资产净值（暂估业绩报酬前）82,626,350.80 元，相关暂估业绩报酬余额为 0.22 元（于 2022 年 12 月 31 日 212.75 元），资产净值（暂估业绩报酬后）82,626,350.58 元。海通品质升级 C 份额净值（暂估业绩报酬前）2.5995 元，份额总额 4,430.30 份，资产净值（暂估业绩报酬前）11,516.44 元，相关暂估业绩报酬余额为 0.01 元（于 2022 年 12 月 31 日 0.00 元），资产净值（暂估业绩报酬后）11,516.43 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。

6.2 利润表

会计主体：海通品质升级一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 10 日（基金 合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-9,326,784.10	-1,118,691.58
1. 利息收入		94,940.46	96,718.35
其中：存款利息收入	6.4.7.13	13,729.45	20,993.29
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		81,211.01	75,725.06
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-2,192,381.98	-14,269,236.98
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-2,875,120.09	-14,810,112.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	247.43	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	682,490.68	540,875.52
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	-7,229,342.58	13,053,827.05
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	-	-
减：二、营业总支出		493,609.22	521,738.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	377,197.56	386,282.43
2. 托管费	6.4.10.2.2	70,724.50	72,427.88
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	28.34	5.67
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,194.31	212.80
8. 其他费用	6.4.7.23	44,464.51	62,809.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,820,393.32	-1,640,429.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,820,393.32	-1,640,429.91
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-9,820,393.32	-1,640,429.91

注：本财务报表的上期实际编制期间为 2022 年 1 月 10 日（集合计划合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海通品质升级一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	33,475,796.28	-	64,381,113.70	97,856,909.98
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）	33,475,796.28	-	64,381,113.70	97,856,909.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,865,011.80	-	-13,354,030.94	-15,219,042.74
（一）、综合收益总额	-	-	-9,820,393.32	-9,820,393.32
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以	-1,865,011.80	-	-3,533,637.62	-5,398,649.42

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	107,456.40	-	223,333.48	330,789.88
2. 基金赎回款	-1,972,468.20	-	-3,756,971.10	-5,729,439.30
(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)	31,610,784.48	-	51,027,082.76	82,637,867.24
项目	上年度可比期间			
	2022年1月10日(基金合同生效日)至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	35,390,176.54	-	80,554,342.73	115,944,519.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,545,790.68	-	-4,558,498.05	-6,104,288.73
(一)、综合收益总额	-	-	-1,640,429.91	-1,640,429.91
(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)	-1,545,790.68	-	-2,918,068.14	-4,463,858.82
其中：1. 基金申购款	84,127.49	-	162,309.24	246,436.73
2. 基金赎回款	-1,629,918.17	-	-3,080,377.38	-4,710,295.55
(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）	33,844,385.86	-	75,995,844.68	109,840,230.54

注：本财务报表的上期实际编制期间为 2022 年 1 月 10 日（集合计划合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日。

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

海通品质升级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”）变更自原大集合“海通海汇系列一星石 1 号集合资产管理计划”（以下简称“原集合计划”）。原集合计划为非限定性集合资产管理计划，自 2013 年 5 月 10 日向社会公众发行，于 2013 年 5 月 23 日结束募集并于 2013 年 5 月 29 日成立，于 2013 年 6 月 6 日取得中国证券业协会《关于上海海通证券资产管理有限公司发起设立海通海汇系列一星石 1 号集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函[2013]579 号）。本集合计划于 2021 年 12 月 15 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予海通海汇系列一星石 1 号集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2021]4005 号）批准，《海通品质升级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 2022 年 1 月 10 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，托管人为中国民生银行股份有限公司。

本集合计划根据申购/赎回规则、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：在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的份额。投资者依据原《海通海汇系列一星石 1 号集合资产管

理计划资产管理合同》获得的原集合计划份额，自资产管理合同生效之日起全部自动转换为本集合计划 A 类份额。原集合计划份额在资产管理合同生效后变更为 A 类份额的，其持有期限从登记机构确认投资人持有原集合计划份额之日起连续计算。

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的份额。

本集合计划 A 类份额和 C 类份额设置最短持有期限。A 类份额和 C 类份额持有人持有的每份份额最短持有期限为一年，在最短持有期限内该类集合计划份额不可赎回或转换转出。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海通品质升级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、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。

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。

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）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。

本集合计划的业绩比较基准为中证 800 指数收益率×60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+中证全债指数收益率×30%。

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〈年度报告和半年度报告〉》、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》、财政部《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》、《海通品质升级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 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本集合计划报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

本集合计划本报告期未发生会计政策变更。

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

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。

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	5,980,924.69
等于：本金	5,980,139.03
加：应计利息	785.66
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	5,980,924.69

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	91,618,364.57	-	70,553,316.34	-21,065,048.23	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	109,306.23	588.49	106,838.49	-3,056.23
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	109,306.23	588.49	106,838.49	-3,056.23
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	91,727,670.80	588.49	70,660,154.83	-21,068,104.46	

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

注：本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,997,893.99	-
银行间市场	-	-
合计	5,997,893.99	-

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 2023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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	44,135.04
合计	44,135.04

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

海通品质升级 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,473,082.78	33,473,082.78
本期申购	105,691.41	105,691.41
本期赎回（以“-”号填列）	-1,972,420.01	-1,972,420.01
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	31,606,354.18	31,606,354.18

海通品质升级 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,713.50	2,713.50
本期申购	1,764.99	1,764.99
本期赎回（以“-”号填列）	-48.19	-48.19
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	4,430.30	4,430.30

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

海通品质升级 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	103,789,382.01	-39,413,461.72	64,375,920.29
本期利润	-2,590,670.03	-7,228,013.77	-9,818,683.80
本期基金份额交易产生的变动数	-5,760,733.09	2,223,493.22	-3,537,239.87
其中：基金申购款	327,064.22	-107,425.75	219,638.47
基金赎回款	-6,087,797.31	2,330,918.97	-3,756,878.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	95,437,978.89	-44,417,982.27	51,019,996.62

海通品质升级 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,609.55	583.86	5,193.41
本期利润	-380.71	-1,328.81	-1,709.52
本期基金份额交易产生的变动数	2,907.85	694.40	3,602.25
其中：基金申购款	2,989.20	705.81	3,695.01
基金赎回款	-81.35	-11.41	-92.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,136.69	-50.55	7,086.14

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,729.45
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	-
其他	-
合计	13,729.45

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

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	19,243,863.16
减：卖出股票成本总额	22,088,800.13
减：交易费用	30,183.12
买卖股票差价收入	-2,875,120.09

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

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	251.82
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-4.39
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	247.43

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	4.39

买卖债券差价收入	-4.39
----------	-------

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未进行衍生工具投资。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	682,490.68
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	682,490.68

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-7,229,342.58
股票投资	-7,226,286.35
债券投资	-3,056.23
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	-
合计	-7,229,342.58

6.4.7.21 其他收入

注：本集合计划本报告期无其他收入。

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	4,463.46
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	60.00
证券组合费	269.47
合计	44,464.51

6.4.7.24 分部报告

本集合计划本报告期无分部报告。

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”	基金管理人、基金销售机构

资管”)	
中国民生银行股份有限公司(“民生银行”)	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

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。上年度可比期间为 2022 年 1 月 10 日（集合计划合同生效日）至 2022 年 06 月 30 日。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 10 日（基金合同生效日） 至 2022 年 6 月 30 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	38,129,180.00	100.00	63,188,868.10	100.00

6.4.10.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 10 日（基金合同生效日） 至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比 例（%）
海通证券	722,000,000.00	100.00	991,000,000.00	100.00

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	5,156.14	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 10 日（基金合同生效日）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	8,728.23	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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月10日（基金合同生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	377,197.56	386,282.43
其中：支付销售机构的客户维护费	187,402.92	27,600.65

注：1. 本集合计划本期共发生应支付的固定管理费 377,197.56 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为 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 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）

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	70,724.50	72,427.88

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提，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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海通品质升级 A	海通品质升级 C	合计
海通证券	-	8.34	8.34
合计	-	8.34	8.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海通品质升级 A	海通品质升级 C	合计
海通证券	-	5.52	5.52
海通资管	-	0.02	0.02
合计	-	5.54	5.54

注：本集合计划 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.5%。

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：本集合计划本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

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市场化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**

注：本报告期内未有管理人运用固有资金投资本集合计划的情况。

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：本报告期末除集合计划管理人之外的其他关联方未投资及持有本集合计划份额。

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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月10日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
民生银行	4,679.10	17.70	8,372,939.64	18,179.31
海通证券	5,976,245.59	13,711.75	-	-

6.4.10.7 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。

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（2023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。

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。

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。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	106,838.49	-
A-1 以下	-	-

未评级	-	-
合计	106,838.49	-

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，无债项评级则取主体评级。

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。

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

6.4.12 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。

6.4.13.4 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。

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 2023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	5,980,924.69	-	-	-	5,980,924.69
交易性金融资产	106,838.49	-	-	70,553,316.34	70,660,154.83
买入返售金融资产	5,997,893.99	-	-	-	5,997,893.99
应收申购款	-	-	-	209.70	209.70
应收清算款	-	-	-	109,284.24	109,284.24
资产总计	12,085,657.17	-	-	70,662,810.28	82,748,467.45
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	55,733.39	55,733.39
应付托管费	-	-	-	10,450.02	10,450.02
应付清算款	-	-	-	0.98	0.98
应付销售服务费	-	-	-	4.80	4.80
应交税费	-	-	-	275.98	275.98
其他负债	-	-	-	44,135.04	44,135.04
负债总计	-	-	-	110,600.21	110,600.21
利率敏感度缺口	12,085,657.17	-	-	70,552,210.07	82,637,867.24

上年度末 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	7,077,573.72	-	-	-	7,077,573.72
交易性金融资产	-	-	-	80,990,594.57	80,990,594.57
买入返售金融资产	9,996,829.75	-	-	-	9,996,829.75
资产总计	17,074,403.47	-	-	80,990,594.57	98,064,998.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,463.35	1,463.35
应付管理人报酬	-	-	-	64,766.42	64,766.42
应付托管费	-	-	-	12,143.70	12,143.70
应付清算款	-	-	-	1.71	1.71
应付销售服务费	-	-	-	3.32	3.32
应交税费	-	-	-	709.56	709.56
其他负债	-	-	-	129,000.00	129,000.00
负债总计	-	-	-	208,088.06	208,088.06
利率敏感度缺口	17,074,403.47	-	-	80,782,506.51	97,856,909.98

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	-		
分析	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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-2.41	-
	市场利率下降 25 个基点	2.43	-

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集合计划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
----	-----

	2023 年 6 月 30 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	-	4,958,408.44	-	4,958,408.44
资产合计	-	4,958,408.44	-	4,958,408.44
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	-	4,958,408.44	-	4,958,408.44
项目	上年度末 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	-	7,603,192.66	-	7,603,192.66
资产合计	-	7,603,192.66	-	7,603,192.66
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	-	7,603,192.66	-	7,603,192.66

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	-		
分析	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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	247,920.42	380,159.63
	所有外币相对人民币贬值 5%	-247,920.42	-380,159.63

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资产（含存托凭证）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、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。

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 2023年6月30日		上年度末 2022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	70,553,316.34	85.38	80,990,594.57	82.76
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	70,553,316.34	85.38	80,990,594.57	82.76

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-		
分析	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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	股票价格上升 5%	3,527,665.82	4,049,529.73
	股票价格下降 5%	-3,527,665.82	-4,049,529.73

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	70,660,154.83	80,990,594.57
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	70,660,154.83	80,990,594.57

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2023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

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。

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2023年6月30日，本集合计划无需要披露的其他重要事项。

§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	70,553,316.34	85.26
	其中：股票	70,553,316.34	85.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	106,838.49	0.13
	其中：债券	106,838.49	0.13
	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	5,997,893.99	7.25
	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	5,980,924.69	7.23
8	其他各项资产	109,493.94	0.13
9	合计	82,748,467.45	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 4,958,408.44 元，占资产净值比例为 6.00%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	183,500.00	0.22
B	采矿业	-	-
C	制造业	53,259,993.25	64.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,311,671.00	1.59
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
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	6,246,708.00	7.56
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	4,593,035.65	5.56

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	65,594,907.90	79.38

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	4,958,408.44	6.00
工业	-	-
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	4,958,408.44	6.00

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	300760	迈瑞医疗	16,500	4,946,700.00	5.99
2	600519	贵州茅台	2,831	4,787,221.00	5.79
3	300015	爱尔眼科	247,603	4,593,035.65	5.56
4	300896	爱美客	9,300	4,138,035.00	5.01
5	600276	恒瑞医药	81,900	3,923,010.00	4.75
6	603259	药明康德	56,400	3,514,284.00	4.25
7	688050	爱博医疗	14,600	2,997,818.00	3.63
8	603605	珀莱雅	22,960	2,580,704.00	3.12
9	600085	同仁堂	41,700	2,400,252.00	2.90
10	01801	信达生物	81,500	2,224,184.55	2.69
11	000858	五粮液	13,000	2,126,410.00	2.57
12	000333	美的集团	34,700	2,044,524.00	2.47
13	300347	泰格医药	30,000	1,936,200.00	2.34
14	000999	华润三九	29,500	1,789,470.00	2.17
15	600887	伊利股份	60,000	1,699,200.00	2.06
16	688235	百济神州	13,000	1,418,430.00	1.72
16	06160	百济神州	2,700	267,355.76	0.32
17	688617	惠泰医疗	4,500	1,681,875.00	2.04
18	300122	智飞生物	32,400	1,432,080.00	1.73

19	600557	康缘药业	48,900	1,342,794.00	1.62
20	688266	泽璟制药	28,612	1,331,888.60	1.61
21	002821	凯莱英	11,300	1,331,818.00	1.61
22	300171	东富龙	48,700	1,107,925.00	1.34
23	001215	千味央厨	15,700	1,043,893.00	1.26
24	01548	金斯瑞生物科技	62,000	1,006,064.58	1.22
25	600809	山西汾酒	5,100	943,857.00	1.14
26	603369	今世缘	17,600	929,280.00	1.12
27	603345	安井食品	6,100	895,480.00	1.08
28	300957	贝泰妮	9,800	871,024.00	1.05
29	300759	康龙化成	20,800	796,224.00	0.96
30	000963	华东医药	18,300	793,671.00	0.96
31	00853	微创医疗	60,000	783,314.21	0.95
32	688690	纳微科技	19,776	768,297.60	0.93
33	300181	佐力药业	59,400	725,274.00	0.88
34	688696	极米科技	4,920	685,798.80	0.83
35	600460	士兰微	20,000	605,400.00	0.73
36	600600	青岛啤酒	5,000	518,150.00	0.63
37	603939	益丰药房	14,000	518,000.00	0.63
38	603085	天成自控	36,200	359,828.00	0.44
39	002867	周大生	20,000	355,600.00	0.43
40	603997	继峰股份	23,300	333,190.00	0.40
41	02162	康诺亚-B	8,500	320,526.35	0.39
42	688302	海创药业	6,000	318,720.00	0.39
43	688331	荣昌生物	4,971	277,133.25	0.34
44	09926	康方生物-B	8,000	260,735.94	0.32
45	002409	雅克科技	3,000	218,640.00	0.26
46	301101	明月镜片	4,500	184,635.00	0.22
47	300498	温氏股份	10,000	183,500.00	0.22
48	001322	箭牌家居	8,700	145,638.00	0.18
49	02273	固生堂	2,100	96,227.05	0.12

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	688235	百济神州	1,710,340.70	1.75
2	600557	康缘药业	1,339,842.00	1.37
3	600085	同仁堂	1,186,958.00	1.21
4	603939	益丰药房	1,086,280.00	1.11
5	603369	今世缘	1,003,744.00	1.03
6	001215	千味央厨	1,003,626.00	1.03

7	603345	安井食品	970,915.00	0.99
8	300181	佐力药业	751,760.00	0.77
9	300759	康龙化成	705,300.00	0.72
10	688050	爱博医疗	654,500.00	0.67
11	000999	华润三九	420,240.00	0.43
12	603997	继峰股份	417,290.00	0.43
13	603085	天成自控	415,033.00	0.42
14	000333	美的集团	413,873.00	0.42
15	001322	箭牌家居	399,020.00	0.41
16	02162	康诺亚-B	395,056.13	0.40
17	002821	凯莱英	385,159.00	0.39
18	002993	奥海科技	380,477.00	0.39
19	300122	智飞生物	378,810.00	0.39
20	09966	康宁杰瑞制药 -B	376,728.06	0.38

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	601689	拓普集团	2,249,088.00	2.30
2	603517	绝味食品	1,613,940.00	1.65
3	300973	立高食品	1,385,026.00	1.42
4	600887	伊利股份	1,279,940.00	1.31
5	300122	智飞生物	1,141,300.00	1.17
6	00853	微创医疗	1,089,636.75	1.11
7	600809	山西汾酒	1,059,145.00	1.08
8	300413	芒果超媒	890,676.00	0.91
9	002821	凯莱英	878,994.66	0.90
10	02269	药明生物	718,947.88	0.73
11	000963	华东医药	616,635.00	0.63
12	01801	信达生物	565,833.56	0.58
13	300896	爱美客	545,581.00	0.56
14	002422	科伦药业	525,850.00	0.54
15	603939	益丰药房	456,280.00	0.47
16	603288	海天味业	424,769.00	0.43
17	300363	博腾股份	367,000.00	0.38
18	600600	青岛啤酒	300,000.00	0.31
19	000596	古井贡酒	294,000.00	0.30
20	688105	诺唯赞	288,904.00	0.30

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	18,877,808.25
卖出股票收入（成交）总额	19,243,863.16

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	106,838.49	0.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	106,838.49	0.13

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127015	希望转债	1,000	106,838.49	0.13

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

本集合计划本报告期末未投资股指期货。

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

根据本集合计划合同，本集合计划暂不投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末未投资国债期货。

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

本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，未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	-
2	应收清算款	109,284.24
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	209.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	109,493.94

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127015	希望转债	106,838.49	0.13

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不存在流通受限情况。

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 (%)
海通品质 升级 A	494	63,980.47	-	-	31,606,354.18	100.00
海通品质 升级 C	23	192.62	-	-	4,430.30	100.00
合计	517	61,142.72	-	-	31,610,784.48	100.00

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、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（%）
基金管理 人所有从 业人员持 有本基金	海通品质升级 A	204,730.28	0.6478
	海通品质升级 C	38.72	0.8740
	合计	204,769.00	0.6478

注：本表报告期末持有份额总数占总份额比例的计算中，A、C 级比例分母为各自级别的份额。

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	海通品质升级 A	0~10
	海通品质升级 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本 开放式基金	海通品质升级 A	10~50
	海通品质升级 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海通品质升级 A	海通品质升级 C
基金合同生效日 (2022 年 1 月 10 日) 基金份额总额	35,390,176.54	-
本报告期期初基金份 额总额	33,473,082.78	2,713.50
本报告期基金总申购 份额	105,691.41	1,764.99

减：本报告期基金总赎回份额	1,972,420.01	48.19
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	31,606,354.18	4,430.30

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、本报告期本集合计划管理人无重大人事变动。
- 2、本报告期内，集合计划托管人的专门集合计划托管部门未发生重大人事变动。

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等多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 日案件开庭，开庭结果正等待法院后续通知。
2. 报告期内未发生涉及集合计划托管业务的重大诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无重大投资策略的改变。

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

10.6.1 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。

10.6.2 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，托管人及其高级管理人员在开展集合计划托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

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	38,129,180.00	100.00	5,156.14	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	109,635.00	100.00	722,000,000.00	100.00	-	-

10.8 其他重大事件

§ 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。

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汇系列一星石 1 号集合资产管理计划资产管理合同变更的文件
- (二) 《海通品质升级一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》
- (三) 《海通品质升级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)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8月31日