

# 海通量化价值精选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：中国工商银行股份有限公司

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工商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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50

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 .....	50
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 .....	50
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 .....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
7.12 投资组合报告附注 .....	51
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
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 .....	52
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	54
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划		
基金简称	海通量化价值精选		
基金主代码	850004		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021 年 2 月 24 日		
基金管理人	上海海通证券资产管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	91,780,191.22 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	海通量化价值精选 A	海通量化价值精选 B	海通量化价值精选 C
下属分级基金的交易代码	850088	850004	850099
报告期末下属分级基金的份额总额	57,422,608.28 份	29,412,282.02 份	4,945,300.92 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现集合计划资产的增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>大类资产配置不作为本集合计划的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考虑系统性风险、各类资产收益风险比、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对集合计划资产配置做出适当调整。</p> <p>2、以超越业绩基准为目的的股票投资策略</p> <p>本集合计划基于长期量化研究构建投资模型，坚持数据驱动，挖掘市场中的潜在逻辑，通过优化量化投资模型来规避情绪带来的负面影响，力图获得超越业绩基准的投资回报。</p> <p>本集合计划基于实证检验，选取出符合 A 股投资逻辑的因子，并根据对经济周期和资本市场发展的不同阶段的分析和判断动态调整因子权重，从而构建多因子选股体系。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本集合计划债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时有效利用集合资产提高集合计划收益。通过研究国内外宏观经济、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期，采取自上而下的方式确定组合久期，进而根据期限结构配置、信用利差、信用风险评估、现金管理等手段进行个券选择。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本集合计划进行股指期货投资的主要目的是对股票组合进行套期保</p>

	<p>值，通过对国内外宏观经济运行趋势、财政以及货币政策、市场资金供需状况、股票市场估值水平、固定收益类资产收益水平等因素进行分析，结合对股票头寸的流动性、风险程度等因素的测评，以确定需要进行套期保值的股票组合和套期保值期限。根据公募基金相关法规和本合同的规定，管理人可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。</p> <p>若相关法律法规发生变化，管理人在进行股指期货投资管理时遵从最新规定。</p> <p>5、股票期权投资策略</p> <p>本集合计划投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好的期权合约进行投资。本集合计划将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与期权交易的投资时机和投资比例。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>本集合计划投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>7、融资业务投资策略</p> <p>本集合计划将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资业务。</p> <p>8、其他金融衍生产品的投资策略</p> <p>本集合计划将根据公募基金的特点和要求，结合该类金融衍生产品的特征，在进行充分风险控制和遵守法律法规的前提下，制定合适的投资策略，以控制并降低投资组合风险，提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本集合计划的投资目标。</p>
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×商业银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	<p>本集合计划为混合型集合资产管理计划，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划。</p> <p>本集合计划可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海海通证券资产管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴文然	郭明
	联系电话	021-23154762	010-66105799
	电子邮箱	htam@haitong.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95553、4008888001	95588
传真		021-63410460	010-66105798
注册地址		上海市广东路 689 号海通证券大厦 32 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市广东路 689 号海通证券大厦 32 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	200001	100140
法定代表人	裴长江	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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)		
	海通量化价值精选 A	海通量化价值精选 B	海通量化价值精选 C
本期已实现 收益	1,500,471.84	736,526.36	125,628.31
本期利润	2,317,638.10	1,055,750.45	272,914.89
加权平均基 金份额本期 利润	0.0387	0.0356	0.0502
本期加权平 均净值利润 率	3.73%	3.43%	4.90%
本期基金份 额净值增长 率	3.50%	3.55%	3.24%
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	1,368,164.92	761,681.51
期末可供分 配基金份额	0.0238	0.0259	0.0126

利润			
期末基金资产净值	58,790,773.20	30,173,963.53	5,007,706.25
期末基金份额净值	1.0238	1.0259	1.0126
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	-18.51%	-18.34%	-19.40%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海通量化价值精选 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.17%	0.71%	0.94%	0.70%	0.23%	0.01%
过去三个月	-1.84%	0.71%	-4.09%	0.66%	2.25%	0.05%
过去六个月	3.50%	0.73%	-0.50%	0.68%	4.00%	0.05%
过去一年	-6.46%	0.84%	-11.41%	0.79%	4.95%	0.05%
自基金合同生效起至今	-18.51%	1.02%	-23.68%	0.91%	5.17%	0.11%

海通量化价值精选 B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.17%	0.71%	0.94%	0.70%	0.23%	0.01%
过去三个月	-1.82%	0.71%	-4.09%	0.66%	2.27%	0.05%
过去六个月	3.55%	0.73%	-0.50%	0.68%	4.05%	0.05%

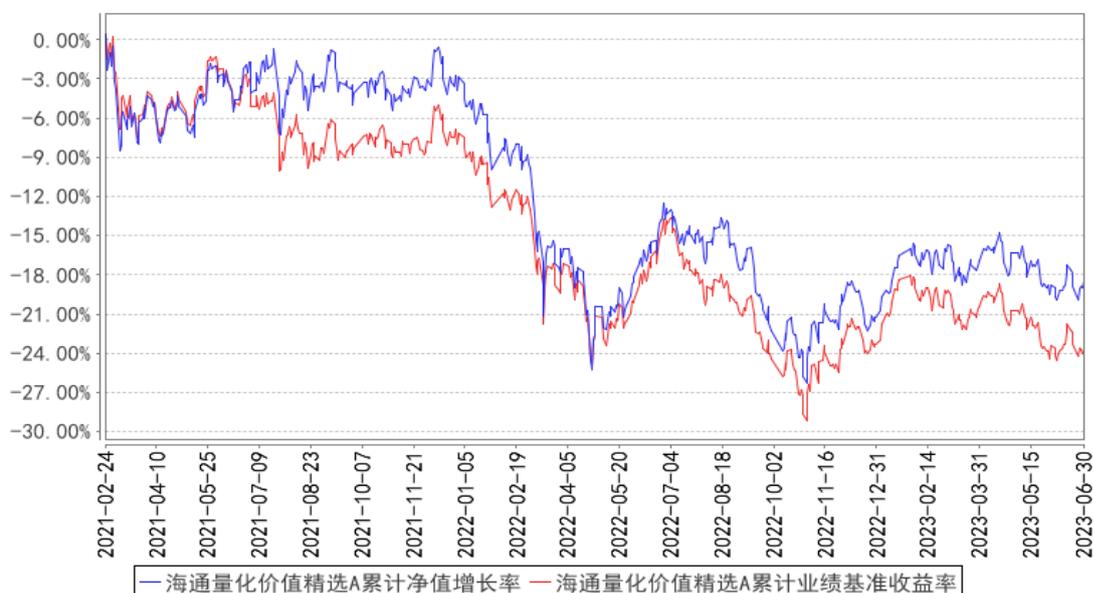
过去一年	-6.36%	0.84%	-11.41%	0.79%	5.05%	0.05%
自基金合同生效起至今	-18.34%	1.01%	-23.68%	0.91%	5.34%	0.10%

海通量化价值精选 C

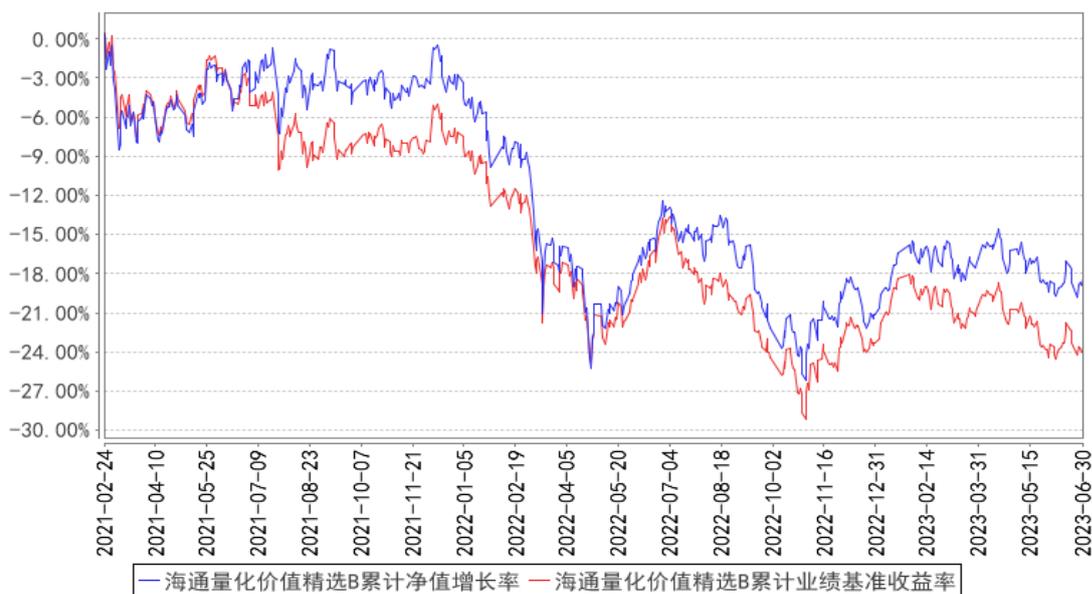
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.12%	0.71%	0.94%	0.70%	0.18%	0.01%
过去三个月	-1.97%	0.71%	-4.09%	0.66%	2.12%	0.05%
过去六个月	3.24%	0.73%	-0.50%	0.68%	3.74%	0.05%
过去一年	-6.93%	0.84%	-11.41%	0.79%	4.48%	0.05%
自基金合同生效起至今	-19.40%	1.01%	-23.68%	0.91%	4.28%	0.10%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

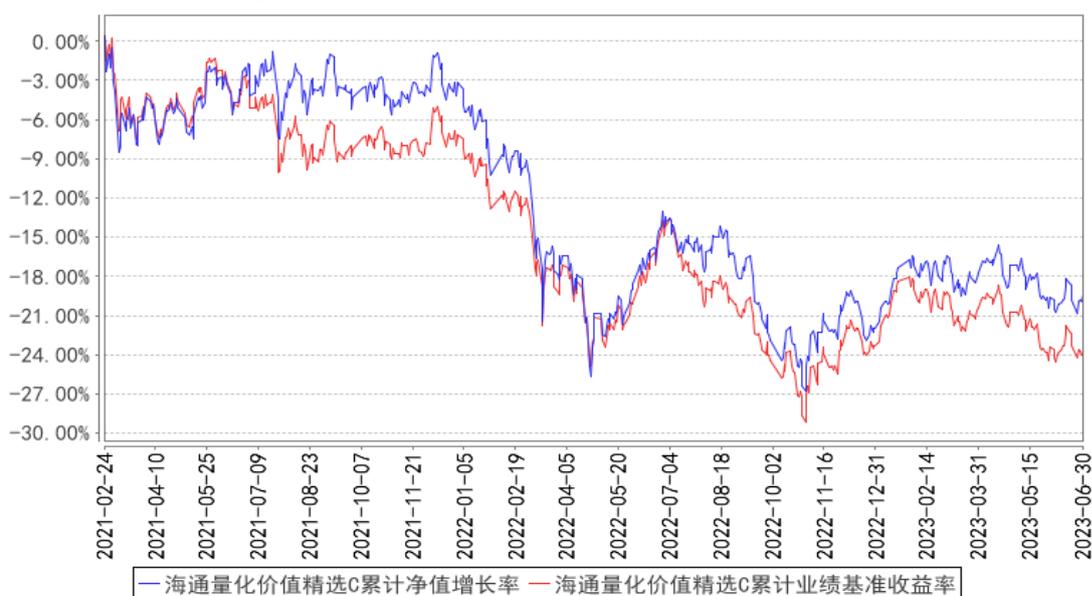
海通量化价值精选A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



海通量化价值精选B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



海通量化价值精选C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

等全业务产品线。

截至 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		
董传盛	投资经理	2023 年 2 月 3 日	-	6 年	董传盛先生：吉林大学微电子系学士，复旦大学微电子系硕士，加拿大麦吉尔大学电子计算机工程系博士，曾任上海海通证券资产管理有限公司研究员，现任上海海通证券资产管理有限公司投资经理。
胡倩	总经理助理，投资经理	2021 年 2 月 24 日	-	20 年	胡倩女士：上海财经大学经济学博士，现任上海海通证券资产管理有限公司总经理助理。曾任海通证券首席分析师，长信基金金融工程总监、基金经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本集合计划进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年一季度，宏观政策的强预期和目前经济状况的弱现实是市场博弈的主线。春节前对节后经济复苏的乐观预期，部分透支了春节后的市场涨幅，因此春节之后市场经历了一段时间的震荡行情。同时，美国硅谷银行破产、瑞信银行被收购等一系列事件，激发了投资者的衰退预期，避险成为投资者反复考虑的投资选项。在这种情况下，A 股也未能幸免。二季度，宏观政策的预

期和目前经济状况的现实仍然是市场博弈的主线。4 月份，市场窄幅震荡。以 AI 为代表的行情主导了市场情绪。临近月末，伴随着年报和一季报的披露，科技股在月末出现较大回撤，与此同时，以中特估为代表的优质资产估值持续修复。5 月份市场震荡下跌。对经济复苏信心的不足主导了市场情绪。与此同时，以中特估为代表的优质资产估值修复进程出现了调整。6 月份上证综指在短暂反弹后，迅速进入调整，全月振幅 4.1%，市场的关注点主要是复苏进度，但是宏观数据表现疲弱，累及权益市场。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本集合计划 A 份额净值为 1.0238 元，B 份额净值为 1.0259 元，C 份额净值为 1.0126 元。本报告期集合计划三类份额净值增长率分别为 3.50%, 3.55%, 3.24%，业绩比较基准收益率为-0.50%。

#### 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 年下半年，外部环境可能依然复杂，但国内经济仍有韧性。市场风格方面，在经历了一年多的调整后，高成长板块或许有更多投资机会，估值进一步压缩空间有限。权益资产投资价值已经显现，市场悲观情绪可能会逐渐消散，未来市场下跌空间或有限。

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

#### 4.6 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合规守信情况声明

本报告期内，本托管人在对海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在任何损害资产管理计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，本托管人依法对上海海通证券资产管理有限公司编制和披露的海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告中账务数据内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：海通量化价值精选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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	10,169,088.80	14,567,198.31
结算备付金		1,731,136.96	1,314,533.82
存出保证金		703,803.31	1,176,078.70
交易性金融资产	6.4.7.2	81,328,075.97	82,328,820.92
其中：股票投资		81,328,075.97	82,328,820.92
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-

债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		183,976.88	-
应收申购款		-	100.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		94,116,081.92	99,386,731.75
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1.76	0.82
应付赎回款		56.86	50,014.85
应付管理人报酬		59,334.74	66,875.15
应付托管费		11,590.45	13,015.87
应付销售服务费		2,053.03	2,964.67
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	70,602.10	129,665.52
负债合计		143,638.94	262,536.88
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	91,780,191.22	100,220,839.62
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,192,251.76	-1,096,644.75
净资产合计		93,972,442.98	99,124,194.87
负债和净资产总计		94,116,081.92	99,386,731.75

注：（1）报告截止日 2023 年 6 月 30 日，集合计划份额总额 91,780,191.22 份，其中海通量化价值精选 A 份额净值（暂估业绩报酬前）1.0238 元，份额总额 57,422,608.28 份，资产净值（暂估业绩报酬前）58,790,773.20 元，相关暂估业绩报酬余额为 51.87 元（于 2022 年 12 月 31 日 0.00 元），资产净值（暂估业绩报酬后）58,790,721.33 元；海通量化价值精选 B 份额净值（暂估业绩报酬前）1.0259 元，份额总额 29,412,282.02 份，资产净值（暂估业绩报酬前）30,173,963.53

元，相关暂估业绩报酬余额为 54,918.05 元（于 2022 年 12 月 31 日 33,544.34 元），资产净值（暂估业绩报酬后）30,119,045.48 元；海通量化价值精选 C 份额净值（暂估业绩报酬前）1.0126 元，份额总额 4,945,300.92 份，资产净值（暂估业绩报酬前）5,007,706.25 元，相关暂估业绩报酬余额为 8.83 元（于 2022 年 12 月 31 日 0.00 元），资产净值（暂估业绩报酬后）5,007,697.42 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：海通量化价值精选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 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		4,185,972.62	-14,216,586.50
1. 利息收入		31,706.56	35,261.36
其中：存款利息收入	6.4.7.13	31,706.56	35,261.36
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,870,589.13	-14,260,290.68
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,067,700.60	-14,979,556.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	635,593.20	-650,547.61
股利收益	6.4.7.19	1,167,295.33	1,369,813.69
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	1,283,676.93	8,442.82
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		539,669.18	650,030.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	375,867.97	472,261.27
2. 托管费	6.4.10.2.2	73,340.91	91,528.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	13,925.11	21,678.08
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		12,124.69	-
8. 其他费用	6.4.7.23	64,410.50	64,563.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		3,646,303.44	-14,866,617.09
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		3,646,303.44	-14,866,617.09
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		3,646,303.44	-14,866,617.09

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海通量化价值精选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）	100,220,839.62	-	-1,096,644.75	99,124,194.87
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)	100,220,839.62	-	-1,096,644.75	99,124,194.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-8,440,648.40	-	3,288,896.51	-5,151,751.89
(一)、综合收益总额	-	-	3,646,303.44	3,646,303.44
(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)	-8,440,648.40	-	-357,406.93	-8,798,055.33
其中：1. 基金申购款	35,120.17	-	1,398.42	36,518.59
2. 基金赎回款	-8,475,768.57	-	-358,805.35	-8,834,573.92
(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)	91,780,191.22	-	2,192,251.76	93,972,442.98
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	113,928,146.09	-	25,167,226.15	139,095,372.24
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)	113,928,146.09	-	25,167,226.15	139,095,372.24
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,713,635.64	-	-14,677,149.86	-17,390,785.50
(一)、综合收益总额	-	-	-14,866,617.09	-14,866,617.09

(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)	-2,713,635.64	-	189,467.23	-2,524,168.41
其中: 1. 基金申购款	1,539,422.16	-	216,480.22	1,755,902.38
2. 基金赎回款	-4,253,057.80	-	-27,012.99	-4,280,070.79
(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)	111,214,510.45	-	10,490,076.29	121,704,586.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

李井伟

陈颖

刘雯

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)变更自原大集合“海通稳健成长集合资产管理计划”(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,2009年5月31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(2009)447号核准设立,自2009年7月13日起向社会公众发行,2009年8月20日结束募集并于2009年8月24日成立。本集合计划于2021年1月22日经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予海通稳健成长集合资产管理计划合同变更的回函》(机构部函[2021]263号)批准,《海通量化价值精选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2021年2月24日起正式变更生效。本集合计划为契约型开放式,自合同变更生效日起存续期不得超过3年。本集合计划的管理人为上海海通证券资产管理有限公司,

托管人为中国工商银行股份有限公司。

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。

**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，在本集合计划存续期间，管理人仅办理 B 类份额的赎回业务，不办理申购业务，红利再投资份额除外。对 B 类份额不设置最短持有期限，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《海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、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、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、银行存款、同业存单、债券回购、股指期货、股票期权、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于股票的比例占集合计划资产的 60%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的 0%-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值

的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本集合计划将港股通标的股票投资的比例下限设为零，本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股通标的股票或选择不将集合计划资产投资于港股通标的股票，集合计划资产并非必然投资港股通标的股票。

本集合计划的业绩比较基准为  $80\% \times$  沪深 300 指数收益率  $+20\% \times$  商业银行活期存款利率（税后）。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、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》、《海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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	10,169,088.80
等于：本金	10,168,117.14
加：应计利息	971.66
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	10,169,088.80

## 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	83,916,536.31	-	81,328,075.97	-2,588,460.34
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	83,916,536.31	-	81,328,075.97	-2,588,460.34

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
----	-------------------

	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	6,077,240.00	-	-	-
其中：股指期货投资	6,077,240.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,077,240.00	-	-	-

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2307	IC2307	1.00	1,198,160.00	-5,960.00
IF2309	IF2309	4.00	4,606,800.00	-266,320.00
合计				-272,280.00
减：可抵销期货暂收款				-272,280.00
净额				-

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

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本集合计划本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本集合计划本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

## 6.4.7.8 其他资产

注：本集合计划本报告期末其他资产无余额。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	6,631.27
其中：交易所市场	6,631.27
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	63,970.83
合计	70,602.10

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 海通量化价值精选 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	63,463,803.40	63,463,803.40
本期申购	26,298.50	26,298.50
本期赎回（以“-”号填列）	-6,067,493.62	-6,067,493.62
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	57,422,608.28	57,422,608.28

## 海通量化价值精选 B

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	29,798,278.41	29,798,278.41
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-385,996.39	-385,996.39
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	29,412,282.02	29,412,282.02

## 海通量化价值精选 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	6,958,757.81	6,958,757.81
本期申购	8,821.67	8,821.67
本期赎回（以“-”号填列）	-2,022,278.56	-2,022,278.56
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	4,945,300.92	4,945,300.92

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

## 6.4.7.11 其他综合收益

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 海通量化价值精选 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,644,449.37	-3,330,355.72	-685,906.35
本期利润	1,500,471.84	817,166.26	2,317,638.10
本期基金份额交易产生的变动数	-358,333.90	94,767.07	-263,566.83
其中：基金申购款	1,574.45	-445.46	1,128.99
基金赎回款	-359,908.35	95,212.53	-264,695.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,786,587.31	-2,418,422.39	1,368,164.92

## 海通量化价值精选 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,613,551.37	-3,890,716.80	-277,165.43
本期利润	736,526.36	319,224.09	1,055,750.45
本期基金份额交易产生的变动数	-52,990.31	36,086.80	-16,903.51
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-52,990.31	36,086.80	-16,903.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,297,087.42	-3,535,405.91	761,681.51

## 海通量化价值精选 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	231,536.51	-365,109.48	-133,572.97
本期利润	125,628.31	147,286.58	272,914.89
本期基金份额交易产生的变动数	-86,318.49	9,381.90	-76,936.59
其中：基金申购款	411.52	-142.09	269.43
基金赎回款	-86,730.01	9,523.99	-77,206.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	270,846.33	-208,441.00	62,405.33

## 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	23,186.98
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	8,443.02
其他	76.56
合计	31,706.56

注：其他包括结算保证金利息收入、港股通风控资金利息收入。

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

## 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	175,697,232.39
减：卖出股票成本总额	174,368,196.03
减：交易费用	261,335.76
买卖股票差价收入	1,067,700.60

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本集合计划本报告期无债券投资收益。

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

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

注：本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本集合计划本报告期末产生衍生工具买卖权证差价收入。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	635,593.20

## 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	1,167,295.33
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	1,167,295.33
----	--------------

#### 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	1,769,876.93
股票投资	1,769,876.93
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-486,200.00
权证投资	-
期货投资	-486,200.00
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	1,283,676.93

#### 6.4.7.21 其他收入

注：本集合计划本报告期末无其他收入。

#### 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	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	207.00
证券组合费	232.67
合计	64,410.50

#### 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（“海通资管”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

##### 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1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
海通证券	347,379,004.09	100.00	394,619,287.15	100.00

###### 6.4.10.1.2 权证交易

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1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期权证 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	-	-	7,998.43	100.00

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	45,189.04	100.00	6,631.27	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
海通证券	51,270.00	100.00	25,960.04	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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	375,867.97	472,261.27
其中：支付销售机构的客户维护费	64,212.45	75,461.47

注：1. 本集合计划本期共发生应支付的固定管理费 375,867.97 元（其中 A 类份额 246,603.73 元，B 类份额 106,984.01 元，C 类份额 22,280.23 元）。本集合计划 A 类份额和 C 类份额的固定管理费按 A 类份额和 C 类份额前一日集合计划资产净值的 0.8% 年费率计提，B 类份额的固定管理费按 B 类份额前一日集合计划资产净值的 0.7% 年费率计提。固定管理费的计算方法如下：

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

H 为各类份额每日应计提的集合计划管理费

E 为各类份额前一日的集合计划资产净值

集合计划固定管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

2. 本集合计划本期共发生应支付的业绩报酬 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 5% 以上部分按照 10% 的比例收取管理人业绩报酬；对 A 类或 C 类计划份额期间年化收益率超过 8% 以上部分按照 20% 的比例收取业绩报酬。

A 类或 C 类份额业绩报酬的计算公式为：

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

B 类份额业绩报酬的计算公式为：

当年化收益率  $R \geq 5\%$  = 每笔参与份额在上一个业绩报酬计提日的资产净值总额 \* (年化收益率

$R-5.0\%)*10\%$ \*投资者上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的年限（1 年按 365 天计算）

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

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

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	73,340.91	91,528.21

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

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

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 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			
	海通量化价值精选 A	海通量化价值精选 B	海通量化价值精选 C	合计
工商银行	-	-	2,905.60	2,905.60
海通证券	-	-	10,938.17	10,938.17
海通资管	-	-	1.81	1.81
合计	-	-	13,845.58	13,845.58
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 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			

	海通量化价值精选 A	海通量化价值精选 B	海通量化价值精选 C	合计
工商银行	-	-	3,467.43	3,467.43
海通证券	-	-	18,099.69	18,099.69
海通资管	-	-	3.47	3.47
合计	-	-	21,570.59	21,570.59

注：本集合计划 A 类份额、B 类份额不收取销售服务费，C 类份额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。

#### 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。

##### 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及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	海通量化价值精选 A	海通量化价值精选 B	海通量化价值精选 C
基金合同生效日 (2021 年 2 月 24 日) 持有的基金份额	-	-	-

报告期初持有的基金份额	-	15,279,736.72	-
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	-	15,279,736.72	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	51.95%	-
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年6月30日
	海通量化价值精选 A	海通量化价值精选 B	海通量化价值精选 C
基金合同生效日 (2021年2月24日) 持有的基金份额	-	15,279,736.72	-
报告期初持有的基金份额	-	15,279,736.72	-
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	-	15,279,736.72	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	51.27%	-

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

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

份额单位：份

##### 海通量化价值精选 B

关联方名称	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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	10,000,000.00	34.00	10,000,000.00	33.56

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。

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30 日		上年度可比期间 2022年1月1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
工商银行	10,169,088.80	23,186.98	13,291,861.73	23,951.81

#### 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无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

注：本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指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	10,169,088.80	-	-	-	10,169,088.80
结算备付金	1,731,136.96	-	-	-	1,731,136.96
存出保证金	703,803.31	-	-	-	703,803.31
交易性金融资产	-	-	-	81,328,075.97	81,328,075.97
应收股利	-	-	-	183,976.88	183,976.88
应收清算款	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	12,604,029.07	-	-	81,512,052.85	94,116,081.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	56.86	56.86
应付管理人报酬	-	-	-	59,334.74	59,334.74
应付托管费	-	-	-	11,590.45	11,590.45
应付清算款	-	-	-	1.76	1.76
应付销售服务费	-	-	-	2,053.03	2,053.03
其他负债	-	-	-	70,602.10	70,602.10
负债总计	-	-	-	143,638.94	143,638.94
利率敏感度缺口	12,604,029.07	-	-	81,368,413.91	93,972,442.98
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	14,567,198.31	-	-	-	14,567,198.31
结算备付金	1,314,533.82	-	-	-	1,314,533.82
存出保证金	1,176,078.70	-	-	-	1,176,078.70
交易性金融资产	-	-	-	82,328,820.92	82,328,820.92
应收申购款	-	-	-	100.00	100.00
资产总计	17,057,810.83	-	-	82,328,920.92	99,386,731.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	50,014.85	50,014.85
应付管理人报酬	-	-	-	66,875.15	66,875.15
应付托管费	-	-	-	13,015.87	13,015.87
应付清算款	-	-	-	0.82	0.82
应付销售服务费	-	-	-	2,964.67	2,964.67
其他负债	-	-	-	129,665.52	129,665.52

负债总计	-	-	-	262,536.88	262,536.88
利率敏感度缺口	17,057,810.83	-	-	82,066,384.04	99,124,194.87

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

注：于 2023 年 6 月 30 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%（2022 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本集合计划净资产无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 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	-	8,032,109.96	-	8,032,109.96
资产合计	-	8,032,109.96	-	8,032,109.96
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	-	8,032,109.96	-	8,032,109.96
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	-	3,770,981.29	-	3,770,981.29

资产合计	-	3,770,981.29	-	3,770,981.29
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	-	3,770,981.29	-	3,770,981.29

#### 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%	401,605.50	188,549.06
	所有外币相对人民币贬值5%	-401,605.50	-188,549.06

#### 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的比例占集合计划资产的60%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的0%-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本集合计划将港股通标的股票投资的比例下限设为零，本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股通标的股票或选择不将集合计划资产投资于港股通标的股票，集合计划资产并非必然投资港股通标的股票。本集合计划通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本集合计划的管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	81,328,075.97	86.54	82,328,820.92	83.06
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	81,328,075.97	86.54	82,328,820.92	83.06

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

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-		
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%	4,066,403.80	4,116,441.05
	股票价格下降 5%	-4,066,403.80	-4,116,441.05

#### 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	81,328,075.97	82,328,820.92
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	81,328,075.97	82,328,820.92

#### 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	81,328,075.97	86.41
	其中：股票	81,328,075.97	86.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,900,225.76	12.64
8	其他各项资产	887,780.19	0.94

9	合计	94,116,081.92	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 8,032,109.96 元，占资产净值比例为 8.55%。

## 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	832.65	0.00
B	采矿业	1,619,229.96	1.72
C	制造业	48,463,428.36	51.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,782,278.00	2.96
E	建筑业	1,238,302.04	1.32
F	批发和零售业	533,022.00	0.57
G	交通运输、仓储和邮政业	1,222,021.00	1.30
H	住宿和餐饮业	502,128.00	0.53
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,759,340.89	5.06
J	金融业	10,829,124.47	11.52
K	房地产业	483,424.95	0.51
L	租赁和商务服务业	5,858.09	0.01
M	科学研究和技术服务业	3,738.60	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	686,381.00	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	77,910.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	88,946.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	73,295,966.01	78.00

### 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	1,127,862.74	1.20
消费者常用品	-	-
能源	1,322,672.51	1.41
金融	2,281,421.06	2.43
医疗保健	160,313.88	0.17
工业	1,501,711.80	1.60
信息技术	752,335.68	0.80
电信服务	885,792.29	0.94

公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	8,032,109.96	8.55

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	600519	贵州茅台	2,000	3,382,000.00	3.60
2	300750	宁德时代	9,745	2,229,558.55	2.37
3	601766	中国中车	164,500	1,069,250.00	1.14
3	01766	中国中车	151,000	597,249.42	0.64
4	601318	中国平安	32,400	1,503,360.00	1.60
5	00941	中国移动	15,000	885,792.29	0.94
5	600941	中国移动	3,800	354,540.00	0.38
6	000333	美的集团	20,000	1,178,400.00	1.25
7	600036	招商银行	35,900	1,176,084.00	1.25
8	600028	中国石化	118,300	752,388.00	0.80
8	00386	中国石油化工股份	100,000	423,188.82	0.45
9	00857	中国石油股份	180,000	899,483.69	0.96
9	601857	中国石油	21,200	158,364.00	0.17
10	02628	中国人寿	65,000	782,668.82	0.83
10	601628	中国人寿	7,500	262,200.00	0.28
11	002415	海康威视	30,400	1,006,544.00	1.07
12	600150	中国船舶	30,000	987,300.00	1.05
13	600887	伊利股份	33,200	940,224.00	1.00
14	000858	五粮液	5,652	924,497.64	0.98
15	002371	北方华创	2,700	857,655.00	0.91
16	600085	同仁堂	14,900	857,644.00	0.91
17	02238	广汽集团	188,000	809,461.56	0.86
18	600276	恒瑞医药	16,449	787,907.10	0.84
19	01339	中国人民保险集团	264,000	691,263.72	0.74
19	601319	中国人保	11,100	64,824.00	0.07
20	00981	中芯国际	40,000	752,335.68	0.80
21	000725	京东方A	182,700	747,243.00	0.80
22	03898	时代电气	27,000	726,889.03	0.77
23	600362	江西铜业	37,200	706,056.00	0.75
24	600900	长江电力	30,700	677,242.00	0.72
25	600918	中泰证券	97,300	672,343.00	0.72
26	002594	比亚迪	2,600	671,502.00	0.71

27	601211	国泰君安	47,700	667,323.00	0.71
28	600104	上汽集团	46,932	665,026.44	0.71
29	06806	申万宏源	475,200	657,187.34	0.70
30	600019	宝钢股份	116,900	656,978.00	0.70
31	300059	东方财富	46,154	655,386.80	0.70
32	688041	海光信息	9,300	634,911.00	0.68
33	002202	金风科技	59,300	629,766.00	0.67
34	600309	万华化学	7,100	623,664.00	0.66
35	600406	国电南瑞	26,597	614,390.70	0.65
36	600884	杉杉股份	39,000	590,460.00	0.63
37	601012	隆基绿能	20,476	587,046.92	0.62
38	000999	华润三九	9,600	582,336.00	0.62
39	002736	国信证券	66,311	578,895.03	0.62
40	002414	高德红外	72,930	566,666.10	0.60
41	600764	中国海防	20,600	560,732.00	0.60
42	601166	兴业银行	35,700	558,705.00	0.59
43	300433	蓝思科技	44,500	523,320.00	0.56
44	600018	上港集团	97,300	510,825.00	0.54
45	000538	云南白药	9,600	503,808.00	0.54
46	002410	广联达	15,240	495,147.60	0.53
47	002007	华兰生物	21,700	486,297.00	0.52
48	600048	保利发展	37,100	483,413.00	0.51
49	600886	国投电力	37,400	473,110.00	0.50
50	600875	东方电气	25,300	471,845.00	0.50
51	688047	龙芯中科	4,100	470,639.00	0.50
52	000800	一汽解放	56,200	470,394.00	0.50
53	000768	中航西飞	17,300	462,775.00	0.49
54	601390	中国中铁	59,500	451,010.00	0.48
55	603806	福斯特	12,080	449,255.20	0.48
56	601009	南京银行	55,400	443,200.00	0.47
57	600690	海尔智家	18,500	434,380.00	0.46
58	300450	先导智能	12,000	434,040.00	0.46
59	601865	福莱特	11,200	431,312.00	0.46
60	002459	晶澳科技	10,140	422,838.00	0.45
61	601100	恒立液压	6,500	418,145.00	0.44
62	688396	华润微	7,966	417,498.06	0.44
63	000723	美锦能源	54,000	407,160.00	0.43
64	300763	锦浪科技	3,877	403,595.70	0.43
65	002179	中航光电	8,820	399,987.00	0.43
66	601668	中国建筑	69,200	397,208.00	0.42
67	300316	晶盛机电	5,600	397,040.00	0.42
68	002389	航天彩虹	17,600	390,896.00	0.42
69	601186	中国铁建	39,600	390,060.00	0.42

70	600893	航发动力	9,200	388,792.00	0.41
71	603617	君禾股份	35,900	376,232.00	0.40
72	603899	晨光股份	8,400	374,976.00	0.40
73	601288	农业银行	104,000	367,120.00	0.39
74	601328	交通银行	62,400	361,920.00	0.39
75	601988	中国银行	92,100	360,111.00	0.38
76	300760	迈瑞医疗	1,200	359,760.00	0.38
77	601878	浙商证券	36,000	355,680.00	0.38
78	601169	北京银行	76,700	355,121.00	0.38
79	688599	天合光能	8,300	353,663.00	0.38
80	601985	中国核电	49,700	350,385.00	0.37
81	601236	红塔证券	46,520	346,574.00	0.37
82	003816	中国广核	111,000	345,210.00	0.37
83	600831	广电网络	57,400	344,400.00	0.37
84	601229	上海银行	59,500	342,125.00	0.36
85	688777	中控技术	5,438	341,397.64	0.36
86	601816	京沪高铁	63,800	335,588.00	0.36
87	601077	渝农商行	93,400	335,306.00	0.36
88	02333	长城汽车	38,500	318,401.18	0.34
89	000601	韶能股份	69,300	318,087.00	0.34
90	601877	正泰电器	11,300	312,445.00	0.33
91	002922	伊戈尔	21,600	309,960.00	0.33
92	002616	长青集团	59,800	306,176.00	0.33
93	600438	通威股份	8,900	305,359.00	0.32
94	600288	大恒科技	25,000	301,750.00	0.32
95	688561	奇安信	5,800	300,498.00	0.32
96	002322	理工能科	28,400	295,360.00	0.31
97	603903	中持股份	33,000	295,020.00	0.31
98	605151	西上海	16,200	294,840.00	0.31
99	001208	华菱线缆	31,000	293,880.00	0.31
100	688299	长阳科技	18,736	293,593.12	0.31
101	002064	华峰化学	42,600	292,236.00	0.31
102	603279	景津装备	9,300	291,648.00	0.31
103	601006	大秦铁路	39,100	290,513.00	0.31
104	688296	和达科技	16,179	288,795.15	0.31
105	603900	莱绅通灵	45,900	288,252.00	0.31
106	002025	航天电器	4,500	287,100.00	0.31
107	600741	华域汽车	15,400	284,284.00	0.30
108	603290	斯达半导	1,300	279,760.00	0.30
109	601899	紫金矿业	24,600	279,702.00	0.30
110	600845	宝信软件	5,480	278,438.80	0.30
111	601901	方正证券	42,100	275,334.00	0.29
112	601007	金陵饭店	32,100	273,492.00	0.29

113	002180	纳思达	7,900	270,575.00	0.29
114	600600	青岛啤酒	2,600	269,438.00	0.29
115	002056	横店东磁	14,700	267,687.00	0.28
116	300896	爱美客	600	266,970.00	0.28
117	605077	华康股份	9,900	262,152.00	0.28
118	600570	恒生电子	5,900	261,311.00	0.28
119	605499	东鹏饮料	1,500	259,350.00	0.28
120	603367	辰欣药业	17,000	258,060.00	0.27
121	600183	生益科技	17,900	254,180.00	0.27
122	002311	海大集团	5,349	250,547.16	0.27
123	603587	地素时尚	17,100	250,344.00	0.27
124	000596	古井贡酒	1,000	247,380.00	0.26
125	603883	老百姓	8,200	244,770.00	0.26
126	000157	中联重科	35,800	241,650.00	0.26
127	603369	今世缘	4,500	237,600.00	0.25
128	002304	洋河股份	1,800	236,430.00	0.25
129	600050	中国联通	48,300	231,840.00	0.25
130	605117	德业股份	1,540	230,307.00	0.25
131	600754	锦江酒店	5,400	228,636.00	0.24
132	300601	康泰生物	9,000	228,510.00	0.24
133	600809	山西汾酒	1,220	225,785.40	0.24
134	000895	双汇发展	9,200	225,308.00	0.24
135	600219	南山铝业	73,600	222,272.00	0.24
136	688303	大全能源	5,383	217,742.35	0.23
137	600926	杭州银行	18,100	212,675.00	0.23
138	000100	TCL 科技	53,140	209,371.60	0.22
139	300207	欣旺达	12,800	208,896.00	0.22
140	601728	中国电信	36,800	207,184.00	0.22
141	603348	文灿股份	4,700	205,907.00	0.22
142	600760	中航沈飞	4,480	201,600.00	0.21
143	002839	张家港行	46,600	197,118.00	0.21
144	002142	宁波银行	7,400	187,220.00	0.20
145	600681	百川能源	39,100	182,597.00	0.19
146	000786	北新建材	7,400	181,374.00	0.19
147	01800	中国交通建设	45,000	177,573.35	0.19
148	603331	百达精工	12,000	177,360.00	0.19
149	603689	皖天然气	20,000	175,400.00	0.19
150	002032	苏泊尔	3,500	175,000.00	0.19
151	600674	川投能源	11,500	173,075.00	0.18
152	603383	顶点软件	3,100	171,802.00	0.18
153	600031	三一重工	10,300	171,289.00	0.18
154	300769	德方纳米	1,540	169,754.20	0.18
155	601808	中海油服	12,100	167,948.00	0.18

156	002008	大族激光	6,300	165,060.00	0.18
157	000977	浪潮信息	3,400	164,900.00	0.18
158	603833	欧派家居	1,700	162,860.00	0.17
159	601838	成都银行	13,300	162,393.00	0.17
160	600745	闻泰科技	3,300	161,370.00	0.17
161	002555	三七互娱	4,600	160,448.00	0.17
162	01951	锦欣生殖	42,000	160,313.88	0.17
163	002746	仙坛股份	20,200	159,176.00	0.17
164	002493	荣盛石化	13,600	158,304.00	0.17
165	603993	洛阳钼业	29,700	158,301.00	0.17
166	601600	中国铝业	28,800	158,112.00	0.17
167	603659	璞泰来	4,100	156,702.00	0.17
168	002001	新和成	10,168	156,587.20	0.17
169	600584	长电科技	5,000	155,850.00	0.17
170	002252	上海莱士	20,400	153,204.00	0.16
171	000877	天山股份	18,800	153,032.00	0.16
172	002938	鹏鼎控股	6,300	153,027.00	0.16
173	002241	歌尔股份	8,600	152,650.00	0.16
174	688363	华熙生物	1,700	151,572.00	0.16
175	300957	贝泰妮	1,700	151,096.00	0.16
176	03958	东方证券	38,000	150,301.18	0.16
177	000063	中兴通讯	3,300	150,282.00	0.16
178	688012	中微公司	900	140,805.00	0.15
179	300408	三环集团	4,700	137,945.00	0.15
180	601360	三六零	10,700	134,178.00	0.14
181	002129	TCL 中环	3,875	128,650.00	0.14
182	002131	利欧股份	55,300	127,190.00	0.14
183	601825	沪农商行	22,000	119,900.00	0.13
184	300014	亿纬锂能	1,900	114,950.00	0.12
185	600436	片仔癀	400	114,544.00	0.12
186	600089	特变电工	4,920	109,666.80	0.12
187	000338	潍柴动力	8,800	109,648.00	0.12
188	000651	格力电器	3,000	109,530.00	0.12
189	000708	中信特钢	6,700	106,128.00	0.11
190	000568	泸州老窖	500	104,785.00	0.11
191	601377	兴业证券	17,000	104,040.00	0.11
192	601088	中国神华	3,300	101,475.00	0.11
193	603187	海容冷链	4,700	93,953.00	0.10
194	600999	招商证券	6,916	93,850.12	0.10
195	603657	春光科技	5,200	91,260.00	0.10
196	603709	中源家居	5,000	90,700.00	0.10
197	603639	海利尔	5,000	89,600.00	0.10
198	300413	芒果超媒	2,600	88,946.00	0.09

199	002937	兴瑞科技	3,600	88,560.00	0.09
200	603022	新通联	9,300	87,513.00	0.09
201	300332	天壕环境	7,600	87,172.00	0.09
202	002929	润建股份	2,000	86,820.00	0.09
203	002475	立讯精密	2,660	86,317.00	0.09
204	600323	瀚蓝环境	4,500	85,185.00	0.09
205	000828	东莞控股	9,300	85,095.00	0.09
206	002275	桂林三金	4,700	84,647.00	0.09
207	688630	芯碁微装	1,000	84,020.00	0.09
208	688021	奥福环保	3,200	82,944.00	0.09
209	603288	海天味业	1,760	82,456.00	0.09
210	603868	飞科电器	1,300	82,017.00	0.09
211	300751	迈为股份	480	81,302.40	0.09
212	300015	爱尔眼科	4,200	77,910.00	0.08
213	600585	海螺水泥	3,200	75,968.00	0.08
214	688065	凯赛生物	1,200	74,712.00	0.08
215	601658	邮储银行	14,300	69,927.00	0.07
216	603501	韦尔股份	700	68,628.00	0.07
217	600989	宝丰能源	5,400	68,094.00	0.07
218	300782	卓胜微	700	67,641.00	0.07
219	601615	明阳智能	4,000	67,520.00	0.07
220	600346	恒力石化	4,700	67,351.00	0.07
221	300919	中伟股份	1,100	66,275.00	0.07
222	600588	用友网络	3,200	65,600.00	0.07
223	600332	白云山	2,000	63,760.00	0.07
224	002916	深南电路	88	6,632.56	0.01
225	601888	中国中免	53	5,858.09	0.01
226	603259	药明康德	60	3,738.60	0.00
227	603392	万泰生物	30	2,003.10	0.00
228	002756	永兴材料	30	1,878.30	0.00
229	002049	紫光国微	20	1,865.00	0.00
230	603339	四方科技	96	1,527.36	0.00
231	600161	天坛生物	30	814.50	0.00
232	000938	紫光股份	22	700.70	0.00
233	601898	中煤能源	69	582.36	0.00
234	300498	温氏股份	27	495.45	0.00
235	600547	山东黄金	20	469.60	0.00
236	600015	华夏银行	72	389.52	0.00
237	002714	牧原股份	8	337.20	0.00
238	603585	苏利股份	20	297.60	0.00
239	603228	景旺电子	10	256.50	0.00
240	000703	恒逸石化	10	67.80	0.00
241	600820	隧道股份	4	24.04	0.00

242	600848	上海临港	1	11.95	0.00
-----	--------	------	---	-------	------

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601319	中国人保	1,445,318.00	1.46
1	01339	中国人民保险集团	762,559.30	0.77
2	02628	中国人寿	1,124,961.28	1.13
2	601628	中国人寿	992,250.00	1.00
3	600519	贵州茅台	1,453,264.00	1.47
4	601766	中国中车	802,431.00	0.81
4	01766	中国中车	627,116.52	0.63
5	600918	中泰证券	1,380,019.00	1.39
6	00981	中芯国际	1,326,470.42	1.34
7	002415	海康威视	1,309,983.00	1.32
8	600028	中国石化	894,353.00	0.90
8	00386	中国石油化工股份	409,278.80	0.41
9	600741	华域汽车	1,190,100.00	1.20
10	600887	伊利股份	1,176,100.00	1.19
11	600019	宝钢股份	1,146,806.00	1.16
12	300207	欣旺达	1,021,565.00	1.03
13	601236	红塔证券	1,006,361.60	1.02
14	603899	晨光股份	988,810.00	1.00
15	600085	同仁堂	978,995.00	0.99
16	02238	广汽集团	794,013.45	0.80
16	601238	广汽集团	170,166.00	0.17
17	002410	广联达	964,138.00	0.97
18	002180	纳思达	959,329.00	0.97
19	300751	迈为股份	944,048.00	0.95
20	601229	上海银行	935,378.00	0.94

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	601319	中国人保	1,855,578.00	1.87
1	01339	中国人民保险集团	196,749.66	0.20
2	601939	建设银行	1,667,265.00	1.68

3	600519	贵州茅台	1,646,410.00	1.66
4	601766	中国中车	1,398,899.00	1.41
5	600999	招商证券	1,239,338.46	1.25
6	600918	中泰证券	1,188,307.00	1.20
7	000708	中信特钢	1,186,155.00	1.20
8	601360	三六零	1,130,605.00	1.14
9	600036	招商银行	1,128,360.00	1.14
10	000895	双汇发展	1,121,772.00	1.13
11	002304	洋河股份	1,092,521.00	1.10
12	600741	华域汽车	1,087,610.00	1.10
13	601138	工业富联	1,077,532.00	1.09
14	601390	中国中铁	1,072,585.00	1.08
15	300760	迈瑞医疗	1,043,817.00	1.05
16	600660	福耀玻璃	1,026,685.00	1.04
17	600000	浦发银行	1,013,493.00	1.02
18	603259	药明康德	1,013,408.00	1.02
19	600015	华夏银行	1,011,171.00	1.02
20	601857	中国石油	1,002,488.00	1.01

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。

#### 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	171,597,574.15
卖出股票收入（成交）总额	175,697,232.39

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

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

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本集合计划本报告期末未持有贵金属。

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

注：本集合计划本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

监测股指期货基差，适时使用股指期货代替现货持仓。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无

## 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，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到厦门证监局及中国银行间市场交易商协会处罚。本集合计划对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及产品合同的要求。

### 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	703,803.31
2	应收清算款	-
3	应收股利	183,976.88
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	887,780.19

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本集合计划本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本集合计划本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
海通量化价值精选 A	980	58,594.50	-	-	57,422,608.28	100.00
海通量化价值精选 B	70	420,175.46	25,279,736.72	85.95	4,132,545.30	14.05
海通量化价值精选 C	176	28,098.30	82,966.90	1.68	4,862,334.02	98.32
合计	1,226	74,861.49	25,362,703.62	27.63	66,417,487.60	72.37

注：本表机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、B、C 级比例分母为各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用集合计划份额的合计数（即期末集合计划份额总额）。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	海通量化价值精选 A	353,842.68	0.6162
	海通量化价值精选 B	256,677.53	0.8727
	海通量化价值精选 C	881.21	0.0178
	合计	611,401.42	0.6662

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。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海通量化价值精选 A	10~50
	海通量化价值精选 B	10~50
	海通量化价值精选 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	海通量化价值精选 A	0~10
	海通量化价值精选 B	0
	海通量化价值精选 C	0
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海通量化价值精选 A	海通量化价值精选 B	海通量化价值精选 C
基金合同生效日（2021 年 2 月 24 日）基金份额总额	-	77,523,307.45	-
本报告期期初基金份额总额	63,463,803.40	29,798,278.41	6,958,757.81
本报告期基金总申购份额	26,298.50	-	8,821.67
减：本报告期基金总赎回份额	6,067,493.62	385,996.39	2,022,278.56
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	57,422,608.28	29,412,282.02	4,945,300.92

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、本报告期集合计划托管人的专门集合计划托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

1. 因金融委托理财合同纠纷，四川信托有限公司向四川省成都市中级人民法院起诉，要求上海海通证券资产管理有限公司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

无

### 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无受稽查或处罚等情况。

## 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	347,379,004.09	100.00	45,189.04	100.00	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划产品资料概要（更新）	规定披露媒介	2023年2月8日
2	海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划更新招募说明书（2023年第1号）	规定披露媒介	2023年2月8日
3	海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划基金经理变更公告	规定披露媒介	2023年2月3日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本集合计划本报告期内无单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况。

## 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稳健成长集合资产管理计划合同变更的文件
- (二) 海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同
- (三) 海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议
- (四) 海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书
- (五) 法律意见书
- (六) 管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 托管人业务资格批件、营业执照
- (八) 业务规则
- (九) 中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本集合计划管理人：上海海通证券资产管理有限公司  
客户服务中心电话：95553

上海海通证券资产管理有限公司  
2023 年 8 月 31 日