

海通量化价值精选一年持有期混合型集合 资产管理计划 2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 29 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 2025 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 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	10
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	11
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
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	48
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	48

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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 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	54,114,654.12 份		
基金合同存续期	2021 年 2 月 24 日至 2025 年 12 月 31 日		
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	37,743,748.98 份	12,760,491.65 份	3,610,413.49 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	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。 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。策略组合构建方法包括：（1）筛选有效因子；（2）动态优化因子权重；（3）生成股票组合并优化股票权重；（4）港股投资策略。 主要投资策略有：资产配置策略、以超越业绩基准为目的的股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略、融资业务投资策略、其他金融衍生产品的投资策略。
业绩比较基准	$80\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 20\% \times \text{商业银行活期存款利率（税后）}$
风险收益特征	本集合计划为混合型集合资产管理计划，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划。 本集合计划可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

注：详见《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》第九部分“集合计划的投资”。

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	王棐庭
	联系电话	021-23154762	021-68089632
	电子邮箱	htam@haitong.com	wangfeiting@sh.icbc.com.cn
客户服务电话		95521	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		陶耿	廖林

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(2025 年 1 月 1 日-2025 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	1,598,027.98	536,989.04	141,125.09
本期利润	1,174,064.87	529,325.08	101,043.63
加权平均基金份额本期利润	0.0302	0.0330	0.0263
本期加权平	2.75%	3.00%	2.45%

均 净 值 利 润 率			
本 期 基 金 份 额 净 值 增 长 率	2. 82%	2. 87%	2. 56%
3. 1. 2 期 末 数 据 和 指 标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)		
期末可供分 配利润	2, 689, 778. 55	1, 719, 238. 85	178, 545. 84
期末可供分 配基金份额 利润	0. 0713	0. 1347	0. 0495
期末基金资 产净值	42, 657, 282. 83	14, 479, 730. 50	3, 995, 422. 06
期末基金份 额净值	1. 1302	1. 1347	1. 1066
3. 1. 3 累 计期末指 标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)		
基金份额累 计净值增长 率	-10. 04%	-9. 68%	-11. 92%

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	3. 37%	0. 59%	2. 00%	0. 47%	1. 37%	0. 12%

过去三个月	2.47%	1.28%	1.08%	0.88%	1.39%	0.40%
过去六个月	2.82%	1.13%	0.16%	0.81%	2.66%	0.32%
过去一年	15.35%	1.32%	11.31%	1.11%	4.04%	0.21%
过去三年	3.26%	1.01%	-9.09%	0.88%	12.35%	0.13%
自基金合同生效起 至今	-10.04%	1.05%	-21.68%	0.92%	11.64%	0.13%

海通量化价值精选 B

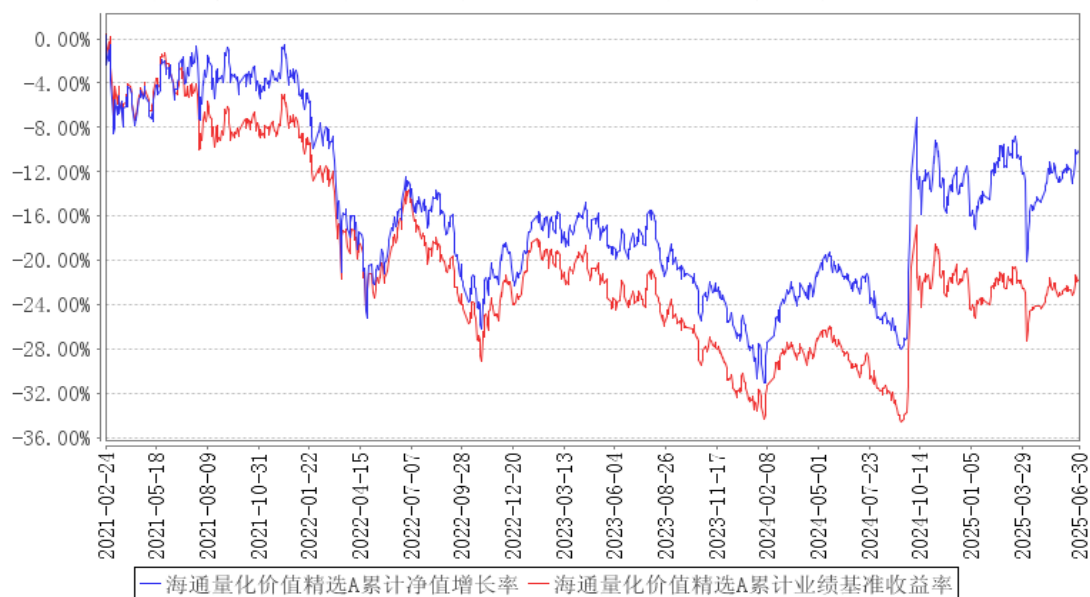
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.37%	0.60%	2.00%	0.47%	1.37%	0.13%
过去三个月	2.49%	1.28%	1.08%	0.88%	1.41%	0.40%
过去六个月	2.87%	1.13%	0.16%	0.81%	2.71%	0.32%
过去一年	15.46%	1.32%	11.31%	1.11%	4.15%	0.21%
过去三年	3.57%	1.01%	-9.09%	0.88%	12.66%	0.13%
自基金合同生效起 至今	-9.68%	1.05%	-21.68%	0.92%	12.00%	0.13%

海通量化价值精选 C

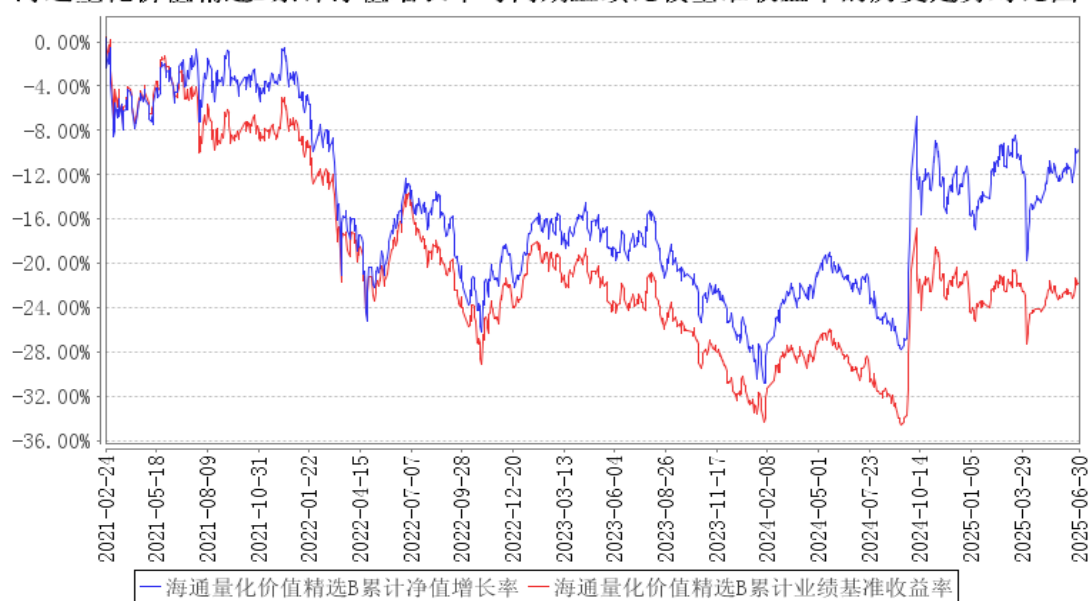
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.31%	0.59%	2.00%	0.47%	1.31%	0.12%
过去三个月	2.34%	1.28%	1.08%	0.88%	1.26%	0.40%
过去六个月	2.56%	1.13%	0.16%	0.81%	2.40%	0.32%
过去一年	14.76%	1.32%	11.31%	1.11%	3.45%	0.21%
过去三年	1.71%	1.01%	-9.09%	0.88%	10.80%	0.13%
自基金合同生效起 至今	-11.92%	1.05%	-21.68%	0.92%	9.76%	0.13%

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

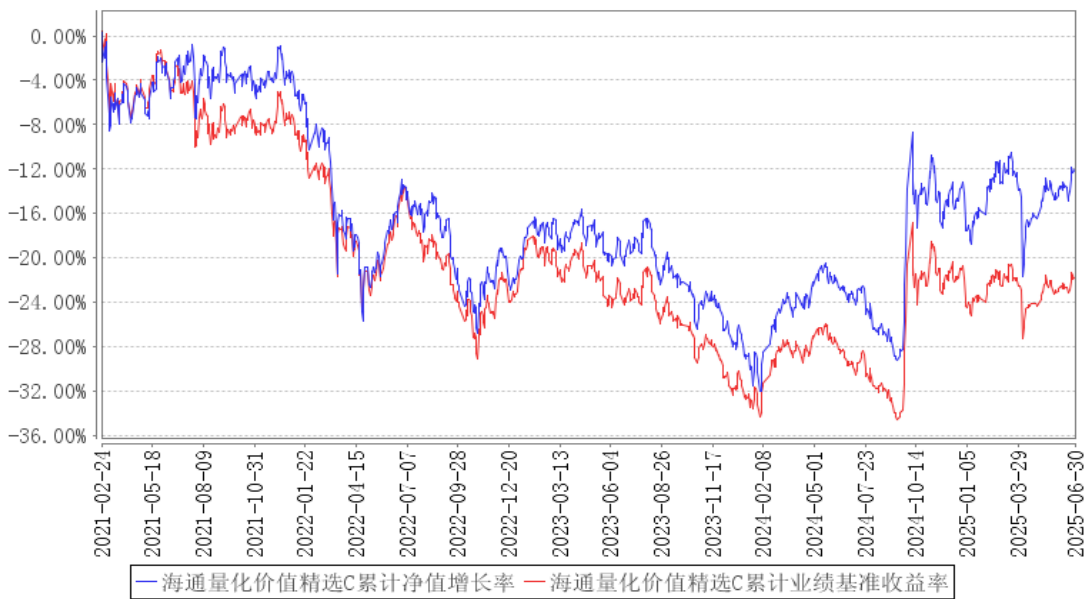
海通量化价值精选A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 2025 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		
胡倩	投资经理	2021 年 2 月 24 日	-	22 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专家。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。
张强	投资经理	2025 年 2 月 7 日	-	8 年	张强先生,厦门大学金融硕士,2016 年加入上海海通证券资产管理有限公司,曾任研究员助理,现任量化部投资经理助理。

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

2025 年上半年，A 股震荡上行，上证指数涨幅为 2.76%。一季度市场在科技突破的叙事中，吸引了国际投资者的关注，掀起了对中国科技股价值重估的浪潮。二季度，贸易政策的变动成为市场关注的重点，市场历经短暂调整后，重新恢复涨势。上半年市场成交处于一个较为活跃的水平，投资者对权益市场依旧有较强的信心。政策上，资本市场改革也在逐步推进，上市公司分红比例在提升，投资者获得感得到增强。当前，在较低的无风险收益的环境下，权益市场投资价值较为突出，长期视角下，我们对 A 股市场表现仍较为乐观。

在产品运作上，我们始终坚持多层次的量化策略体系，持续探索获取超额收益和绝对收益的路径，同时注重上市公司质量等基本面因素，大浪淘沙，致力于挖掘市场中的潜在逻辑，力图获得超越业绩基准的投资回报。

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 1.1302 元，B 份额净值为 1.1347 元，C 份额净值为 1.1066 元。本报告期集合计划三类份额净值增长率分别为 2.82%，2.87%，2.56%，业绩比较基准收益率为 0.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，关税政策不确定性最大的时刻或许已经过去，后续步入理性协商阶段。在观察到

出口商积极寻找新市场后，市场对于出口预期也不再那么悲观，总体上，市场担心的风险因素在逐渐减轻。在投资策略上，我们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。

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，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

选一年持有期混合型集合资产管理计划 2025 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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	7,726,393.30	7,692,245.72
结算备付金		1,459,456.55	1,202,614.26
存出保证金		578,269.72	570,228.97
交易性金融资产	6.4.7.2	51,868,780.57	64,182,289.76
其中：股票投资		51,868,780.57	64,182,289.76
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		157,337.32	52,177.65
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		61,790,237.46	73,699,556.36
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		8.47	11.48
应付赎回款		338,657.37	24,087.81
应付管理人报酬		38,557.19	47,604.10
应付托管费		7,448.08	9,326.92
应付销售服务费		1,615.73	1,879.32
应付投资顾问费		-	-
应交税费		223,316.08	188,689.62
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	48,199.15	89,000.00
负债合计		657,802.07	360,599.25
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	54,114,654.12	66,715,052.61
未分配利润	6.4.7.12	7,017,781.27	6,623,904.50
净资产合计		61,132,435.39	73,338,957.11
负债和净资产总计		61,790,237.46	73,699,556.36

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，集合计划份额总额 54,114,654.12 份，其中海通量化价值精选 A 份额净值（暂估业绩报酬前）1.1302 元，份额总额 37,743,748.98 份，资产净值（暂估业绩报酬前）42,657,282.83 元，相关暂估业绩报酬余额为 931.29 元（于 2024 年 12 月 31 日 959.72 元），资产净值（暂估业绩报酬后）42,656,351.54 元；海通量化价值精选 B 份额净值（暂估业绩报酬前）1.1347 元，份额总额 12,760,491.65 份，资产净值（暂估业绩报酬前）14,479,730.50 元，相关暂估业绩报酬余额为 60,139.09 元（于 2024 年 12 月 31 日 49,428.50 元），资产净值（暂估业绩报酬后）14,419,591.41 元；海通量化价值精选 C 份额净值（暂估业绩报酬前）1.1066 元，份额总额 3,610,413.49 份，资产净值（暂估业绩报酬前）3,995,422.06 元，相关暂估业绩报酬余额为 222.00 元（于 2024 年 12 月 31 日 352.24 元），资产净值（暂估业绩报酬后）3,995,200.06 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,163,211.41	3,515,535.39
1. 利息收入		15,234.68	26,994.64
其中：存款利息收入	6.4.7.13	15,234.68	26,994.64
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,619,685.26	-2,335,262.41
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,434,250.71	-3,366,657.36
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	553,060.31	39,109.35
股利收益	6.4.7.19	632,374.24	992,285.60
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	-471,708.53	5,823,803.16
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		358,777.83	416,983.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	248,323.60	302,317.78
2. 托管费	6.4.10.2.2	48,067.34	59,259.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	10,231.80	10,611.53
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		7,300.91	-
8. 其他费用	6.4.7.23	44,854.18	44,795.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,804,433.58	3,098,551.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,804,433.58	3,098,551.48

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,804,433.58	3,098,551.48

6.3 净资产变动表

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	66,715,052.61	6,623,904.50	73,338,957.11
二、本期期初净资产	66,715,052.61	6,623,904.50	73,338,957.11
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-12,600,398.49	393,876.77	-12,206,521.72
(一)、综合收益总额	-	1,804,433.58	1,804,433.58
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-12,600,398.49	-1,410,556.81	-14,010,955.30
其中：1. 基金申购款	64,037.21	8,100.54	72,137.75
2. 基金赎回款	-12,664,435.70	-1,418,657.35	-14,083,093.05
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	54,114,654.12	7,017,781.27	61,132,435.39
项目	上年度可比期间		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	86,845,157.14	-5,053,498.35	81,791,658.79
二、本期期初净资产	86,845,157.14	-5,053,498.35	81,791,658.79
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-6,449,391.75	3,451,406.18	-2,997,985.57

(一)、综合收益总额	-	3,098,551.48	3,098,551.48
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-6,449,391.75	352,854.70	-6,096,537.05
其中: 1. 基金申购款	53,257.25	-3,684.79	49,572.46
2. 基金赎回款	-6,502,649.00	356,539.49	-6,146,109.51
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	80,395,765.39	-1,602,092.17	78,793,673.22

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:

叶明

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至2025年12月31日。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 $80\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 20\% \times \text{商业银行活期存款利率（税后）}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有

关问题的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《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[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本集合计划适用的主要税项列示如下：

- (1)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。
- (2)自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。
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。
- 对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。
- (3)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (4)基金卖出股票按 0.1%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。
- (5)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。
- (6)对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	7,726,393.30
等于：本金	7,725,640.85
加：应计利息	752.45
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	7,726,393.30

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		45,796,968.16	-	51,868,780.57	6,071,812.41
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		45,796,968.16	-	51,868,780.57	6,071,812.41

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 2025 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	4,834,560.00	-	-	-
其中：股指期货投资	4,834,560.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,834,560.00	-	-	-

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
IF2509	IF2509	2.00	2,332,200.00	-31,440.00
IM2509	IM2509	2.00	2,462,240.00	-8,680.00
合计				-40,120.00
减：可抵销期货暂收款				-40,120.00
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 2025 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	4,064.11
其中：交易所市场	4,064.11
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	44,135.04
合计	48,199.15

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,729,553.72	39,729,553.72
本期申购	57,784.55	57,784.55
本期赎回（以“-”号填列）	-2,043,589.29	-2,043,589.29
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	37,743,748.98	37,743,748.98
-----	---------------	---------------

海通量化价值精选 B

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,972,821.92	22,972,821.92
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-10,212,330.27	-10,212,330.27
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	12,760,491.65	12,760,491.65

海通量化价值精选 C

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,012,676.97	4,012,676.97
本期申购	6,252.66	6,252.66
本期赎回（以“-”号填列）	-408,516.14	-408,516.14
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,610,413.49	3,610,413.49

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	1,185,849.28	2,754,305.76	3,940,155.04
本期期初	1,185,849.28	2,754,305.76	3,940,155.04
本期利润	1,598,027.98	-423,963.11	1,174,064.87
本期基金份额交易产生的变动数	-94,098.71	-106,587.35	-200,686.06
其中：基金申购款	2,247.96	5,370.24	7,618.20
基金赎回款	-96,346.67	-111,957.59	-208,304.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,689,778.55	2,223,755.30	4,913,533.85

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	2,561,934.82	-194,990.69	2,366,944.13
本期期初	2,561,934.82	-194,990.69	2,366,944.13
本期利润	536,989.04	-7,663.96	529,325.08
本期基金份额交易产生的变动数	-1,138,127.13	-38,903.23	-1,177,030.36
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1,138,127.13	-38,903.23	-1,177,030.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,960,796.73	-241,557.88	1,719,238.85

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	46,264.63	270,540.70	316,805.33
本期期初	46,264.63	270,540.70	316,805.33
本期利润	141,125.09	-40,081.46	101,043.63
本期基金份额交易产生的变动数	-8,843.88	-23,996.51	-32,840.39
其中：基金申购款	176.46	305.88	482.34
基金赎回款	-9,020.34	-24,302.39	-33,322.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	178,545.84	206,462.73	385,008.57

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,220.90
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,004.62
其他	9.16
合计	15,234.68

注：其他为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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	45,578,208.51
减：卖出股票成本总额	44,103,500.24
减：交易费用	40,457.56
买卖股票差价收入	1,434,250.71

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未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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	553,060.31

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	632,374.24
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	632,374.24
----	------------

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-166,536.14
股票投资	-166,536.14
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	-297,100.00
权证投资	-
期货投资	-297,100.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	8,072.39
合计	-471,708.53

6.4.7.21 其他收入

注：本集合计划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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	178.00
证券组合费	541.14
合计	44,854.18

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

因国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司，自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安成为本集合计划管理人的控股股东。2025 年 4 月 3 日，国泰海通证券股份有限公司完成名称变更登记，由“国泰君安证券股份有限公司”正式更名为“国泰海通证券股份有限公司”。

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
国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通”）	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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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（%）
国泰海通	77,578,976.99	100.00	251,884,141.61	100.00

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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（%）
国泰海通	10,150.68	100.00	4,064.11	100.00

关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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（%）
国泰海通	33,372.92	100.00	3,982.49	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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	248,323.60	302,317.78
其中：应支付销售机构的客户维护费	96,859.44	53,125.07
应支付基金管理人的净管理费	151,464.16	249,192.71

注：1. 本集合计划本期共发生应支付的固定管理费 247,486.23 元（其中 A 类份额 169,007.54 元，B 类份额 62,107.86 元，C 类份额 16,370.83 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 837.37 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	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	48,067.34	59,259.34

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			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	-	2,921.88	2,921.88
国泰海通	-	-	7,227.00	7,227.00
合计	-	-	10,148.88	10,148.88
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 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	海通量化价值精	海通量化价值精	合计

	选 A	选 B	选 C	
工商银行	-	-	2,527.42	2,527.42
国泰海通	-	-	8,014.93	8,014.93
海通资管	-	-	1.82	1.82
合计	-	-	10,544.17	10,544.17

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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	10,099,736.72	-

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	-	10,099,736.72	-
报告期末持有的基金 份额 占基金总份额比例	-	79.15%	-
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	53.32%	-

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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（%）
国泰海通	-	-	10,000,000.00	43.53

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	7,726,393.30	13,220.90	9,948,465.74	18,082.66

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内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 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

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 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,726,393.30	-	-	-	7,726,393.30
结算备付金	1,459,456.55	-	-	-	1,459,456.55
存出保证金	578,269.72	-	-	-	578,269.72
交易性金融资产	-	-	-	51,868,780.57	51,868,780.57
应收股利	-	-	-	157,337.32	157,337.32
资产总计	9,764,119.57	-	-	52,026,117.89	61,790,237.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	338,657.37	338,657.37
应付管理人报酬	-	-	-	38,557.19	38,557.19
应付托管费	-	-	-	7,448.08	7,448.08
应付清算款	-	-	-	8.47	8.47
应付销售服务费	-	-	-	1,615.73	1,615.73
应交税费	-	-	-	223,316.08	223,316.08
其他负债	-	-	-	48,199.15	48,199.15
负债总计	-	-	-	657,802.07	657,802.07
利率敏感度缺口	9,764,119.57	-	-	51,368,315.82	61,132,435.39
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,692,245.72	-	-	-	7,692,245.72
结算备付金	1,202,614.26	-	-	-	1,202,614.26
存出保证金	570,228.97	-	-	-	570,228.97
交易性金融资产	-	-	-	64,182,289.76	64,182,289.76
应收股利	-	-	-	52,177.65	52,177.65
资产总计	9,465,088.95	-	-	64,234,467.41	73,699,556.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	24,087.81	24,087.81
应付管理人报酬	-	-	-	47,604.10	47,604.10
应付托管费	-	-	-	9,326.92	9,326.92
应付清算款	-	-	-	11.48	11.48
应付销售服务费	-	-	-	1,879.32	1,879.32
应交税费	-	-	-	188,689.62	188,689.62

其他负债	-	-	-	89,000.00	89,000.00
负债总计	-	-	-	360,599.25	360,599.25
利率敏感度缺口	9,465,088.95	-	-	63,873,868.16	73,338,957.11

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 2025 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%（2024 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（2024 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 2025 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	-	12,760,423.92	-	12,760,423.92
资产合计	-	12,760,423.92	-	12,760,423.92
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	-	12,760,423.92	-	12,760,423.92
项目	上年度末 2024 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	-	12,981,376.90	-	12,981,376.90
资产合计	-	12,981,376.90	-	12,981,376.90
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	-	12,981,376.90	-	12,981,376.90

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	638,021.20	649,068.85
	所有外币相对人民币贬值 5%	-638,021.20	-649,068.85

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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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	51,868,780.57	84.85	64,182,289.76	87.51
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	51,868,780.57	84.85	64,182,289.76	87.51

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	股票价格上升 5%	2,593,439.03	3,209,114.49
	股票价格下降 5%	-2,593,439.03	-3,209,114.49

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	51,868,780.57	64,133,915.76
第二层次	-	48,374.00
第三层次	-	-
合计	51,868,780.57	64,182,289.76

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 2025 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 2025 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	51,868,780.57	83.94
	其中：股票	51,868,780.57	83.94
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	9,185,849.85	14.87
8	其他各项资产	735,607.04	1.19
9	合计	61,790,237.46	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 12,760,423.92 元，占资产净值比例为 20.87%。

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	-	-
B	采矿业	906,485.00	1.48
C	制造业	27,546,758.90	45.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,551,449.00	2.54
E	建筑业	303,009.00	0.50
F	批发和零售业	117,068.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	835,448.00	1.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,601,425.61	2.62
J	金融业	5,503,213.27	9.00
K	房地产业	335,678.00	0.55
L	租赁和商务服务业	225,086.00	0.37
M	科学研究和技术服务业	182,735.87	0.30
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	39,108,356.65	63.97

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	1,737,811.92	2.84
消费者常用品	-	-
能源	1,560,528.85	2.55
金融	3,968,414.26	6.49
医疗保健	-	-
工业	2,221,592.28	3.63
信息技术	1,630,566.60	2.67
电信服务	1,191,462.68	1.95
公用事业	-	-
房地产	450,047.33	0.74
合计	12,760,423.92	20.87

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	01339	中国人民保险集团	345,000	1,878,297.82	3.07
1	601319	中国人保	12,000	104,520.00	0.17
2	00981	中芯国际	40,000	1,630,566.60	2.67
2	688981	中芯国际	1,136	100,161.12	0.16
3	002594	比亚迪	5,000	1,659,550.00	2.71
4	000792	盐湖股份	86,900	1,484,252.00	2.43
5	02628	中国人寿	74,000	1,271,404.21	2.08
5	601628	中国人寿	2,900	119,451.00	0.20
6	600372	中航机载	105,866	1,276,743.96	2.09
7	00175	吉利汽车	85,000	1,237,151.37	2.02
8	00941	中国移动	15,000	1,191,462.68	1.95
9	300750	宁德时代	4,345	1,095,895.90	1.79
10	600150	中国船舶	32,800	1,067,312.00	1.75
11	01766	中国中车	190,000	821,302.17	1.34
11	601766	中国中车	17,700	124,608.00	0.20
12	00857	中国石油股份	150,000	923,349.38	1.51
13	03898	时代电气	27,000	778,075.74	1.27
13	688187	时代电气	2,688	114,643.20	0.19
14	002371	北方华创	2,000	884,420.00	1.45
15	688047	龙芯中科	6,219	829,552.41	1.36
16	301269	华大九天	6,600	817,608.00	1.34
17	601318	中国平安	12,400	687,952.00	1.13
18	600019	宝钢股份	101,000	665,590.00	1.09
19	00386	中国石油化工股份	170,000	637,179.47	1.04

19	600028	中国石化	700	3,948.00	0.01
20	600036	招商银行	13,800	634,110.00	1.04
21	01800	中国交通建设	133,000	622,214.37	1.02
22	603100	川仪股份	30,000	618,900.00	1.01
23	688041	海光信息	4,195	592,711.55	0.97
24	003031	中瓷电子	11,100	590,631.00	0.97
25	600893	航发动力	15,200	585,808.00	0.96
26	688375	国博电子	8,800	528,088.00	0.86
27	01658	邮储银行	80,000	399,798.88	0.65
27	601658	邮储银行	22,400	122,528.00	0.20
28	601899	紫金矿业	26,300	512,850.00	0.84
29	601166	兴业银行	21,900	511,146.00	0.84
30	601877	正泰电器	22,150	502,140.50	0.82
31	09988	阿里巴巴-SW	5,000	500,660.55	0.82
32	688019	安集科技	3,250	493,350.00	0.81
33	600577	精达股份	63,800	474,672.00	0.78
34	688082	盛美上海	4,122	469,660.68	0.77
35	688012	中微公司	2,550	464,865.00	0.76
36	00014	希慎兴业	35,000	450,047.33	0.74
37	600519	贵州茅台	300	422,856.00	0.69
38	00939	建设银行	58,000	418,913.35	0.69
39	000333	美的集团	5,500	397,100.00	0.65
40	600900	长江电力	13,100	394,834.00	0.65
41	000725	京东方 A	91,800	366,282.00	0.60
42	601615	明阳智能	30,100	345,849.00	0.57
43	600765	中航重机	19,800	334,224.00	0.55
44	000858	五粮液	2,552	303,432.80	0.50
45	600460	士兰微	12,200	302,804.00	0.50
46	000651	格力电器	6,500	291,980.00	0.48
47	300059	东方财富	12,200	282,186.00	0.46
48	601989	中国重工	55,800	258,912.00	0.42
49	601288	农业银行	43,100	253,428.00	0.41
50	600030	中信证券	9,100	251,342.00	0.41
51	600061	国投资本	33,100	248,912.00	0.41
52	002415	海康威视	8,800	244,024.00	0.40
53	600219	南山铝业	63,300	242,439.00	0.40
54	601916	浙商银行	69,500	235,605.00	0.39
55	001289	龙源电力	14,400	232,992.00	0.38
56	002252	上海莱士	33,700	231,519.00	0.38
57	600515	海南机场	63,400	224,436.00	0.37
58	002736	国信证券	19,411	223,614.72	0.37
59	601698	中国卫通	10,800	221,076.00	0.36
60	600436	片仔癀	1,100	220,011.00	0.36

61	000301	东方盛虹	26,000	216,580.00	0.35
62	600009	上海机场	6,800	216,036.00	0.35
63	600276	恒瑞医药	4,149	215,333.10	0.35
64	601238	广汽集团	28,300	211,967.00	0.35
65	600018	上港集团	36,500	208,415.00	0.34
66	600332	白云山	6,800	179,248.00	0.29
67	688008	澜起科技	2,069	169,658.00	0.28
68	600000	浦发银行	12,200	169,336.00	0.28
69	688126	沪硅产业	8,949	167,525.28	0.27
70	688469	中芯集成	34,344	163,820.88	0.27
71	000100	TCL 科技	37,440	162,115.20	0.27
72	600887	伊利股份	5,700	158,916.00	0.26
73	688249	晶合集成	7,620	154,457.40	0.25
74	688183	生益电子	2,876	147,251.20	0.24
75	002414	高德红外	14,100	144,525.00	0.24
76	600016	民生银行	29,700	141,075.00	0.23
77	600862	中航高科	5,100	133,008.00	0.22
78	688396	华润微	2,817	132,849.72	0.22
79	600378	昊华科技	4,900	132,643.00	0.22
80	300474	景嘉微	1,800	131,400.00	0.21
81	601012	隆基绿能	8,700	130,674.00	0.21
82	688303	大全能源	6,071	129,433.72	0.21
83	300739	明阳电路	8,700	129,108.00	0.21
84	600690	海尔智家	5,200	128,856.00	0.21
85	600038	中直股份	3,300	128,073.00	0.21
86	000408	藏格矿业	3,000	128,010.00	0.21
87	002459	晶澳科技	12,800	127,744.00	0.21
88	601169	北京银行	18,700	127,721.00	0.21
89	601377	兴业证券	20,545	127,173.55	0.21
90	601865	福莱特	8,300	126,243.00	0.21
91	603799	华友钴业	3,400	125,868.00	0.21
92	601818	光大银行	30,200	125,330.00	0.21
93	000630	铜陵有色	37,400	124,916.00	0.20
94	600918	中泰证券	19,400	124,742.00	0.20
95	002230	科大讯飞	2,600	124,488.00	0.20
96	300502	新易盛	980	124,479.60	0.20
97	601988	中国银行	22,100	124,202.00	0.20
98	000157	中联重科	17,000	122,910.00	0.20
99	002129	TCL 中环	16,000	122,880.00	0.20
100	600482	中国动力	5,300	122,271.00	0.20
101	600362	江西铜业	5,200	121,836.00	0.20
102	002466	天齐锂业	3,800	121,752.00	0.20
103	601777	千里科技	14,300	121,407.00	0.20

104	601808	中海油服	8,800	121,088.00	0.20
105	600104	上汽集团	7,532	120,888.60	0.20
106	688223	晶科能源	23,211	120,465.09	0.20
107	000877	天山股份	25,900	120,176.00	0.20
108	000027	深圳能源	18,800	119,944.00	0.20
109	002064	华峰化学	18,084	119,535.24	0.20
110	603260	合盛硅业	2,500	118,500.00	0.19
111	601066	中信建投	4,900	117,845.00	0.19
112	600588	用友网络	8,800	117,656.00	0.19
113	002236	大华股份	7,400	117,512.00	0.19
114	600995	南网储能	12,000	117,360.00	0.19
115	601179	中国西电	19,100	117,274.00	0.19
116	001872	招商港口	5,900	117,174.00	0.19
117	000538	云南白药	2,100	117,159.00	0.19
118	601699	潞安环能	11,100	117,105.00	0.19
119	601061	中信金属	14,800	117,068.00	0.19
120	002179	中航光电	2,900	117,044.00	0.19
121	000883	湖北能源	25,900	116,809.00	0.19
122	300316	晶盛机电	4,300	116,745.00	0.19
123	000425	徐工机械	15,000	116,550.00	0.19
124	601825	沪农商行	12,000	116,400.00	0.19
125	600236	桂冠电力	18,400	115,368.00	0.19
126	601186	中国铁建	14,400	115,344.00	0.19
127	002027	分众传媒	15,800	115,340.00	0.19
128	600938	中国海油	4,400	114,884.00	0.19
129	000625	长安汽车	9,000	114,840.00	0.19
130	300628	亿联网络	3,300	114,708.00	0.19
131	600406	国电南瑞	5,100	114,291.00	0.19
132	600905	三峡能源	26,800	114,168.00	0.19
133	600660	福耀玻璃	2,000	114,020.00	0.19
134	688111	金山办公	407	113,980.35	0.19
135	600674	川投能源	7,100	113,884.00	0.19
136	600803	新奥股份	6,000	113,400.00	0.19
137	600989	宝丰能源	7,000	112,980.00	0.18
138	600741	华域汽车	6,400	112,960.00	0.18
139	600025	华能水电	11,800	112,690.00	0.18
140	300760	迈瑞医疗	500	112,375.00	0.18
141	600377	宁沪高速	7,200	110,448.00	0.18
142	600958	东方证券	11,400	110,352.00	0.18
143	002001	新和成	5,168	109,923.36	0.18
144	601888	中国中免	1,800	109,746.00	0.18
145	001965	招商公路	9,100	109,200.00	0.18
146	603288	海天味业	2,800	108,948.00	0.18

147	600908	无锡银行	17,100	107,901.00	0.18
148	688271	联影医疗	844	107,812.56	0.18
149	601901	方正证券	13,500	106,785.00	0.17
150	603392	万泰生物	1,700	103,700.00	0.17
151	002839	张家港行	22,500	101,250.00	0.17
152	300236	上海新阳	2,600	100,880.00	0.17
153	601799	星宇股份	800	100,000.00	0.16
154	688686	奥普特	1,031	98,584.22	0.16
155	601618	中国中冶	33,000	98,340.00	0.16
156	601633	长城汽车	4,500	96,660.00	0.16
157	688100	威胜信息	2,602	96,404.10	0.16
158	002493	荣盛石化	11,600	96,048.00	0.16
159	605117	德业股份	1,820	95,841.20	0.16
160	688009	中国通号	18,530	95,244.20	0.16
161	601236	红塔证券	11,200	94,864.00	0.16
162	300999	金龙鱼	3,200	94,496.00	0.15
163	300620	光库科技	2,000	94,220.00	0.15
164	688248	南网科技	2,942	92,555.32	0.15
165	600845	宝信软件	3,900	92,118.00	0.15
166	301265	华新环保	9,000	91,800.00	0.15
167	600517	国网英大	17,700	90,270.00	0.15
168	688105	诺唯赞	3,985	90,180.55	0.15
169	301046	能辉科技	4,500	89,325.00	0.15
170	603567	珍宝岛	7,600	89,300.00	0.15
171	688505	复旦张江	10,266	88,903.56	0.15
172	688285	高铁电气	10,750	88,150.00	0.14
173	601568	北元集团	20,800	86,320.00	0.14
174	688085	三友医疗	4,472	85,996.56	0.14
175	603195	公牛集团	1,773	85,547.25	0.14
176	688198	佰仁医疗	821	84,308.49	0.14
177	600663	陆家嘴	9,500	84,170.00	0.14
178	601816	京沪高铁	12,900	74,175.00	0.12
179	300124	汇川技术	800	51,656.00	0.08
180	300811	铂科新材	1,000	46,410.00	0.08
181	000166	申万宏源	8,600	43,172.00	0.07
182	600925	苏能股份	7,000	36,610.00	0.06
183	600675	中华企业	9,400	27,072.00	0.04
184	688261	东微半导	200	8,250.00	0.01
185	300433	蓝思科技	300	6,690.00	0.01
186	000751	锌业股份	1,000	3,140.00	0.01
187	002311	海大集团	49	2,870.91	0.00
188	000999	华润三九	52	1,626.56	0.00
189	600089	特变电工	46	548.78	0.00

190	600050	中国联通	39	208.26	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	600519	贵州茅台	917,515.00	1.25
2	301269	华大九天	844,961.00	1.15
3	603100	川仪股份	667,800.00	0.91
4	09988	阿里巴巴-SW	608,540.09	0.83
5	003031	中瓷电子	540,681.00	0.74
6	600893	航发动力	519,301.00	0.71
7	688375	国博电子	473,894.00	0.65
8	600577	精达股份	472,120.00	0.64
9	002180	纳思达	456,126.00	0.62
10	00014	希慎兴业	455,517.60	0.62
11	688082	盛美上海	440,631.68	0.60
12	002001	新和成	400,674.00	0.55
13	688019	安集科技	394,450.00	0.54
14	600219	南山铝业	391,503.00	0.53
15	600061	国投资本	348,192.00	0.47
16	601319	中国人保	347,576.00	0.47
17	000651	格力电器	345,602.00	0.47
18	688047	龙芯中科	322,279.88	0.44
19	601939	建设银行	310,960.00	0.42
20	688008	澜起科技	305,491.00	0.42

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	000333	美的集团	891,179.00	1.22
2	600406	国电南瑞	819,010.00	1.12
3	06099	招商证券	718,214.92	0.98
3	600999	招商证券	7,438.08	0.01
4	600219	南山铝业	712,144.00	0.97
5	300408	三环集团	701,079.00	0.96
6	002601	龙佰集团	683,725.00	0.93
7	03969	中国通号	557,137.26	0.76
7	688009	中国通号	105,711.22	0.14
8	600875	东方电气	637,694.00	0.87
9	601318	中国平安	631,722.00	0.86

10	601766	中国中车	629,298.00	0.86
11	01186	中国铁建	526,965.42	0.72
11	601186	中国铁建	82,848.00	0.11
12	000166	申万宏源	595,173.00	0.81
13	600885	宏发股份	562,763.00	0.77
14	002001	新和成	562,296.00	0.77
15	601138	工业富联	550,568.00	0.75
16	601877	正泰电器	543,108.00	0.74
17	600050	中国联通	539,888.00	0.74
18	002475	立讯精密	534,891.80	0.73
19	000977	浪潮信息	523,798.00	0.71
20	601688	华泰证券	518,675.00	0.71

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关税费。

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	31,956,527.19
卖出股票收入（成交）总额	45,578,208.51

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，但包含增值税。

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，适时投资。

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

无

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中国人民保险集团及中国人寿保险股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局处罚。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	578,269.72
2	应收清算款	-
3	应收股利	157,337.32
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	735,607.04

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 (%)
海通量化 价值精选 A	660	57,187.50	0.00	0.00	37,743,748.98	100.00
海通量化 价值精选 B	49	260,418.20	10,099,736.72	79.15	2,660,754.93	20.85
海通量化 价值精选 C	138	26,162.42	0.00	0.00	3,610,413.49	100.00
合计	847	63,889.79	10,099,736.72	18.66	44,014,917.40	81.34

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	16,378.69	0.0434
	海通量化价值精选 B	126,262.46	0.9895
	海通量化价值精选 C	-	-
	合计	142,641.15	0.2636

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	-
	海通量化价值精选 B	0~10
	海通量化价值精选 C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有 本开放式基金	海通量化价值精选 A	-
	海通量化价值精选 B	0~10
	海通量化价值精选 C	-
	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	39,729,553.72	22,972,821.92	4,012,676.97
本报告期基金总申购份额	57,784.55	—	6,252.66
减：本报告期基金总赎回份额	2,043,589.29	10,212,330.27	408,516.14
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	37,743,748.98	12,760,491.65	3,610,413.49

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. 2025 年 2 月 17 日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司董事会审议通过，董山青先生自 2025 年 2 月 14 日担任公司投资总监。
2. 2025 年 2 月 27 日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司董事会审议通过，左秀海先生自 2025 年 2 月 27 日代任公司总经理。
3. 2025 年 4 月 24 日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司董事会审议通过，陶耿先生自 2025 年 4 月 22 日担任公司董事长。
4. 2025 年 4 月 25 日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司董事会审议通过，叶明先生自 2025 年 4 月 25 日担任公司副总经理（主持工作）。
5. 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。2023 年 9 月 27 日法院作出一审判决，判决驳回原告对海通资管的所有诉讼请求。上诉期

内原告提起上诉，目前案件正在二审程序中。

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 (%)	
国泰海通	2	77,578,976.99	100.00	10,150.68	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 (%)
国泰海通	-	-	-	-	-	-

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（A 类份额）产品资料概要（更新）	规定披露媒介	2025 年 6 月 13 日
2	海通量化价值精选一年持有期混合型	规定披露媒介	2025 年 6 月 13 日

	集合资产管理计划（B 类份额）产品资料概要（更新）		
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（C 类份额）产品资料概要（更新）	规定披露媒介	2025 年 6 月 13 日
4	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暂停申购、转换转入、定期定额投资公告	规定披露媒介	2025 年 6 月 13 日
5	上海海通证券资产管理有限公司关于海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告	规定披露媒介	2025 年 6 月 13 日
6	海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划（A 类份额）产品资料概要（更新）	规定披露媒介	2025 年 2 月 10 日
7	海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划（B 类份额）产品资料概要（更新）	规定披露媒介	2025 年 2 月 10 日
8	海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划（C 类份额）产品资料概要（更新）	规定披露媒介	2025 年 2 月 10 日
9	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	2025 年 2 月 7 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)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: 95521

上海海通证券资产管理有限公司

2025 年 8 月 29 日