

海通核心优势一年持有期混合型集合资产 管理计划 2020 年中期报告

2020 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金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基金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 2020 年 4 月 8 日起至 2020 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	8
3.3 其他指标	10
§ 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	13
§ 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 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45

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	45
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	46
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	46
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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 市场中性策略执行情况	46
7.13 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划		
基金简称	海通核心优势		
基金主代码	850005		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020 年 4 月 8 日		
基金管理人	上海海通证券资产管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	2,638,941,135.19 份		
基金合同存续期	自合同变更生效日起存续期不得超过 3 年		
下属分级基金的基金简称	海通核心优势 A	海通核心优势 B	海通核心优势 C
下属分级基金的交易代码	850588	850005	850599
报告期末下属分级基金的份额总额	2,446,797,030.60 份	70,328,667.26 份	121,815,437.33 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的增值。
投资策略	本集合计划将综合运用定量分析和定性分析手段，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定大类资产相对最优的配置比例，定期或不定期地进行调整，以达到规避风险及提高收益的目的。 股票投资策略：本集合计划坚持“成长与价值并重”的选股理念，采用“自上而下与自下而上相结合”的研究方法，根据宏观经济发展趋势及国家政策导向，在可理解可跟踪的行业内，采用定性和定量相结合的方法，严选具有核心优势的股票构建组合。 债券投资策略：本集合计划将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。 资产支持证券投资策略：本集合计划将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。 股指期货投资策略：管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、合约选择，谨慎地进行投资，旨在通过股指期货实现组合风险敞口管理的目标。 股票期权投资策略：本集合计划投资于股票期权按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好的期权合约进行投资。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×50%+中证港股通综合指数收益率×20%+中

	证全债指数收益率×30%
风险收益特征	本集合计划是一只混合型集合计划，其预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型集合计划和货币市场基金，低于股票型基金、股票型集合计划。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海海通证券资产管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李雪	陆志俊
	联系电话	95553	95559
	电子邮箱	htam@htsec.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		95553	95559
传真		021-63410460	021-62701216
注册地址		上海市广东路 689 号海通证券大厦 32 楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		上海市广东路 689 号海通证券大厦 32 楼	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200001	200336
法定代表人		裴长江	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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	基金管理人及基金托管人的办公场所

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(2020 年 4 月 8 日(基金合同生效日)-2020 年 6 月 30 日)		
	海通核心优势 A	海通核心优势 B	海通核心优势 C
本期已实现 收益	4,236,638.33	140,075.09	164,568.48

本期利润	8,566,547.56	246,773.47	372,177.53
加权平均基金份额本期利润	0.0067	0.0034	0.0051
本期加权平均净值利润率	0.67%	0.34%	0.51%
本期基金份额净值增长率	0.36%	0.35%	0.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)		
期末可供分配利润	5,015,005.03	139,321.12	170,991.48
期末可供分配基金份额利润	0.0020	0.0020	0.0014
期末基金资产净值	2,455,527,520.90	70,574,883.60	122,171,373.89
期末基金份额净值	1.0036	1.0035	1.0029
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	0.36%	0.35%	0.29%

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)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海通核心优势 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.36%	0.11%	4.88%	0.65%	-4.52%	-0.54%
自基金合同生效起至	0.36%	0.06%	6.14%	0.64%	-5.78%	-0.58%

海通核心优势 B

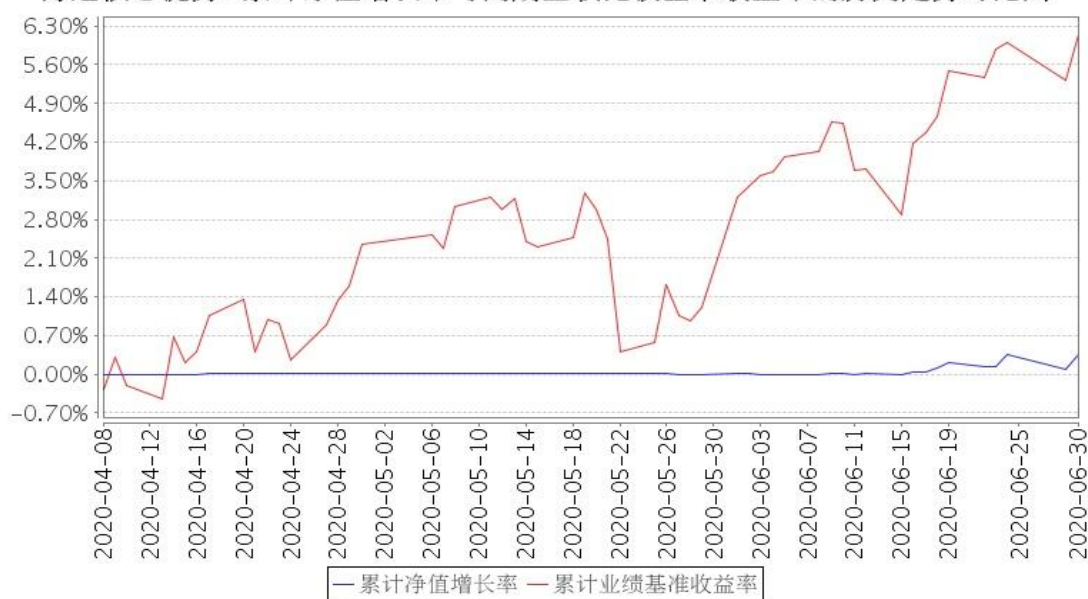
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.35%	0.11%	4.88%	0.65%	-4.53%	-0.54%
自基金合同生效起至	0.35%	0.06%	6.14%	0.64%	-5.79%	-0.58%

海通核心优势 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.31%	0.11%	4.88%	0.65%	-4.57%	-0.54%
自基金合同生效起至	0.29%	0.07%	6.14%	0.64%	-5.85%	-0.57%

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

海通核心优势A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



海通核心优势B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



海通核心优势C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2020 年 4 月 8 日至 2020 年 6 月 30 日。

按集合计划合同规定，本集合计划自合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告日本集合计划的各项投资比例已达到集合计划合同第十二部分（二）投资范围：本集合计划股票资产占集合计划总资产的 50%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的 0%-50%），投资于本集合计划界定的核心优势相关证券的比例不低于非现金集合计划资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的保证金后，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%。

3.3 其他指标

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2020 年 6 月 30 日，集合资产管理计划管理人共管理 1 只公募集合资产管理计划，即海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李天舒	权益二部总监	2017 年 5 月 16 日	-	11 年	李天舒女士，厦门大学经济学学士、中山大学管理学硕士、CPA。2014 年 11 月加入海通资管，现任权益二部总监，海通核心优势、海通海蓝内需价值优选、海通滴石 2 号集合计划投资主办人，曾任海富系列、海汇系列、海通博观睿选集合计划投资主办人。曾先后就职于安永咨询、海通证券股份有限公司，积累了丰富的财务咨询、投资银行、资产管理专业经验。具备扎实的投资管理理论基础，和对资本市场全产业链的深刻理解。 李天舒女士自 2017 年 5 月 16 日任职海通新兴成长集合计划投资主办人，海通新兴成长集合计划经证监会批准参公运作并更名为海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划，海通核心优势资产管理合同于 2020 年 4 月 8 日生效。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
李天舒	公募基金	1	2,648,273,778.39	2020 年 4 月 8 日

私募资产管理计划	2	163,724,389.72	2014 年 11 月 26 日
其他组合	-	-	-
合计	3	-	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本集合计划进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本集合计划于二季度完成了公募化改造后的首次集中募集，并于 2020 年 6 月 11 日开始建仓。2020 年 6 月下旬开始，市场成交量迅速攀升、指数启动了较快上涨。消费、医药、科技等长期看好的方向，在上半年积累了较快短期涨幅，这些领域的优秀公司股票，对应的潜在预期回报水平可能降低，而后疫情时代、全球经济弱复苏的偏周期行业（如建材、化工、金融地产、机械等）的龙头公司，具备估值与基本面双重改善预期，因此在建仓初期，我们着重对偏周期领域的龙头公司做了重点配置。长期我们依旧密切关注消费、医药领域的投资机会，并静待好的时机。

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 1.0036 元，B 份额净值为 1.0035 元，C 份额净值为 1.0029 元。本报告期集合计划三类份额净值增长率分别为 0.36%、0.35%、0.29%，业绩比较基准收益率为 6.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

权益市场经历了结构性行情，局部估值高企、整体估值合理，相对于债券等其他大类资产尚

具备一定的性价比优势。我们对权益市场的看法是，市场波动将会加大，市场结构经历逐步调整后，不改中长期继续向好的趋势。

主要基于的原因有两点，一是宏观经济的弱复苏，这在存量经济为主的社会里，表现形式依旧是各行业的龙头公司，会有超越经济总量弱复苏的更强复苏的可能性；二是权益市场相对于全球大类资产、特别是国内居民可投资的主要大类资产（债券、房地产、固定收益类理财产品）可能更高的预期回报。

我们依旧看好消费、医药等行业的中长期投资价值，在逐步消化短期高企的即期估值后，预计在中长期依旧会有良好的表现。而中短期相对确定的投资机会在低估值、受益于经济复苏的偏周期类行业的龙头公司。

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

2020 年上半年度，集合计划托管人在海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害集合计划持有人利益的行为。

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

2020 年上半年度，上海海通证券资产管理有限公司在海通核心优势一年持有期混合型集合资

产管理计划投资运作、集合计划资产净值的计算、集合计划份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害集合计划持有人利益的行为。

本报告期内本集合计划未进行收益分配，符合集合计划合同的规定。

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

2020 年上半年度，由上海海通证券资产管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	137,581,271.49
结算备付金		3,595,371.80
存出保证金		28,274.23
交易性金融资产	6.4.7.2	1,745,491,810.22
其中：股票投资		755,404,001.82
基金投资		—
债券投资		990,087,808.40
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	721,968,512.45
应收证券清算款		92,239,402.98
应收利息	6.4.7.5	29,185,623.68
应收股利		65,401.73
应收申购款		1,690,071.32
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		2,731,845,739.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 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		-
应付证券清算款		81,271,545.27
应付赎回款		158,542.47
应付管理人报酬		1,466,082.55
应付托管费		219,912.40
应付销售服务费		44,373.41
应付交易费用	6.4.7.7	103,129.81
应交税费		264,795.98
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	43,579.62
负债合计		83,571,961.51
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	2,638,941,135.19
未分配利润	6.4.7.10	9,332,643.20
所有者权益合计		2,648,273,778.39
负债和所有者权益总计		2,731,845,739.90

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，集合计划份额净值 1.0035 元，集合计划份额总额 2,638,941,135.19 份。

6.2 利润表

会计主体：海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		11,516,806.22
1. 利息收入		4,567,388.33
其中：存款利息收入	6.4.7.11	542,134.95
债券利息收入		2,443,707.59
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,581,545.79
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,305,201.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,682,716.27
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-150,844.83

资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	773,329.79
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,644,216.66
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-
减：二、费用		2,331,307.66
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,718,906.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	257,835.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	53,027.41
4. 交易费用	6.4.7.19	246,786.20
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		14,230.90
7. 其他费用	6.4.7.20	40,520.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,185,498.56
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,185,498.56

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	72,102,254.55	-	72,102,254.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,185,498.56	9,185,498.56
三、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）	2,566,838,880.64	147,144.64	2,566,986,025.28
其中：1. 基金申购款	2,568,612,467.93	147,701.77	2,568,760,169.70
2. 基金赎回款	-1,773,587.29	-557.13	-1,774,144.42

四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,638,941,135.19	9,332,643.20	2,648,273,778.39

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

海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于 2020 年 3 月 13 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2020]535 号）批准，《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》于 2020 年 4 月 8 日起正式变更生效。本集合计划为契约型开放式，自合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本集合计划的管理人为上海海通证券资产管理有限公司，托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、债券回购、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

本集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划总资产的 50%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的 0%-50%），投资于本集合计划界定的核心优势相关证券的比例不低

于非现金集合计划资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的保证金后，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本集合计划将港股通标的股票投资的比例下限设为零，本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股通标的股票或选择不将集合计划资产投资于港股通标的股票，集合计划资产并非必然投资港股通标的股票。

如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本集合计划的业绩比较基准为中证 800 指数收益率×50%+中证港股通综合指数收益率×20%+中证全债指数收益率×30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划 2020 年 4 月 8 日(计划合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 4 月 8 日(计划合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

6.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 4 月 8 日(计划合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本集合计划的记账本位币为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本集合计划现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本集合计划目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本集合计划持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本集合计划目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本集合计划持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本集合计划成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的

差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算计划持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本集合计划的收益分配政策为：

（1）在符合有关集合计划分红条件的前提下可进行收益分配，具体分红方案见管理人根据集合计划运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若《资产管理合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

（2）本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；若投资者选择将现金红利自动转为相应类别的集合计划份额进行再投资，再投资集合计划份额的持有期限与原持有集合计划份额相同（红利再投资取得的 A 类份额和 C 类份额，其锁定持有期的起算日与原持有集合计划份额相同）；

（3）集合计划收益分配后各类集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的各类集合计划份额净值减去每单位该类集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于本集合计划 A 类、B 类和 C 类份额的费用收取方式存在不同, 集合计划各份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本集合计划每一类别下集合计划份额享有同等分配权;

(5) 法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定。

6.4.4.12 外币交易

本集合计划本报告期无外币交易。

6.4.4.13 分部报告

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

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作, 不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	8,581,271.49
定期存款	129,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	129,000,000.00
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	137,581,271.49

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	749,674,116.56	755,404,001.82	5,729,885.26
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	276,472,810.50	275,864,808.40
	银行间市场	714,561,340.00	714,223,000.00
	合计	991,034,150.50	990,087,808.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,740,708,267.06	1,745,491,810.22	4,783,543.16

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	647,000,000.00	-
银行间市场	74,968,512.45	-
合计	721,968,512.45	-

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	6,921.12
应收定期存款利息	200,565.12
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	1,617.90
应收债券利息	28,705,928.44
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	270,578.21
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	12.89
合计	29,185,623.68

注：其他包括应收结算保证金利息、应收沪港通风控资金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本集合计划本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	99,292.36
银行间市场应付交易费用	3,837.45
合计	103,129.81

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 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	—
预提费用	43,579.62
合计	43,579.62

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

海通核心优势 A

第 24 页 共 52 页

项目	本期 2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	2,446,797,030.60	2,446,797,030.60
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
-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	2,446,797,030.60	2,446,797,030.60

海通核心优势 B

项目	本期 2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	72,102,254.55	72,102,254.55
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-1,773,587.29	-1,773,587.29
-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	70,328,667.26	70,328,667.26

海通核心优势 C

项目	本期 2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	121,815,437.33	121,815,437.33
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
-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	121,815,437.33	121,815,437.33

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）。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

海通核心优势 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-

本期利润	4,236,638.33	4,329,909.23	8,566,547.56
本期基金份额交易产生的变动数	778,366.70	-614,423.96	163,942.74
其中：基金申购款	778,366.70	-614,423.96	163,942.74
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,015,005.03	3,715,485.27	8,730,490.30
海通核心优势 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	140,075.09	106,698.38	246,773.47
本期基金份额交易产生的变动数	-753.97	196.84	-557.13
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-753.97	196.84	-557.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	139,321.12	106,895.22	246,216.34
海通核心优势 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	164,568.48	207,609.05	372,177.53
本期基金份额交易产生的变动数	6,423.00	-22,663.97	-16,240.97
其中：基金申购款	6,423.00	-22,663.97	-16,240.97
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	170,991.48	184,945.08	355,936.56

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	276,889.01
定期存款利息收入	256,876.23
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	8,297.69
其他	72.02
合计	542,134.95

注：其他包括结算保证金利息收入、沪港通风控资金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,682,716.27
股票投资收益——赎回差价收入	—
股票投资收益——申购差价收入	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	1,682,716.27

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	9,038,836.32
减：卖出股票成本总额	7,356,120.05
买卖股票差价收入	1,682,716.27

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本集合计划本报告期无证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年6月30日
----	-------------------------------------

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-150,844.83
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-150,844.83

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月8日（基金合同生效日）至2020年6月 30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	161,816,796.12
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	155,446,756.10
减：应收利息总额	6,520,884.85
买卖债券差价收入	-150,844.83

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本集合计划本报告期无赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本集合计划本报告期无申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本集合计划本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本集合计划本报告期无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本集合计划本报告期无赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本集合计划本报告期无申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本集合计划本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本集合计划本报告期无其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	773,329.79
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	773,329.79

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,783,543.16
股票投资	5,729,885.26
债券投资	-946,342.10
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	139,326.50

合计	4,644,216.66
----	--------------

6.4.7.18 其他收入

注：本集合计划本报告期无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	243,461.20
银行间市场交易费用	3,325.00
合计	246,786.20

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	2,721.57
信息披露费	37,164.08
证券出借违约金	—
银行费用	635.00
合计	40,520.65

6.4.7.21 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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

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 2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
海通证券	766,018,591.44	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
海通证券	434,491,147.60	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
海通证券	4,269,828,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月8日（基金合同生效日）至2020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	102,999.70	100.00	99,292.36	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
	2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,718,906.51
其中：支付销售机构的客户维护费	823,769.09

注：本集合计划的固定管理费按前一日集合计划资产净值的 0.8% 年费率计提。固定管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划固定管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	257,835.99

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.12% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.12\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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
	2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	海通核心优势 A	海通核心优势 B	海通核心优势 C	合计
交通银行	-	-	0.00	0.00
海通证券	-	-	51,738.44	51,738.44
海通资管	-	-	53.97	53.97
合计	-	-	51,792.41	51,792.41

注：C 类份额的销售服务费按前一日 C 类份额资产净值的 0.5% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本集合计划本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	本期 2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	本期 2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
	海通核心优势 A	海通核心优势 B	海通核心优势 C
基金合同生效日 （2020 年 4 月 8	0.00	9,255,132.76	0.00

日)持有的基金份额			
报告期初持有的基金份额	0.00	9,255,132.76	0.00
报告期间申购/买入总份额	199,980,002.00	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00	0.00
减: 报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	199,980,002.00	9,255,132.76	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.17%	13.16%	0.0%

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

海通核心优势 A

关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
海通证券股份有限公司	49,995,000.50	2.04

份额单位: 份

海通核心优势 B

关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
海通证券股份有限公司	47,166,761.51	67.06

份额单位: 份

海通核心优势 C

关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
海通证券股份有限公司	0.00	0.0

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 2020 年 4 月 8 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	8,581,271.49	276,889.01

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末未发生参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本集合计划均无其他关联交易事项的说明

6.4.11 利润分配情况

注：本集合计划本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末(2020 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本集合计划本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

—

注：本集合计划本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

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作为抵押的债券。

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。

本集合计划管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、合规与风险控制委员会、

合规负责人、风控与稽核部和合规与法务部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

本集合计划均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日
A-1	—
A-1 以下	—
未评级	23,211,600.00
合计	23,211,600.00

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日
A-1	—
A-1 以下	—

未评级	612,893,000.00
合计	—

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日
AAA	202,797,579.20
AAA 以下	49,855,629.20
未评级	101,330,000.00
合计	353,983,208.40

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本集合计划的管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压

力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本集合计划的申购赎回情况进行监控，保持投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本集合计划资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本集合计划的管理人在合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障持有人利益。

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

本集合计划本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、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 2020 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	137,581,271.49	-	-	-	137,581,271.49
结算备付金	3,595,371.80	-	-	-	3,595,371.80
存出保证金	28,274.23	-	-	-	28,274.23
交易性金融资产	990,087,808.40	-	-	-755,404,001.82	1,745,491,810.22

买入返售金融资产	721,968,512.45	-	-	-	721,968,512.45
应收利息	-	-	-	29,185,623.68	29,185,623.68
应收股利	-	-	-	65,401.73	65,401.73
应收申购款	-	-	-	1,690,071.32	1,690,071.32
应收证券清算款	-	-	-	92,239,402.98	92,239,402.98
资产总计	1,853,261,238.37	-	-	878,584,501.53	2,731,845,739.90
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	158,542.47	158,542.47
应付管理人报酬	-	-	-	1,466,082.55	1,466,082.55
应付托管费	-	-	-	219,912.40	219,912.40
应付证券清算款	-	-	-	81,271,545.27	81,271,545.27
应付销售服务费	-	-	-	44,373.41	44,373.41
应付交易费用	-	-	-	103,129.81	103,129.81
应交税费	-	-	-	264,795.98	264,795.98
其他负债	-	-	-	43,579.62	43,579.62
负债总计	-	-	-	83,571,961.51	83,571,961.51
利率敏感度缺口	1,853,261,238.37	-	-	-795,012,540.02	2,648,273,778.39

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
	利率曲线平行移动	
	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（2020年6月30日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-523,625.64
	市场利率下降 25 个基点	525,927.91

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本集合计划的管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020 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	-	61,812,126.73	-	61,812,126.73
资产合计	-	61,812,126.73	-	61,812,126.73
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	61,812,126.73	-	61,812,126.73

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2020 年 6 月 30 日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	3,090,606.34
	所有外币相对人民币贬值 5%	-3,090,606.34

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：股票资产占集合计划总资产的 50%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的 0%-50%），投资于本集合计划界定的核心优势相关证券的比例不低于非现金集合计划资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的保证金后，现金或到期日在一年期以内的政府债券

不低于集合计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本集合计划通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本集合计划的管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控。

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 2020 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	755,404,001.82	28.52
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—
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	755,404,001.82	28.52

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除股票价格以外的其他市场变量保持不变	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2020 年 6 月 30 日）
分析	股票价格上升 5%	37,770,200.09
	股票价格下降 5%	-37,770,200.09

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 以公允价值计量的资产和负债

下表列示了本集合计划在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2020 年 6 月 30 日, 本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 755, 404, 001. 82 元, 第二层次的余额为人民币 990, 087, 808. 40 元, 无属于第三层次的余额。

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本集合计划投资的证券交易所上市的证券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况时, 本集合计划不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本集合计划综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 6 月 30 日, 本集合计划无非持续的以公允价值计量的金融工具。

(2) 其他金融工具的公允价值(非以公允价值计量的项目)

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

(3) 除以上事项外, 截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	755, 404, 001. 82	27. 65
	其中：股票	755, 404, 001. 82	27. 65
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	990, 087, 808. 40	36. 24
	其中：债券	990, 087, 808. 40	36. 24
	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	721, 968, 512. 45	26. 43
	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	141, 176, 643. 29	5. 17
8	其他各项资产	123, 208, 773. 94	4. 51
9	合计	2, 731, 845, 739. 90	100. 00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	338,426,984.61	12.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	73,120,996.81	2.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	154,813,761.60	5.85
K	房地产业	82,172,841.38	3.10
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	16,569,724.00	0.63
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	28,487,566.69	1.08
S	综合	-	-
	合计	693,591,875.09	26.19

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	-	-
消费者常用品	5,231,161.27	0.20
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	56,580,965.46	2.14
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	61,812,126.73	2.33

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	601318	中国平安	1,377,999	98,389,128.60	3.72
2	000002	万科A	3,143,567	82,172,841.38	3.10
3	600585	海螺水泥	1,510,000	79,894,100.00	3.02
4	600009	上海机场	1,014,583	73,120,996.81	2.76
5	600486	扬农化工	786,900	64,919,250.00	2.45
6	01810	小米集团—W	4,824,200	56,580,965.46	2.14
7	600030	中信证券	2,340,300	56,424,633.00	2.13
8	600309	万华化学	1,106,704	55,324,132.96	2.09
9	000858	五粮液	315,914	54,059,203.68	2.04
10	600887	伊利股份	1,636,669	50,949,505.97	1.92
11	300788	中信出版	591,151	28,487,566.69	1.08
12	600323	瀚蓝环境	757,300	16,569,724.00	0.63
13	603833	欧派家居	120,000	13,908,000.00	0.53
14	000739	普洛药业	594,800	13,852,892.00	0.52
15	002798	帝欧家居	170,000	5,519,900.00	0.21
16	06186	中国飞鹤	369,000	5,231,161.27	0.20

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	100,219,984.40	3.78
2	600585	海螺水泥	81,735,378.03	3.09
3	000002	万科A	80,931,098.64	3.06
4	600009	上海机场	71,397,868.76	2.70
5	600486	扬农化工	64,334,959.68	2.43
6	01810	小米集团—W	56,431,308.11	2.13
7	600030	中信证券	54,702,765.00	2.07
8	600309	万华化学	53,604,342.21	2.02
9	000858	五粮液	52,428,974.04	1.98
10	600887	伊利股份	50,049,931.70	1.89
11	300788	中信出版	29,388,633.40	1.11
12	600323	瀚蓝环境	16,781,481.00	0.63
13	603833	欧派家居	13,860,021.00	0.52
14	000739	普洛药业	13,127,157.53	0.50
15	601012	隆基股份	7,264,261.00	0.27
16	002798	帝欧家居	5,575,674.00	0.21
17	06186	中国飞鹤	5,104,539.06	0.19

18	00700	腾讯控股	41,377.56	0.00
----	-------	------	-----------	------

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601012	隆基股份	8,993,472.64	0.34
2	00700	腾讯控股	45,363.68	0.00

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	756,979,755.12
卖出股票收入（成交）总额	9,038,836.32

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	23,211,600.00	0.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	101,330,000.00	3.83
	其中：政策性金融债	101,330,000.00	3.83
4	企业债券	252,653,208.40	9.54
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	612,893,000.00	23.14
9	其他	-	-
10	合计	990,087,808.40	37.39

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111909261	19 浦发银行 CD261	1,500,000	145,635,000.00	5.50
2	111915340	19 民生银行 CD340	1,400,000	135,968,000.00	5.13
3	111909253	19 浦发银行 CD253	1,000,000	97,090,000.00	3.67
4	111911121	19 平安银行 CD121	1,000,000	97,050,000.00	3.66
5	111909239	19 浦发银行 CD239	700,000	67,935,000.00	2.57

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本集合计划本报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、合约选择，谨慎地进行投资，旨在通过股指期货实现组合风险敞口管理的目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

根据本集合计划合同，本集合计划暂不投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本集合计划本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本集合计划合同，本集合计划暂不投资国债期货。

7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 755,469,403.55 元，占基金资产净值的比例为 27.65%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 0.00 元，占基金资产净值的比例为 0.00%，空头合约市值占股票资产的比例为 0.00%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 0.00 元，公允价值变动损益为 0.00 元。

7.13 投资组合报告附注**7.13.1**

报告期内，本集合计划投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2

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。

7.13.3 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	28,274.23
2	应收证券清算款	92,239,402.98
3	应收股利	65,401.73
4	应收利息	29,185,623.68
5	应收申购款	1,690,071.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	123,208,773.94

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 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 (%)
海通核心优势 A	24,804	98,645.26	325,032,886.06	13.28	2,121,764,144.54	86.72
海通核心优势	134	524,840.80	56,560,355.47	80.42	13,768,311.79	19.58

B						
海通核心优势 C	1,699	71,698.32	5,300,042.09	4.35	116,515,395.24	95.65
合计	26,637	99,070.51	386,893,283.62	14.66	2,252,047,851.57	85.34

注：本表基金机构/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，比例的分母采用基金份额的合计数（即期末基金份额总额）

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	海通核心优势 A	24,299,739.14	0.9931
	海通核心优势 B	645,090.18	0.9173
	海通核心优势 C	92,603.72	0.0760
	合计	25,037,433.04	0.9488

注：因四舍五入原因，持有份额总数占基金总份额比例的分项之和与合计可能存在尾差。

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	海通核心优势 A	>100
	海通核心优势 B	50~100
	海通核心优势 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	海通核心优势 A	>100
	海通核心优势 B	-
	海通核心优势 C	-
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海通核心优势 A	海通核心优势 B	海通核心优势 C
基金合同生效日（2020 年 4	-	72,102,254.55	-

月 8 日) 基金份额总额			
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	2, 446, 797, 030. 60	-	121, 815, 437. 33
减: 基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	-	1, 773, 587. 29	-
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-	-
本报告期末基金份额总额	2, 446, 797, 030. 60	70, 328, 667. 26	121, 815, 437. 33

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金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

本报告期内, 集合计划管理人、托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本集合计划本报告期内无涉及基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内集合计划管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 集合计划管理人、集合计划托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	766,018,591.44	100.00%	102,999.70	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	434,491,147.60	100.00%	4,269,828,000.00	100.00%	-	-

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	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划暂停申购（赎回、转换、定期定额投资）业务的公告	证券时报及公司网站	2020 年 4 月 8 日
2	海通新兴成长集合资产管理计划正式变更为海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划及合同生效的公告	证券时报及公司网站	2020 年 4 月 8 日
3	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划份额折算结果公告	证券时报及公司网站	2020 年 4 月 10 日
4	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	证券时报及公司网站	2020 年 4 月 28 日
5	上海海通证券资产管理有限公司关于海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划 A 类份额参加部分代销机构申购费率优惠活动的公告	证券时报及公司网站	2020 年 5 月 7 日
6	上海海通证券资产管理有限公司关于旗下海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划增加部分渠道为代理销售机构的公告	证券时报及公司网站	2020 年 5 月 7 日
7	关于海通核心优势一年持有期混合型	证券时报及公司网站	2020 年 5 月 12 日

	集合资产管理计划参与直销渠道开展申购费率优惠活动的公告		
8	上海海通证券资产管理有限公司关于旗下海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划新增大同证券有限责任公司为代理销售机构的公告	证券时报及公司网站	2020 年 5 月 19 日
9	关于海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划管理人固有资金参与的公告	证券时报及公司网站	2020 年 5 月 27 日
10	上海海通证券资产管理有限公司关于旗下海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划新增中国建设银行股份有限公司为代理销售机构的公告	证券时报及公司网站	2020 年 6 月 9 日
11	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划节假日暂停申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告	证券时报及公司网站	2020 年 6 月 22 日
12	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划节假日暂停申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告	证券时报及公司网站	2020 年 6 月 30 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况,由此可能导致的特有风险主要包括: 1、当基金份额持有人占比过于集中时,可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险; 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请,基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。 3、若个别投资者大额赎回后,可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于 5000 万元的风险,基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

4、其他可能的风险。

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）《关于准予海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划合同变更的回函》
- （二）《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- （三）《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书》；
- （四）《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议》；
- （五）本报告期内在中国证监会规定报纸上公开披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.htsamc.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金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

2020 年 8 月 31 日