

海通量化价值精选一年持有期混合型集合 资产管理计划 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 27 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 2021 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 2021 年 2 月 24 日起至 2021 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	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
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	12
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	12
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	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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
§ 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	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52

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	52
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	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 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	116,184,327.81 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	35,967,893.02 份	77,424,034.49 份	2,792,400.30 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	李井伟	余宏伟
	联系电话	021-23219938	(021)68499557
	电子邮箱	htam@htsec.com	yuhongwei1@sh.icbc.com.cn
客户服务电话		95553、4008888001	58885888
传真		021-63410460	(010)82918465
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	上海市浦东新区浦东大道 9 号

邮政编码	200001	200120
法定代表人	裴长江	王顺

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(2021年2月24日(基金合同生效日)-2021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	550,781.59	2,850,794.56	38,276.66
本期利润	1,497,341.65	-4,104,553.18	106,128.85
加权平均基 金份额本期 利润	0.1083	-0.0530	0.0969
本期加权平 均净值利润 率	8.96%	-4.42%	8.03%
本期基金份 额净值增长 率	-1.67%	-1.66%	-1.77%
3.1.2 期末 数据和指标	报告期末(2021年6月30日)		

期末可供分配利润	6,553,618.41	18,230,073.56	505,651.68
期末可供分配基金份额利润	0.1822	0.2355	0.1811
期末基金资产净值	44,431,991.02	95,654,108.05	3,445,993.43
期末基金份额净值	1.2353	1.2355	1.2341
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	-1.67%	-1.66%	-1.77%

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)。

4、本财务报表的实际编制期间为2021年2月24日(合同生效日)至2021年6月30日。

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	0.37%	0.76%	-1.60%	0.64%	1.97%	0.12%
过去三个月	4.70%	0.84%	2.84%	0.78%	1.86%	0.06%
自基金合同生效起至今	-1.67%	1.07%	-3.03%	0.98%	1.36%	0.09%

海通量化价值精选 B

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

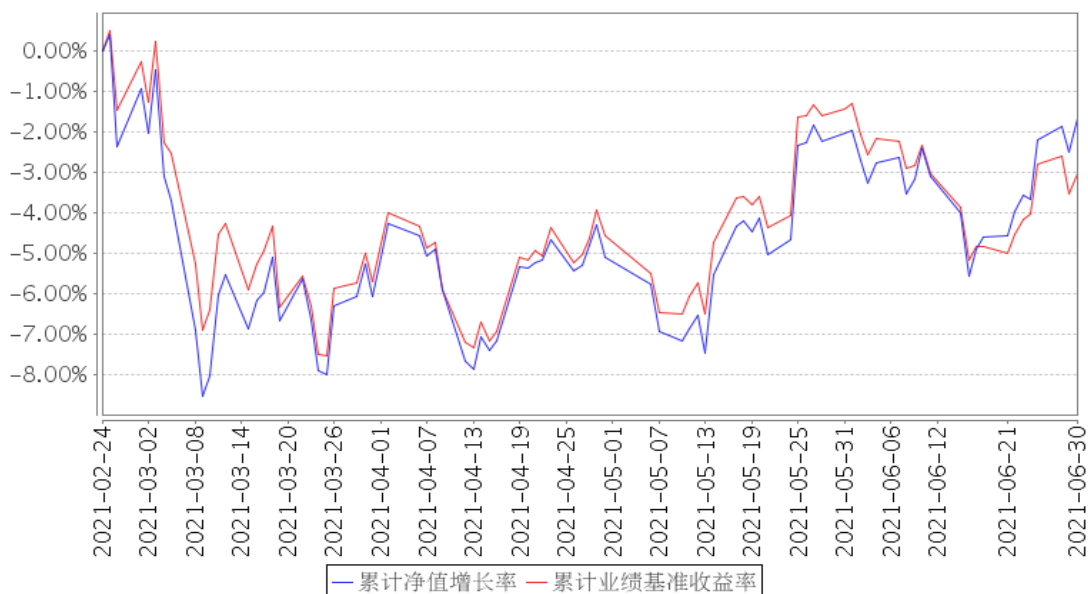
	率①	准差②		④		
过去一个月	0.38%	0.76%	-1.60%	0.64%	1.98%	0.12%
过去三个月	4.72%	0.84%	2.84%	0.78%	1.88%	0.06%
自基金合同生效起 至今	-1.66%	1.07%	-3.03%	0.98%	1.37%	0.09%

海通量化价值精选 C

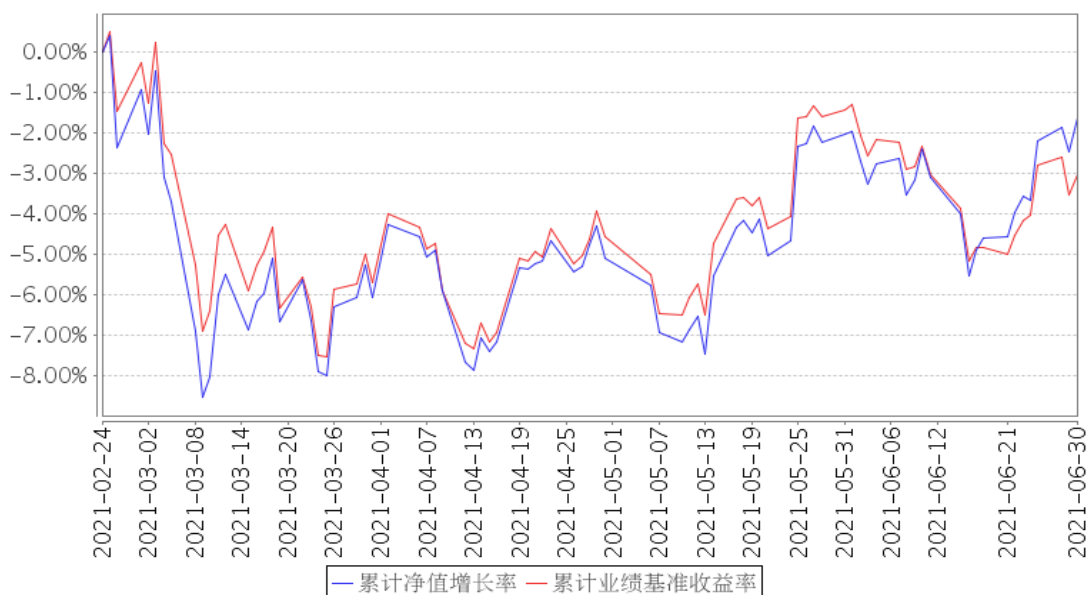
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标准 差④	①-③	②-④
过去一个月	0.33%	0.76%	-1.60%	0.64%	1.93%	0.12%
过去三个月	4.57%	0.84%	2.84%	0.78%	1.73%	0.06%
自基金合同生效起 至今	-1.77%	1.07%	-3.03%	0.98%	1.26%	0.09%

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

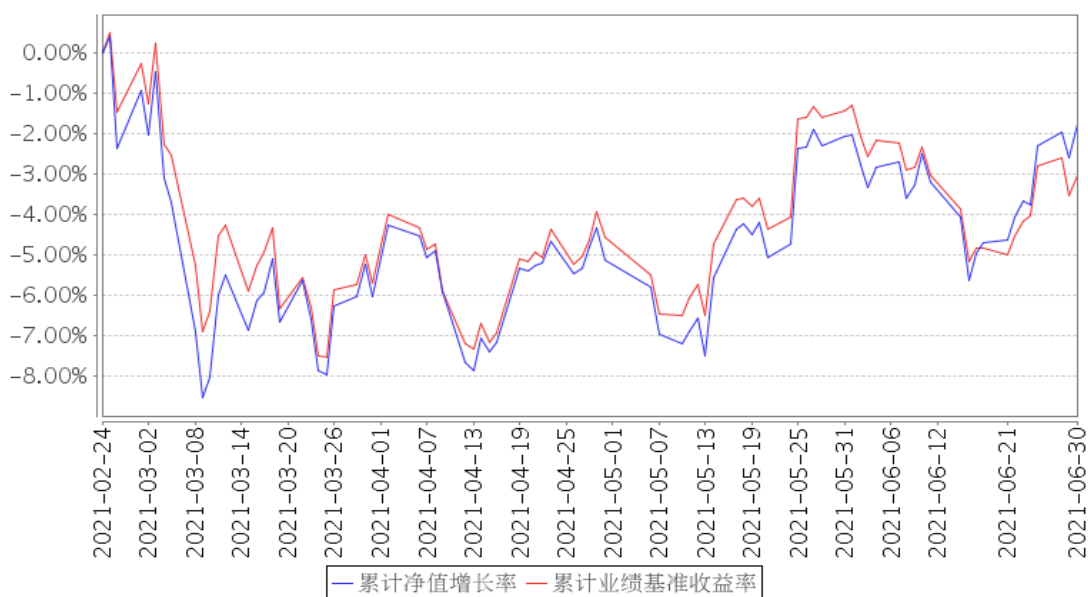
海通量化价值精选A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



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 2021 年 6 月 30 日，本集合计划管理人共管理 3 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、海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划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。

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	总经理助理，投资经理	2021 年 2 月 24 日	-	18 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。
朱蓓	投资经理	2021 年 2 月 24 日	-	13 年	朱蓓女士：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投资经理。曾任华富基金基金经理、平安资管投资经理助理。

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
胡倩	公募基金	1	143,532,092.50	2021 年 2 月 24 日
	私募资产管理计划	3	162,442,324.08	2015 年 6 月 24 日
	其他组合	-	-	-
	合计	4	305,974,416.58	-
朱蓓	公募基金	1	143,532,092.50	2021 年 2 月 24 日
	私募资产管理计划	2	109,808,157.65	2018 年 1 月 29 日
	其他组合	-	-	-
	合计	3	253,340,250.15	-

注：以上兼任“私募资产管理计划”仅为人数不受 200 人限制且待公募化改造的集合资产管理计划。

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

国内 6 月制造业和非制造业 PMI 均环比回落，国内经济将延续复苏态势，但复苏速度逐渐放缓。全年季度增速呈现前高后低的态势，PPI 或已处于周期顶部，后续将逐渐回落。CPI 温和走强，但整体通胀风险可控。海外市场，全球经济加速复苏，但地区恢复不均衡。欧美地区经济复苏快于其他发展中国家，从而导致大宗商品供需错配，随着对疫情的控制，这种高通胀压力有望在下半年得到缓解。

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。

4.4.2 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 1.2353 元，B 份额净值为 1.2355 元，C 份额净值为 1.2341 元。本报告期集合计划三类份额净值增长率分别为：4.7%，4.72%，4.57%，业绩比较基准收益率为 2.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度风险资产表现好于避险资产，我们预计三季度市场将延续这种状态，权益市场、大宗商品的整体收益好于债券市场与贵金属。A 股方面，我们预计未来市场会继续保持宽幅震荡走势，成长股风格及高景气产业链表现会优于整体市场。

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

本报告期内，本集合计划于 2021 年 2 月 24 日至 2021 年 3 月 23 日出现了基金份额持有人数量不满两百人的情形。

§ 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 2021 年半年度报告中财务指标、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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年6月30日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	11,692,984.99
结算备付金		2,640,329.53
存出保证金		385,039.97
交易性金融资产	6.4.7.2	128,979,638.20
其中：股票投资		128,979,638.20
基金投资		-
债券投资		-
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	-
应收证券清算款		143,424.87
应收利息	6.4.7.5	2,977.89
应收股利		86,299.04
应收申购款		9,994.87
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		143,940,689.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021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		0.73
应付赎回款		-
应付管理人报酬		84,807.22
应付托管费		17,351.57
应付销售服务费		1,384.53
应付交易费用	6.4.7.7	1,729.73
应交税费		249,856.67
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	53,466.41
负债合计		408,596.86
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	116,184,327.81

未分配利润	6.4.7.10	27,347,764.69
所有者权益合计		143,532,092.50
负债和所有者权益总计		143,940,689.36

注：（1）报告截止日 2021 年 6 月 30 日，集合计划份额总额 116,184,327.81 份，其中海通量化价值精选 A 份额净值（暂估业绩报酬前）1.2353 元，份额总额 35,967,893.02 份，资产净值（暂估业绩报酬前）44,431,991.02 元，于 2021 年 6 月 30 日，相关暂估业绩报酬余额为 212,228.78 元，资产净值（暂估业绩报酬后）44,219,762.24 元；海通量化价值精选 B 份额净值（暂估业绩报酬前）1.2355 元，份额总额 77,424,034.49 份，资产净值（暂估业绩报酬前）95,654,108.05 元，于 2021 年 6 月 30 日，相关暂估业绩报酬余额为 1,708,193.58 元，资产净值（暂估业绩报酬后）93,945,914.47 元；海通量化价值精选 C 份额净值（暂估业绩报酬前）1.2341 元，份额总额 2,792,400.30 份，资产净值（暂估业绩报酬前）3,445,993.43 元，于 2021 年 6 月 30 日，相关暂估业绩报酬余额为 14,115.70 元，资产净值（暂估业绩报酬后）3,431,877.73 元。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。

（2）本财务报表的实际编制期间为 2021 年 2 月 24 日（合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日。

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：2021 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2021 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		-1,894,538.83
1. 利息收入		22,677.00
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,172.32
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		7,504.68
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,023,454.87
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,896,254.20
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	230,874.28
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	896,326.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-5,940,935.49
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	264.79
减：二、费用		606,543.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	276,368.78
2. 托管费	6.4.10.2.2	57,837.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,306.74
4. 交易费用	6.4.7.19	207,286.47
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		10,453.53
7. 其他费用	6.4.7.20	52,290.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,501,082.68
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,501,082.68

6.3 所有者权益（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：2021 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2021 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）	77,523,307.45	22,350,469.75	99,873,777.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,501,082.68	-2,501,082.68
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）	38,661,020.36	7,498,377.62	46,159,397.98
其中：1. 基金申购款	38,760,293.32	7,514,220.63	46,274,513.95
2. 基金赎回款	-99,272.96	-15,843.01	-115,115.97
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）	116,184,327.81	27,347,764.69	143,532,092.50

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：

<u>李井伟</u>	<u>陈颖</u>	<u>刘雯</u>
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”）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》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。

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〉》、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

本集合计划 2021 年 2 月 24 日（计划合同生效日）至 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 2 月 24 日（计划合同生效日）至 2021 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 2021 年 2 月 24 日（计划合同生效日）至 2021 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（包括管理费和业绩报酬）、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按资产管理合同约定的费率和计算方法逐日确认，其中业绩报酬于相应的集合计划赎回确认日按投资者赎回申请的集合计划实际收益情况计算确认，未达到支付条件的暂估业绩报酬不计入当期收益。

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。

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收益分配条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，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该类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；因红利再投资转换的份额类别，与集合计划份额持有人在收益分配基准日持有的份额同属一个类别；如集合计划份额持有人持有多个类别份额的，则根据不同类别收益分配方案分别计算该类别红利再投资份额；如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，其最短持有期限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 类份额、B 类份额不收取销售服务费，C 类份额收取销售服务费，各类别集合计划份额对应的可分配收益将有所不同，本集合计划同一类别的每一份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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	11,692,984.99
定期存款	-
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	-
合计	11,692,984.99

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	120,697,132.81	128,979,638.20	8,282,505.39
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	120,697,132.81	128,979,638.20	8,282,505.39

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	2,530,440.00	-	-	
其中：股指期货投资	2,530,440.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	2,530,440.00	-	-	

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。

本期末 2021 年 6 月 30 日股指期货投资具体如下：

项目	持仓量（买/卖）	合约名义金额（元）	合约市值（元）	公允价值变动（元）
IC2112	2	2,530,440.00	2,608,480.00	78,040.00

总额合计：78,040.00 元

减：可抵销期货暂收款：78,040.00 元

股指期货投资净额：0.00 元

买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,097.60
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,871.39
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
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	8.90
合计	2,977.89

注：其他为应收结算保证金利息。

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 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,729.73
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,729.73

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	53,466.41
合计	53,466.41

6.4.7.9 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 2021 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2021 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	35,967,893.02	35,967,893.02
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	35,967,893.02	35,967,893.02

海通量化价值精选 B

项目	本期 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	77,523,307.45	77,523,307.45
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-99,272.96	-99,272.96
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	77,424,034.49	77,424,034.49

海通量化价值精选 C

项目	本期 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021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	2,792,400.30	2,792,400.30
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	2,792,400.30	2,792,400.30

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

6.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	550,781.59	946,560.06	1,497,341.65
本期基金份额交易产生的变	6,002,836.82	963,919.53	6,966,756.35

动数			
其中：基金申购款	6,002,836.82	963,919.53	6,966,756.35
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,553,618.41	1,910,479.59	8,464,098.00

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
基金合同生效日	17,335,149.95	5,015,319.80	22,350,469.75
本期利润	2,850,794.56	-6,955,347.74	-4,104,553.18
本期基金份额交易产生的变动数	-23,510.43	7,667.42	-15,843.01
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-23,510.43	7,667.42	-15,843.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,162,434.08	-1,932,360.52	18,230,073.56

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	38,276.66	67,852.19	106,128.85
本期基金份额交易产生的变动数	467,375.02	80,089.26	547,464.28
其中：基金申购款	467,375.02	80,089.26	547,464.28
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	505,651.68	147,941.45	653,593.13

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年6月30日
活期存款利息收入	10,973.28

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	4,102.30
其他	96.74
合计	15,172.32

注：其他为结算保证金利息收入。

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

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 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出股票成交总额	135,201,043.53
减：卖出股票成本总额	132,304,789.33
买卖股票差价收入	2,896,254.20

6.4.7.12.3 股票投资收益——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

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 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	325,256.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	51,724.62
减：应收利息总额	42,657.50
买卖债券差价收入	230,874.28

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

6.4.7.13.4 债券投资收益——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

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——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

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——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未产生衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	896,326.39
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	896,326.39

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-6,197,203.56
股票投资	-6,197,203.56
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	78,040.00
权证投资	-
期货	78,040.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-178,228.07
合计	-5,940,935.49

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年6月30日
基金赎回费收入	264.79
合计	264.79

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年6月30日
交易所市场交易费用	207,286.47
银行间市场交易费用	-
合计	207,286.47

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年6月30日
审计费用	3,131.82
信息披露费	49,002.95
证券出借违约金	-
银行费用	156.00
合计	52,290.77

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
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 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021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	312,270,570.83	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 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021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	325,256.40	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 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021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	14,400,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本集合计划本报告期末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 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021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	38,563.83	100.00	1,729.73	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 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	80,580.11

注：1. 本集合计划本期共发生应支付的固定管理费 276,176.01 元（其中 A 类份额 46,447.62 元，B 类份额 226,037.70 元，C 类份额 3,690.69 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 192.77 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：

$$\text{当年化收益率 } R \geq 8\% = \text{每笔参与份额在上一个业绩报酬计提日的资产净值总额} \times (\text{年化收益率}$$

$R-8.0\%)*20\%$ *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
	2021 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	57,837.56

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			
	2021 年 2 月 24 日（基金合同生效日）至 2021 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	海通量化价值精选	海通量化价值精选	合计
	A	B	C	
工商银行	-	-	0.00	0.00
海通证券	-	-	2,304.17	2,304.17

海通资管	-	-	1.91	1.91
合计	-	-	2,306.08	2,306.08

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：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H为C类份额每日应计提的销售服务费

E为C类份额前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本集合计划本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

注：本集合计划本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期	本期
	2021年2月24日(基金合同生效日)至2021年6月30日	2021年2月24日(基金合同生效日)至2021年6月30日	2021年2月24日(基金合同生效日)至2021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	0.00	15,279,736.72	0.00
报告期初持有的基	0.00	15,279,736.72	0.00

金份额			
报告期间申购/买入 总份额	0.00	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	0.00	15,279,736.72	0.00
报告期末持有的基 金份额 占基金总份额比例	0.0000%	19.7351%	0.0000%

注：本表报告期末持有的基金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 A

关联方名称	本期末 2021 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	0.0000

份额单位：份

海通量化价值精选 B

关联方名称	本期末 2021 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	60.9201

份额单位：份

海通量化价值精选 C

关联方名称	本期末 2021 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	0.0000

注：本表持有的基金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 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	11,692,984.99	10,973.28

6.4.10.7 本基金在承销期内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进行利润分配。

6.4.12 期末(2021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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	105	3,313.80	3,313.80	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	665	14,603.40	14,603.40	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股未上市	11.48	11.48	1,233	14,154.84	14,154.84	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021年6月16日	重大事项停牌	5.59	2021年7月6日	6.15	13,300	93,078.00	74,347.00	-
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	11,100	438,373.00	625,485.00	-

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因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。

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因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。

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

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。

本基金持有银行存款、结算备付金、存出保证金等利率敏感性资产,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 2021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	11,692,984.99	-	-	-	11,692,984.99
结算备付金	2,640,329.53	-	-	-	2,640,329.53
存出保证金	385,039.97	-	-	-	385,039.97
交易性金融资产	-	-	-	128,979,638.20	128,979,638.20
应收利息	-	-	-	2,977.89	2,977.89
应收股利	-	-	-	86,299.04	86,299.04
应收申购款	-	-	-	9,994.87	9,994.87
应收证券清算款	-	-	-	143,424.87	143,424.87
资产总计	14,718,354.49	-	-	129,222,334.87	143,940,689.36

负债					
应付管理人报酬	-	-	-	84,807.22	84,807.22
应付托管费	-	-	-	17,351.57	17,351.57
应付证券清算款	-	-	-	0.73	0.73
应付销售服务费	-	-	-	1,384.53	1,384.53
应付交易费用	-	-	-	1,729.73	1,729.73
应交税费	-	-	-	249,856.67	249,856.67
其他负债	-	-	-	53,466.41	53,466.41
负债总计	-	-	-	408,596.86	408,596.86
利率敏感度缺口	14,718,354.49	-	-	-128,813,738.01	143,532,092.50

注：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

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 2021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	-	3,312,949.81	-	3,312,949.81
资产合计	-	3,312,949.81	-	3,312,949.81
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	3,312,949.81	-	3,312,949.81

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（2021年6月30日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	165,647.49
	所有外币相对人民币贬值 5%	-165,647.49

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 2021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	128,979,638.20	89.86
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	128,979,638.20	89.86

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（2021年6月30日）
分析	股票价格上升 5%	6,448,981.91
	股票价格下降 5%	-6,448,981.91

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 2021 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 128,247,734.16 元，第二层次的余额为人民币 731,904.04 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 2021 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	128,979,638.20	89.61
	其中:股票	128,979,638.20	89.61
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	14,333,314.52	9.96
8	其他各项资产	627,736.64	0.44
9	合计	143,940,689.36	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 3,312,949.81 元,占资产净值比例为 2.31%。

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	529,620.56	0.37
B	采矿业	1,862,325.40	1.30
C	制造业	78,378,270.62	54.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,501,067.46	1.05
E	建筑业	2,037,467.80	1.42
F	批发和零售业	859,519.59	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	2,302,509.00	1.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服	2,894,886.72	2.02

	务业		
J	金融业	24,745,120.20	17.24
K	房地产业	1,009,167.00	0.70
L	租赁和商务服务业	3,623,850.30	2.52
M	科学研究和技术服务业	1,340,410.40	0.93
N	水利、环境和公共设施管理业	230,583.00	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,285,686.34	2.29
R	文化、体育和娱乐业	1,066,204.00	0.74
S	综合	-	-
	合计	125,666,688.39	87.55

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（%）
通信服务	-	-
非日常生活消费品	292,392.91	0.20
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	2,385,147.33	1.66
医疗保健	-	-
工业	635,409.57	0.44
信息技术	-	-
原材料	-	-
房地产	-	-
公用事业	-	-
合计	3,312,949.81	2.31

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	3,300	6,787,110.00	4.73
2	600036	招商银行	94,400	5,115,536.00	3.56
3	000858	五粮液	16,100	4,796,029.00	3.34
4	601318	中国平安	74,200	4,769,576.00	3.32
5	601888	中国中免	10,053	3,016,905.30	2.10
6	000333	美的集团	36,300	2,590,731.00	1.81
7	300059	东方财富	76,646	2,513,222.34	1.75
8	601166	兴业银行	120,200	2,470,110.00	1.72

9	601012	隆基股份	23,940	2,126,829.60	1.48
10	002179	中航光电	26,700	2,109,834.00	1.47
11	600887	伊利股份	50,400	1,856,232.00	1.29
12	000651	格力电器	33,600	1,750,560.00	1.22
13	000001	平安银行	75,400	1,705,548.00	1.19
14	603659	璞泰来	12,200	1,666,520.00	1.16
15	300124	汇川技术	21,700	1,611,442.00	1.12
16	000568	泸州老窖	6,800	1,604,392.00	1.12
17	002415	海康威视	23,700	1,528,650.00	1.07
18	688396	华润微	15,000	1,365,300.00	0.95
19	603259	药明康德	8,560	1,340,410.40	0.93
20	601100	恒立液压	14,956	1,285,019.52	0.90
21	600309	万华化学	11,100	1,207,902.00	0.84
22	603501	韦尔股份	3,700	1,191,400.00	0.83
23	600809	山西汾酒	2,600	1,164,800.00	0.81
24	601919	中远海控	37,800	1,154,412.00	0.80
25	600426	华鲁恒升	36,210	1,120,699.50	0.78
26	600763	通策医疗	2,700	1,109,700.00	0.77
27	600030	中信证券	41,400	1,032,516.00	0.72
28	300015	爱尔眼科	14,133	1,003,160.34	0.70
29	000661	长春高新	2,500	967,500.00	0.67
30	002812	恩捷股份	3,700	866,170.00	0.60
31	603392	万泰生物	3,280	850,110.40	0.59
32	603833	欧派家居	5,963	846,507.48	0.59
33	601211	国泰君安	49,200	843,288.00	0.59
34	603799	华友钴业	7,300	833,660.00	0.58
35	300595	欧普康视	8,020	830,471.00	0.58
36	300122	智飞生物	4,300	802,939.00	0.56
37	000786	北新建材	20,400	800,700.00	0.56
38	603517	绝味食品	9,200	775,468.00	0.54
39	002138	顺络电子	20,000	775,400.00	0.54
40	002460	赣锋锂业	6,400	774,976.00	0.54
41	002311	海大集团	9,400	767,040.00	0.53
42	603882	金域医学	4,800	766,896.00	0.53
43	300413	芒果超媒	11,000	754,600.00	0.53
44	002230	科大讯飞	11,134	752,435.72	0.52
45	000100	TCL 科技	96,800	740,520.00	0.52
46	600132	重庆啤酒	3,700	732,415.00	0.51
47	600760	中航沈飞	12,076	728,182.80	0.51
48	01336	新华保险	32,000	705,603.84	0.49
49	000063	中兴通讯	20,700	687,861.00	0.48
50	603369	今世缘	12,400	671,584.00	0.47

51	600176	中国巨石	43,262	670,993.62	0.47
52	603260	合盛硅业	8,703	669,347.73	0.47
53	300562	乐心医疗	45,000	668,250.00	0.47
54	601799	星宇股份	2,900	654,588.00	0.46
55	000733	振华科技	10,700	653,449.00	0.46
56	000157	中联重科	70,000	646,800.00	0.45
57	300408	三环集团	15,100	640,542.00	0.45
58	688111	金山办公	1,600	631,680.00	0.44
59	000776	广发证券	41,700	631,338.00	0.44
60	600460	士兰微	11,100	625,485.00	0.44
61	002648	卫星石化	15,820	619,985.80	0.43
62	002008	大族激光	15,300	617,967.00	0.43
63	002027	分众传媒	64,500	606,945.00	0.42
64	600862	中航高科	19,400	597,132.00	0.42
65	601126	四方股份	65,400	585,330.00	0.41
66	002736	国信证券	53,500	575,125.00	0.40
67	002049	紫光国微	3,600	555,084.00	0.39
68	600399	抚顺特钢	30,600	555,084.00	0.39
69	600406	国电南瑞	23,760	552,182.40	0.38
70	600104	上汽集团	25,000	549,250.00	0.38
71	601688	华泰证券	34,000	537,200.00	0.37
72	002714	牧原股份	8,708	529,620.56	0.37
73	002414	高德红外	18,926	521,979.08	0.36
74	600276	恒瑞医药	7,605	516,911.85	0.36
75	600000	浦发银行	50,800	508,000.00	0.35
76	600028	中国石化	115,900	505,324.00	0.35
77	000596	古井贡酒	2,100	502,950.00	0.35
78	603806	福斯特	4,760	500,418.80	0.35
79	600061	国投资本	58,368	495,544.32	0.35
80	000425	徐工机械	77,100	491,127.00	0.34
81	603195	公牛集团	2,400	484,800.00	0.34
82	601998	中信银行	93,600	477,360.00	0.33
83	02628	中国人寿	37,000	474,119.18	0.33
84	06806	申万宏源	269,600	466,603.84	0.33
85	000830	鲁西化工	24,800	464,504.00	0.32
86	601899	紫金矿业	47,800	463,182.00	0.32
87	600741	华域汽车	17,600	462,352.00	0.32
88	300014	亿纬锂能	4,400	457,292.00	0.32
89	603986	兆易创新	2,420	454,718.00	0.32
90	600031	三一重工	15,500	450,585.00	0.31
91	06099	招商证券	49,600	445,728.61	0.31
92	601377	兴业证券	45,900	443,394.00	0.31

93	600600	青岛啤酒	3,800	439,470.00	0.31
94	002508	老板电器	9,300	432,450.00	0.30
95	603108	润达医疗	38,400	431,232.00	0.30
96	002533	金杯电工	83,100	427,134.00	0.30
97	600011	华能国际	101,000	426,220.00	0.30
98	601669	中国电建	109,100	422,217.00	0.29
99	600019	宝钢股份	54,200	414,088.00	0.29
100	600522	中天科技	41,244	412,440.00	0.29
101	601985	中国核电	81,400	411,884.00	0.29
102	601390	中国中铁	78,500	411,340.00	0.29
103	600015	华夏银行	66,300	410,397.00	0.29
104	601186	中国铁建	55,200	410,136.00	0.29
105	300347	泰格医药	2,100	405,930.00	0.28
106	601668	中国建筑	87,200	405,480.00	0.28
107	601006	大秦铁路	61,500	404,670.00	0.28
108	000783	长江证券	53,000	387,960.00	0.27
109	002142	宁波银行	9,900	385,803.00	0.27
110	300529	健帆生物	4,400	379,984.00	0.26
111	300146	汤臣倍健	11,500	378,350.00	0.26
112	01800	中国交通建设	118,000	370,159.11	0.26
113	601966	玲珑轮胎	8,453	369,734.22	0.26
114	600039	四川路桥	58,300	365,541.00	0.25
115	000708	中信特钢	17,350	361,574.00	0.25
116	601168	西部矿业	30,200	360,286.00	0.25
117	600660	福耀玻璃	6,300	351,855.00	0.25
118	000002	万科A	14,700	350,007.00	0.24
119	601155	新城控股	8,100	336,960.00	0.23
120	600563	法拉电子	2,100	332,556.00	0.23
121	600111	北方稀土	15,700	324,990.00	0.23
122	601225	陕西煤业	27,200	322,320.00	0.22
123	600848	上海临港	18,000	322,200.00	0.22
124	600018	上港集团	67,300	321,021.00	0.22
125	603486	科沃斯	1,400	319,312.00	0.22
126	600570	恒生电子	3,400	317,050.00	0.22
127	002709	天赐材料	2,900	309,082.00	0.22
128	600332	白云山	9,000	304,650.00	0.21
129	300033	同花顺	2,700	304,506.00	0.21
130	300535	达威股份	22,200	301,032.00	0.21
131	002406	远东传动	46,100	296,423.00	0.21
132	600377	宁沪高速	30,100	293,776.00	0.20
133	01339	中国人民保险 集团	136,000	293,091.86	0.20

134	02333	长城汽车	14,000	292,392.91	0.20
135	603638	艾迪精密	6,720	288,086.40	0.20
136	601138	工业富联	23,100	286,671.00	0.20
137	300142	沃森生物	4,600	283,820.00	0.20
138	300601	康泰生物	1,900	283,100.00	0.20
139	603338	浙江鼎力	4,820	282,885.80	0.20
140	601086	国芳集团	72,400	280,912.00	0.20
141	002718	友邦吊顶	20,350	280,830.00	0.20
142	600973	宝胜股份	68,000	280,160.00	0.20
143	688208	道通科技	3,200	278,368.00	0.19
144	600168	武汉控股	41,253	273,094.86	0.19
145	601636	旗滨集团	14,700	272,832.00	0.19
146	601601	中国太保	9,300	269,421.00	0.19
147	300628	亿联网络	3,200	268,160.00	0.19
148	601077	渝农商行	66,800	266,532.00	0.19
149	02727	上海电气	154,000	265,250.46	0.18
150	002241	歌尔股份	6,200	264,988.00	0.18
151	002028	思源电气	8,600	264,794.00	0.18
152	600989	宝丰能源	19,300	264,024.00	0.18
153	600588	用友网络	7,900	262,754.00	0.18
154	002821	凯莱英	700	260,820.00	0.18
155	688169	石头科技	200	252,200.00	0.18
156	603589	口子窖	3,700	250,453.00	0.17
157	603899	晨光文具	2,900	245,224.00	0.17
158	002281	光迅科技	9,900	243,540.00	0.17
159	601009	南京银行	23,100	243,012.00	0.17
160	600398	海澜之家	33,500	242,540.00	0.17
161	600845	宝信软件	4,680	238,212.00	0.17
162	603568	伟明环保	10,100	230,583.00	0.16
163	601928	凤凰传媒	31,700	226,338.00	0.16
164	002601	龙佰集团	6,400	221,312.00	0.15
165	600905	三峡能源	33,000	209,880.00	0.15
166	002271	东方雨虹	3,700	204,684.00	0.14
167	000807	云铝股份	16,100	191,590.00	0.13
168	002389	航天彩虹	7,500	163,725.00	0.11
169	002475	立讯精密	3,200	147,200.00	0.10
170	002304	洋河股份	700	145,040.00	0.10
171	601169	北京银行	29,000	141,230.00	0.10
172	002410	广联达	2,000	136,400.00	0.10
173	600893	航发动力	2,500	132,975.00	0.09
174	601857	中国石油	24,700	130,663.00	0.09
175	603288	海天味业	1,000	128,950.00	0.09

176	002352	顺丰控股	1,900	128,630.00	0.09
177	688002	睿创微纳	1,275	127,283.25	0.09
178	000878	云南铜业	9,700	124,451.00	0.09
179	601628	中国人寿	3,200	108,448.00	0.08
180	600438	通威股份	2,300	99,521.00	0.07
181	002600	领益智造	10,700	98,333.00	0.07
182	002050	三花智控	4,100	98,318.00	0.07
183	002129	中环股份	2,500	96,500.00	0.07
184	002013	中航机电	9,300	93,651.00	0.07
185	600183	生益科技	4,000	93,640.00	0.07
186	601600	中国铝业	17,400	92,220.00	0.06
187	601727	上海电气	21,700	92,008.00	0.06
188	000338	潍柴动力	5,100	91,137.00	0.06
189	600795	国电电力	37,500	91,125.00	0.06
190	000725	京东方A	14,300	89,232.00	0.06
191	003816	中国广核	32,800	87,576.00	0.06
192	000977	浪潮信息	3,100	87,203.00	0.06
193	688012	中微公司	517	85,780.64	0.06
194	002739	万达电影	5,400	85,266.00	0.06
195	300136	信维通信	2,700	83,376.00	0.06
196	002371	北方华创	300	83,214.00	0.06
197	002032	苏泊尔	1,300	82,927.00	0.06
198	000800	一汽解放	7,500	81,150.00	0.06
199	600489	中金黄金	9,300	80,166.00	0.06
200	601766	中国中车	13,100	79,648.00	0.06
201	600362	江西铜业	3,500	78,330.00	0.05
202	002024	苏宁易购	13,300	74,347.00	0.05
203	600655	豫园股份	6,301	73,028.59	0.05
204	688161	威高骨科	532	56,418.60	0.04
205	601336	新华保险	900	41,319.00	0.03
206	000166	申万宏源	5,835	27,307.80	0.02
207	600999	招商证券	1,300	24,726.00	0.02
208	601800	中国交建	3,000	19,440.00	0.01
209	601633	长城汽车	400	17,436.00	0.01
210	601319	中国人保	2,800	16,604.00	0.01
211	688087	英科再生	665	14,603.40	0.01
212	688239	航宇科技	1,233	14,154.84	0.01
213	605287	德才股份	105	3,313.80	0.00
214	603171	税友股份	148	2,841.60	0.00
215	603039	泛微网络	20	1,331.00	0.00
216	605011	杭州热电	145	1,287.60	0.00
217	002001	新和成	40	1,147.20	0.00

218	600547	山东黄金	20	384.40	0.00
219	300056	中创环保	37	239.39	0.00
220	600177	雅戈尔	20	131.80	0.00
221	000703	恒逸石化	10	119.50	0.00
222	000848	承德露露	10	119.40	0.00
223	002945	华林证券	7	96.74	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	600519	贵州茅台	4,805,356.00	3.35
2	000858	五粮液	4,057,071.92	2.83
3	601318	中国平安	2,749,758.00	1.92
4	600036	招商银行	2,726,218.92	1.90
5	601888	中国中免	1,940,205.00	1.35
6	300059	东方财富	1,912,417.05	1.33
7	600887	伊利股份	1,732,727.00	1.21
8	000001	平安银行	1,728,407.17	1.20
9	300562	乐心医疗	1,646,282.00	1.15
10	601166	兴业银行	1,628,245.00	1.13
11	002179	中航光电	1,615,640.00	1.13
12	000568	泸州老窖	1,590,579.00	1.11
13	000651	格力电器	1,512,134.00	1.05
14	600031	三一重工	1,336,666.00	0.93
15	000333	美的集团	1,284,300.00	0.89
16	600309	万华化学	1,271,300.00	0.89
17	002415	海康威视	1,258,307.00	0.88
18	603659	璞泰来	1,221,591.80	0.85
19	000002	万科A	1,215,681.00	0.85
20	000661	长春高新	1,168,832.00	0.81

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	000807	云铝股份	1,900,603.00	1.32
2	600028	中国石化	1,783,819.00	1.24
3	600031	三一重工	1,663,067.00	1.16
4	601168	西部矿业	1,524,321.00	1.06
5	000878	云南铜业	1,385,384.00	0.97
6	002371	北方华创	1,338,259.00	0.93

7	600519	贵州茅台	1,224,105.00	0.85
8	000858	五粮液	1,181,049.00	0.82
9	601899	紫金矿业	1,131,431.00	0.79
10	600276	恒瑞医药	1,121,793.00	0.78
11	300059	东方财富	1,076,200.59	0.75
12	603259	药明康德	1,058,017.00	0.74
13	600760	中航沈飞	1,038,955.00	0.72
14	601727	上海电气	1,034,746.00	0.72
15	300760	迈瑞医疗	1,008,594.00	0.70
16	300759	康龙化成	967,659.00	0.67
17	300676	华大基因	951,874.00	0.66
18	600900	长江电力	948,423.00	0.66
19	601117	中国化学	915,939.00	0.64
20	600763	通策医疗	912,405.00	0.64

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	177,069,527.30
卖出股票收入（成交）总额	135,201,043.53

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 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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2112	IC2112	2	2,608,480.00	78,040.00	-

公允价值变动总额合计（元）	78,040.00
股指期货投资本期收益（元）	-
股指期货投资本期公允价值变动（元）	78,040.00

7.10.2 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

本产品暂不涉及国债期货投资。

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

本产品暂不涉及国债期货投资。

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

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。

7.12.2 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	385,039.97
2	应收证券清算款	143,424.87
3	应收股利	86,299.04
4	应收利息	2,977.89
5	应收申购款	9,994.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	627,736.64

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	912	39,438.48	2,129,405.28	5.92	33,838,487.74	94.08
海通量化价值精选 B	105	737,371.76	71,475,736.72	92.32	5,948,297.77	7.68
海通量化价值精选 C	120	23,270.00	0.00	0.00	2,792,400.30	100.00
合计	1,137	102,184.98	73,605,142.00	63.35	42,579,185.81	36.65

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	116,535.56	0.32
	海通量化价值精选 B	277,246.06	0.36
	海通量化价值精选 C	876.39	0.03
	合计	394,658.01	0.34

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	0~10
	海通量化价值精选 B	10~50
	海通量化价值精选 C	-
	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	-
	海通量化价值精选 B	-
	海通量化价值精选 C	-
	合计	10~50

§ 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	-
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	35,967,893.02	-	2,792,400.30
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	-	99,272.96	-
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“-”	0.00	0.00	0.00

填列)			
本报告期末 基金份额总额	35,967,893.02	77,424,034.49	2,792,400.30

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无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

1、2021年5月21日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司第四届第十七次董事会审议通过，张士军先生自2021年5月20日起不再担任公司副总经理兼投资总监。

2、2021年5月21日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司第四届第十七次董事会审议通过，李雪女士自2021年5月20日起不再担任公司首席风险官兼合规总监。

3、本报告期内，基金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

基金投资策略未有重大变化

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，上海海通证券资产管理有限公司收到中国证券监督管理委员会上海证监局《关于对上海海通证券资产管理有限公司采取责令暂停部分业务措施的决定》，并对公司相关人员出具了监管措施。公司高度重视，按照法律法规相关要求梳理了相关业务流程，制定了整改措施，并抓紧落实整改工作。

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	312,270,570.83	100.00%	38,563.83	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	325,256.40	100.00%	14,400,000.00	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	海通稳健成长集合资产管理计划正式变更为海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划及合同生效的公告	中国证券报、证监会指定网站、公司网站	2021年2月24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开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	中国证券报、证监会指定网站、公司网站	2021年3月3日
3	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参与直销渠道开展申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证监会指定网站、公司网站	2021年3月5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开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告》更正公告	中国证券报、证监会指定网站、公司网站	2021年3月10日
5	上海海通证券资产管理有限公司关于增加北京植信基金销售有限公司为旗下部分集合资产管理计划代理销售机构的公告	中国证券报、证监会指定网站、公司网站	2021年4月13日
6	上海海通证券资产管理有限公司关于增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为旗下部分集合资产管理计划代理销售机构的公告	中国证券报、证监会指定网站、公司网站	2021年5月11日
7	上海海通证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	中国证券报、证监会指定网站、公司网站	2021年5月21日
8	上海海通证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	中国证券报、证监会指定网站、公司网站	2021年5月21日
9	上海海通证券资产管理有限公司关于增加南京苏宁基金销售有限公司为旗下部分集合资产管理计划代理销售机	中国证券报、证监会指定网站、公司网站	2021年6月7日

	构的公告		
10	上海海通证券资产管理有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下部分集合资产管理计划代理销售机构的公告	中国证券报、证监会指定网站、公司网站	2021 年 6 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

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	1	2021/2/24-2021/6/30	56,195,000.00	0.00	0.00	56,195,000.00	48.37
-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

报告期内，本集合计划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、当集合计划份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一集合计划份额持有人大额赎回而引发集合计划净值剧烈波动的风险；
- 2、若某单一集合计划份额持有人巨额赎回有可能引发集合计划的流动性风险，集合计划管理人可能无法及时变现集合计划资产以应对集合计划份额持有人的赎回申请，集合计划份额持有人可能无法及时赎回持有的全部集合计划份额。
- 3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致集合计划资产净值连续出现六十个工作日低于 5000 万元的风险，集合计划可能会面临转换运作方式、与其他集合计划合并或者终止集合计划合同等情形。
- 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) 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:95553

上海海通证券资产管理有限公司

2021年8月27日