

海通量化价值精选一年持有期混合型集合 资产管理计划 2022 年中期报告

2022 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：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

集合计划托管人中国工商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 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
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
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合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	55

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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 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	111,214,510.45 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	海通量化价值精选 A	海通量化价值精选 B	海通量化价值精选 C
下属分级基金的交易代码	850088	850004	850099
报告期末下属分级基金的份额总额	73,318,943.87 份	29,802,110.89 份	8,093,455.69 份

2.2 基金产品说明

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

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海海通证券资产管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴文然	余宏伟
	联系电话	021-23154762	021-68089632
	电子邮箱	htam@htsec.com	yuhongwei1@sh.icbc.com.cn
客户服务电话		95553、4008888001	95588
传真		021-63410460	010-66105798
注册地址		上海市广东路 689 号海通证券大厦 32 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市广东路 689 号海通证券大厦 32 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	200001	100140
法定代表人	裴长江	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.htsamc.com
基金中期报告备置地点	集合计划管理人及集合计划托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	报告期(2022 年 01 月 01 日-2022 年 06 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	-9,919,936.60	-3,854,674.78	-1,100,448.53
本期利润	-10,068,957.33	-3,762,852.29	-1,034,807.47
加权平均基 金份额本期 利润	-0.1324	-0.1261	-0.1268
本期加权平 均净值利润 率	-12.30%	-11.71%	-11.86%
本期基金份 额净值增长 率	-10.36%	-10.31%	-10.58%
3.1.2 期末 数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)		
期末可供分 配利润	6,603,213.73	2,849,379.09	678,456.08
期末可供分	0.0901	0.0956	0.0838

配基金份额利润			
期末基金资产净值	80,247,707.34	32,651,489.98	8,805,389.42
期末基金份额净值	1.0945	1.0956	1.0880
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	-12.88%	-12.79%	-13.40%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海通量化价值精选 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	7.14%	0.91%	7.65%	0.86%	-0.51%	0.05%
过去三个月	4.52%	1.31%	5.06%	1.15%	-0.54%	0.16%
过去六个月	-10.36%	1.35%	-7.23%	1.16%	-3.13%	0.19%
过去一年	-11.40%	1.15%	-11.16%	1.00%	-0.24%	0.15%
自基金合同生效起至今	-12.88%	1.13%	-13.85%	0.99%	0.97%	0.14%

海通量化价值精选 B

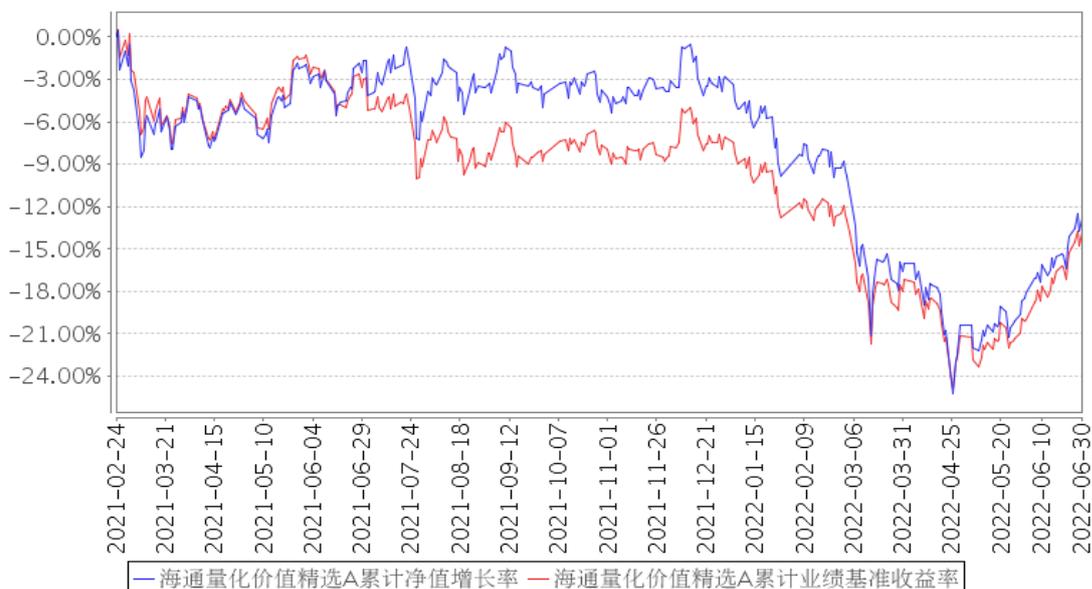
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.14%	0.91%	7.65%	0.86%	-0.51%	0.05%
过去三个月	4.54%	1.31%	5.06%	1.15%	-0.52%	0.16%
过去六个月	-10.31%	1.35%	-7.23%	1.16%	-3.08%	0.19%
过去一年	-11.32%	1.15%	-11.16%	1.00%	-0.16%	0.15%
自基金合同生效起至今	-12.79%	1.13%	-13.85%	0.99%	1.06%	0.14%

海通量化价值精选 C

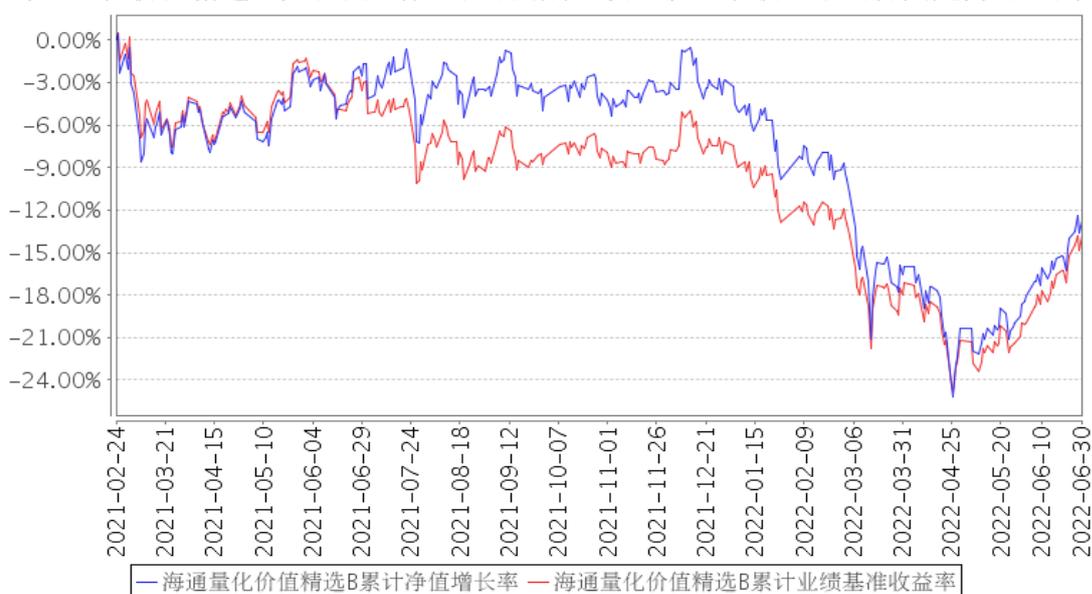
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	7.10%	0.91%	7.65%	0.86%	-0.55%	0.05%
过去三个月	4.38%	1.31%	5.06%	1.15%	-0.68%	0.16%
过去六个月	-10.58%	1.35%	-7.23%	1.16%	-3.35%	0.19%
过去一年	-11.84%	1.15%	-11.16%	1.00%	-0.68%	0.15%
自基金合同生效起至今	-13.40%	1.13%	-13.85%	0.99%	0.45%	0.14%

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

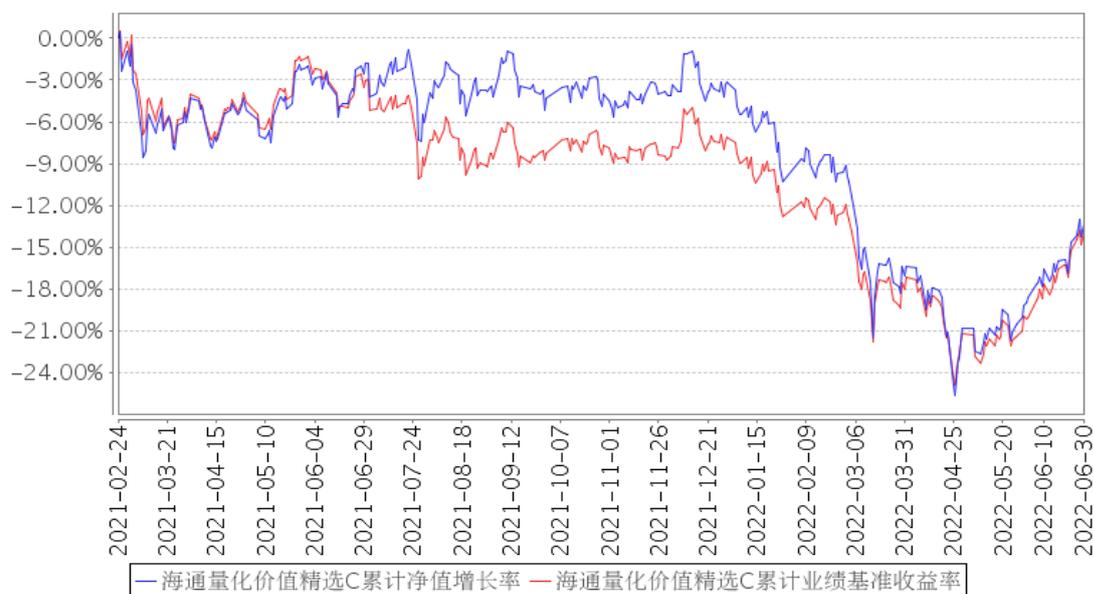
海通量化价值精选A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



海通量化价值精选B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



海通量化价值精选C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2022 年 6 月 30 日，本集合计划管理人共管理 15 只公募集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡倩	总经理助理，投资经理	2021 年 2 月 24 日	-	20 年	胡倩女士：上海财经大学经济学博士，现任上海海通证券资产管理有限公司总经理助理。曾任海通证券首席分析师，长信基金金融工程总监、基金经理。

4.1.3 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	2	196,083,280.59	2021年2月24日
	私募资产管理计划	2	93,227,086.69	2016年4月15日
	其他组合	-	-	-
	合计	4	289,310,367.28	-

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

2022 年四月份，市场触底，上证综指短暂跌破 2900 点。之后市场逐渐走出前期的悲观情绪，主要指数估值迅速修复，目前本轮反弹暂未结束。部分热门标的已经创出历史新高，但同时大部分行业还处在弱势反弹阶段。

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 1.0945 元，B 份额净值为 1.0956 元，C 份额净值为 1.0880 元。本报告期集合计划三类份额净值增长率分别为：-10.36%，-10.31%，-10.58%，业绩比较基准收益率为-7.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年三季度，市场在悲观情绪释放结束后，已经逐渐恢复。但是市场情绪的恢复，和经济状况的改善注定是一个漫长的过程，时点和节奏都很难预测。未来半年，市场或许会被悲观情绪暂时左右，但是权益资产投资价值已经显现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本集合计划管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及集合计划合同对估值程序的相关约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、集合计划份额净值的计算由集合计划管理人独立完成，并与集合计划托管人进行账务核对，经集合计划托管人复核无误后，由集合计划管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

- 一、本集合计划本报告期内无应分配的收益。
- 二、已实施的利润分配：无。
- 三、不存在应分配但尚未实施的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本集合计划本报告期无需要说明的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在对海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在任何损害集合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，本集合计划的管理人-上海海通证券资产管理有限公司在本集合计划的投资运作、集合计划资产净值计算、集合计划份额申购赎回价格计算、集合计划费用开支等问题上，不存在任何损害集合计划份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照集合计划合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、

财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	13,291,861.73	12,799,526.37
结算备付金		3,027,069.51	2,552,670.56
存出保证金		1,075,529.83	1,219,681.33
交易性金融资产	6.4.7.2	104,346,688.91	121,521,587.93
其中：股票投资		104,346,688.91	121,521,587.93
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	1,400,677.96
应收股利		157,147.20	-
应收申购款		99.88	419.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	3,153.94
资产总计		121,898,397.06	139,497,717.95
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		1.88	0.52
应付赎回款		11,010.68	1,187.05
应付管理人报酬		74,842.64	120,775.69
应付托管费		14,517.68	24,008.07
应付销售服务费		3,506.57	3,820.72
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	70,872.99
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	89,930.87	181,680.67
负债合计		193,810.32	402,345.71
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	111,214,510.45	113,928,146.09
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	10,490,076.29	25,167,226.15
净资产合计		121,704,586.74	139,095,372.24
负债和净资产总计		121,898,397.06	139,497,717.95

注：（1）报告截止日 2022 年 6 月 30 日，集合计划份额总额 111,214,510.45 份，其中海通量化价值精选 A 份额净值（暂估业绩报酬前）1.0945 元，份额总额 73,318,943.87 份，资产净值（暂估业绩报酬前）80,247,707.34 元，于 2022 年 6 月 30 日，相关暂估业绩报酬余额为 1,154.14 元，资产净值（暂估业绩报酬后）80,246,553.20 元；海通量化价值精选 B 份额净值（暂估业绩报酬前）1.0956 元，份额总额 29,802,110.89 份，资产净值（暂估业绩报酬前）32,651,489.98 元，于 2022 年 6 月 30 日，相关暂估业绩报酬余额为 259,766.43 元，资产净值（暂估业绩报酬后）32,391,723.55 元；海通量化价值精选 C 份额净值（暂估业绩报酬前）1.0880 元，份额总额 8,093,455.69 份，资产净值（暂估业绩报酬前）8,805,389.42 元，于 2022 年 6 月 30 日，相关暂估业绩报酬余额为 3,340.68 元，资产净值（暂估业绩报酬后）8,802,048.74 元。暂估业绩报酬为假设本集合计划于本报告期末按照当日的集合计划份额净值（计提业绩报酬前）清算，根据集合计划份额持有人持有的集合计划份额（包括未到期份额）至该日持有期间的收益情况估算的业绩报酬。该暂估业绩报酬余额是各集合计划份额持有人于期末时点的暂估业绩报酬的合计，各集合计划份额持有人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认，可能与上述暂估业绩报酬金额存在差异。

6.2 利润表

会计主体：海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2022 年 1 月 1 日至 2022 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
一、营业总收入		-14,216,586.50	-1,894,538.83
1. 利息收入		35,261.36	22,677.00
其中：存款利息收入	6.4.7.13	35,261.36	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）		-14,260,290.68	4,023,454.87
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-14,979,556.76	2,896,254.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	230,874.28
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-650,547.61	-
股利收益	6.4.7.19	1,369,813.69	896,326.39
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	8,442.82	-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）	6.4.7.21	-	264.79
减：二、营业总支出		650,030.59	606,543.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	472,261.27	276,368.78
2. 托管费	6.4.10.2.2	91,528.21	57,837.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	21,678.08	2,306.74
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	10,453.53
8. 其他费用	6.4.7.23	64,563.03	259,577.24

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-14,866,617.09	-2,501,082.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-14,866,617.09	-2,501,082.68
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-14,866,617.09	-2,501,082.68

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	113,928,146.09	-	25,167,226.15	139,095,372.24
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	113,928,146.09	-	25,167,226.15	139,095,372.24
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,713,635.64	-	-14,677,149.86	-17,390,785.50
(一)、综合收益总额	-	-	-14,866,617.09	-14,866,617.09
(二)、本期基金份额交易产	-2,713,635.64	-	189,467.23	-2,524,168.41

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	1,539,422.16	-	216,480.22	1,755,902.38
2. 基金赎回款	-4,253,057.80	-	-27,012.99	-4,280,070.79
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	111,214,510.45	-	10,490,076.29	121,704,586.74
项目	上年度可比期间 2021年2月24日（基金合同生效日）至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	77,523,307.45	-	22,350,469.75	99,873,777.20
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	77,523,307.45	-	22,350,469.75	99,873,777.20
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	38,661,020.36	-	4,997,294.94	43,658,315.30
(一)、综合收益总额	-	-	-2,501,082.68	-2,501,082.68
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	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
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”	-	-	-	-

号填列)				
(四)、 其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末 净资产(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：

李井伟

陈颖

刘雯

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）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 $80\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+20\% \times$ 商业银行活期存款利率（税后）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本集合计划报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

执行《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资

产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》和《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（2017 年修订）（以下合称“新金融工具准则”）

财政部于 2017 年度修订了《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》和《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》。修订后的准则规定，对于首次执行日尚未终止确认的金融工具，之前的确认和计量与修订后的准则要求不一致的，应当追溯调整。涉及前期比较财务报表数据与修订后的准则要求不一致的，无需调整。

根据《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22 号）等有关规定，并与集合计划托管人协商一致，本集合计划自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具相关会计准则，因追溯调整产生的累积影响数调整 2022 年年初留存收益和其他综合收益，2021 年度的财务报表未做调整。执行新金融工具准则未对本集合计划的财务状况和基金净值产生重大影响。

执行新金融工具准则

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收证券清算款、应收利息和应收申购款，金额分别为 12,799,526.37 元、2,552,670.56 元、1,219,681.33 元、1,400,677.96 元、3,153.94 元和 419.86 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收清算款、应收申购款和其他资产-应收利息，金额分别为 12,801,807.21 元、2,553,534.31 元、1,219,690.68 元、1,400,677.96 元、419.86 元和 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 121,521,587.93 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 121,521,587.93 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-预提费用，金额分别为 0.52 元、1,187.05 元、120,775.69 元、24,008.07 元、3,820.72 元、52,680.67 元和 129,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-预提费用，金额分别为 0.52 元、1,187.05 元、120,775.69 元、24,008.07 元、3,820.72 元、52,680.67 元和 129,000.00 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本集合计划持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”

等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本集合根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

财政部、国家税务总局财税[2016]140 号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》对资产管理计划增值税做出相关规定。除增值税外，本集合计划比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，若遇政策法规调整，相关的税务问题将按照调整后的政策法规执行。主要税项列示如下：

1、增值税

根据财税[2016]140 号文件的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财税[2017]56 号文件的规定，2018 年 1 月 1 日(含)以后，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财税[2017]90 号文件的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：(一)提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；(二)转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价(2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本集合计划增值税的附加税费，包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等，按照实际缴纳增值税税额的适用比例计算，由管理人申报缴纳。

2、印花税

比照《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》(财税字[1998]55号)和《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税[2002]128号)文件的规定,基金管理人运用资产管理计划买卖股票,卖出股票按1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

3、所得税

根据《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税[2008]1号)的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,从基金分配中取得的收入,债券的利息收入以及其他收入,暂不征收企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
活期存款	13,291,861.73
等于: 本金	13,290,582.92
加: 应计利息	1,278.81
减: 坏账准备	-
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-
其中: 存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-
合计	13,291,861.73

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	102,501,659.63	-	104,346,688.91	1,845,029.28
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		102,501,659.63	-	104,346,688.91
				1,845,029.28

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	7,092,720.00	-	-	
其中：股指期货投资	7,092,720.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	7,092,720.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2212	IC2212	6.00	7,512,240.00	419,520.00
合计				419,520.00
减：可抵销期货暂收款				419,520.00
净额				0.00

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。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本集合计划本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本集合计划本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本集合计划本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

6.4.7.8 其他资产

注：本集合计划本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	25,960.04
其中：交易所市场	25,960.04
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	63,970.83
合计	89,930.87

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

海通量化价值精选 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	76,641,469.68	76,641,469.68
本期申购	509,284.64	509,284.64
本期赎回（以“-”号填列）	-3,831,810.45	-3,831,810.45
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	73,318,943.87	73,318,943.87

海通量化价值精选 B

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,887,431.66	29,887,431.66
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-85,320.77	-85,320.77
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	29,802,110.89	29,802,110.89

海通量化价值精选 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,399,244.75	7,399,244.75
本期申购	1,030,137.52	1,030,137.52
本期赎回（以“-”号填列）	-335,926.58	-335,926.58
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	8,093,455.69	8,093,455.69

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

6.4.7.11 其他综合收益

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

海通量化价值精选 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	16,842,797.82	96,350.71	16,939,148.53
本期利润	-9,919,936.60	-149,020.73	-10,068,957.33

本期基金份额交易产生的变动数	-319,647.49	378,219.76	58,572.27
其中：基金申购款	92,222.47	-27,227.23	64,995.24
基金赎回款	-411,869.96	405,446.99	-6,422.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,603,213.73	325,549.74	6,928,763.47

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
本期期初	8,920,673.25	-2,296,194.86	6,624,478.39
本期利润	-3,854,674.78	91,822.49	-3,762,852.29
本期基金份额交易产生的变动数	-23,192.15	10,945.14	-12,247.01
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-23,192.15	10,945.14	-12,247.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,042,806.32	-2,193,427.23	2,849,379.09

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
本期期初	1,594,867.15	8,732.08	1,603,599.23
本期利润	-1,100,448.53	65,641.06	-1,034,807.47
本期基金份额交易产生的变动数	184,037.46	-40,895.49	143,141.97
其中：基金申购款	211,199.47	-59,714.49	151,484.98
基金赎回款	-27,162.01	18,819.00	-8,343.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	678,456.08	33,477.65	711,933.73

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2022年1月1日至2022年6月30日	
活期存款利息收入		23,951.81
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		10,964.59
其他		344.96
合计		35,261.36

注：其他包括结算保证金利息收入、港股通风控资金利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	198,790,610.00
减：卖出股票成本总额	213,452,318.44
减：交易费用	317,848.32
买卖股票差价收入	-14,979,556.76

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本集合计划本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出权证成交总额	7,998.43
减：卖出权证成本总额	-
减：交易费用	16.05
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	-

买卖权证差价收入	7,982.38
----------	----------

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-658,529.99

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,369,813.69
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,369,813.69

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	37,442.79
股票投资	37,442.79
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	-96,683.16
权证投资	7,926.84
期货投资	-104,610.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-67,683.19
合计	8,442.82

6.4.7.21 其他收入

注：本集合计划本报告期末无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本集合计划本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	4,463.46
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	171.00
证券组合费	421.20
合计	64,563.03

6.4.7.24 分部报告

本集合计划本报告期无分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本集合计划并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
上海海通证券资产管理有限公司（“海通资管”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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 （%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）
海通证券	394,619,287.15	100.00	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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 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 （%）	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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 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 （%）	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年2月24日（基金合同生效日）至 2021年6月30日	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期权证 成交总额的比例 （%）
海通证券	7,998.43	100.00	-	-

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
海通证券	51,270.00	100.00	25,960.04	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	472,261.27	276,368.78
其中：支付销售机构的客户维护费	75,461.47	80,580.11

注：1. 本集合计划本期共发生应支付的固定管理费 472,184.46 元（其中 A 类份额 325,736.62 元，B 类份额 111,762.95 元，C 类份额 34,684.89 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 76.81 元。在本集合计划投资者赎回日和集合计划终止日，管理人将根据投资者的期间年化收益率，对 B 类计划份额期间年化收益率超过 5% 以上部分按照 10% 的比例收取管理人业绩报酬；对 A 类或 C 类计划份额期间年化收益率超过 8% 以上部分按照 20% 的比例收取业绩报酬。

A 类或 C 类份额业绩报酬的计算公式为：

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

B 类份额业绩报酬的计算公式为：

当年化收益率 $R \geq 5\%$ = 每笔参与份额在上一个业绩报酬计提日的资产净值总额 * (年化收益率 $R - 5.0\%$) * 10% * 投资者上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的年限（1 年按 365 天计算）

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 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
当期发生的基金应支付的托管费	91,528.21	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			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	海通量化价值精选	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	-	-	3,467.43	3,467.43
海通证券	-	-	18,099.69	18,099.69
海通资管	-	-	3.47	3.47
合计	-	-	21,570.59	21,570.59
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	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
	2022年1月1日至 2022年6月30日	2022年1月1日至2022 年6月30日	2022年1月1日至 2022年6月30日
	海通量化价值精选 A	海通量化价值精选 B	海通量化价值精选 C
基金合同生效日 (2021年2月24 日)持有的基金份额	0.00	15,279,736.72	0.00
报告期初持有的基 金份额	0.00	15,279,736.72	0.00
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%	51.2707%	0.0000%

项目	上年度可比期间 2021年2月24日(基金 合同生效日)至 2021年6月30日	上年度可比期间 2021年2月24日(基金合 同生效日)至2021年6月 30日	上年度可比期间 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 金份额	0.00	15,279,736.72	0.00
报告期内申购/买入 总份额	0.00	0.00	0.00
报告期内因拆分变 动份额	0.00	0.00	0.00
减:报告期内赎回/ 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集合计划份额占总份额比例的计算中,A、B、C级比例分母为各自级别的份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

海通量化价值精选 A

关联方名称	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例(%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例(%)
海通证券	-	-	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 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例(%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例(%)
海通证券	10,000,000.00	33.5547	10,000,000.00	33.4589

份额单位：份

海通量化价值精选 C

关联方名称	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
海通证券	-	-	0.00	0.0000

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
工商银行	13,291,861.73	23,951.81	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未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022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	受限期	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
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	53	3,396.24	1,988.56	-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	新股流通受限	72.69	71.54	46	3,343.74	3,290.84	-

注：此处受限期为证券原流通受限期，非剩余受限期。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本集合计划本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本集合计划本报告期末无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。

本集合计划的管理人定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本集合计划持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	13,291,861.73	-	-	-	13,291,861.73
结算备付金	3,027,069.51	-	-	-	3,027,069.51
存出保证金	1,075,529.83	-	-	-	1,075,529.83
交易性金融资产	-	-	-	104,346,688.91	104,346,688.91
应收股利	-	-	-	157,147.20	157,147.20
应收申购款	-	-	-	99.88	99.88
资产总计	17,394,461.07	-	-	104,503,935.99	121,898,397.06
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1.88	1.88
应付赎回款	-	-	-	11,010.68	11,010.68
应付管理人报酬	-	-	-	74,842.64	74,842.64
应付托管费	-	-	-	14,517.68	14,517.68
应付销售服务费	-	-	-	3,506.57	3,506.57
其他负债	-	-	-	89,930.87	89,930.87
负债总计	-	-	-	193,810.32	193,810.32
利率敏感度缺口	17,394,461.07	-	-	-104,310,125.67	121,704,586.74
上年度末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,799,526.37	-	-	-	12,799,526.37
结算备付金	2,552,670.56	-	-	-	2,552,670.56
存出保证金	1,219,681.33	-	-	-	1,219,681.33
交易性金融资产	-	-	-	121,521,587.93	121,521,587.93

应收申购款	-	-	-	419.86	419.86
应收证券清算款	-	-	-	1,400,677.96	1,400,677.96
其他资产	-	-	-	3,153.94	3,153.94
资产总计	16,571,878.26	-	-	122,925,839.69	139,497,717.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,187.05	1,187.05
应付管理人报酬	-	-	-	120,775.69	120,775.69
应付托管费	-	-	-	24,008.07	24,008.07
应付证券清算款	-	-	-	0.52	0.52
应付销售服务费	-	-	-	3,820.72	3,820.72
应交税费	-	-	-	70,872.99	70,872.99
其他负债	-	-	-	181,680.67	181,680.67
负债总计	-	-	-	402,345.71	402,345.71
利率敏感度缺口	16,571,878.26	-	-	-122,523,493.98	139,095,372.24

注：上表统计了本集合计划面临的利率风险敞口，表中所示为本集合计划资产负债的账面价值，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	-		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-	-
	市场利率下降 25 个基点	-	-

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
----	-----

	2022 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	8,565,807.10	-	8,565,807.10
资产合计	-	8,565,807.10	-	8,565,807.10
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	8,565,807.10	-	8,565,807.10
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	2,390,241.34	-	2,390,241.34
资产合计	-	2,390,241.34	-	2,390,241.34
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	-	2,390,241.34	-	2,390,241.34

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	-		
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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）	
分析	所有外币相对人民币升值 5%	428,290.36	119,512.07

	所有外币相对人民币贬值 5%	-428, 290. 36	-119, 512. 07
--	----------------	---------------	---------------

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 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	104, 346, 688. 91	85. 74	121, 521, 587. 93	87. 37
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	104, 346, 688. 91	85. 74	121, 521, 587. 93	87. 37

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注 6. 4. 7. 3）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	股票价格上升 5%	5,217,334.45	6,076,079.40
	股票价格下降 5%	-5,217,334.45	-6,076,079.40

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

第一层次：如以活跃市场报价估值的股票投资、股指期货投资、国债期货投资、每日开放申赎/买卖的基金投资等；第二层次：如因新发/增发尚未上市交易而按发行价格/增发价格估值的不限售的股票投资、债券投资等，使用第三方基准服务机构提供的报价估值的在交易所市场或银行间同业市场交易的债券投资、资产支持证券投资等；第三层次：如使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期的股票投资，以及违约债、非指数收益法估值的长期停牌的股票等估值模型中使用不可观察输入值的投资等。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	104,341,409.51	121,464,662.55
第二层次	-	56,925.38
第三层次	5,279.40	-
合计	104,346,688.91	121,521,587.93

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至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	104,346,688.91	85.60
	其中：股票	104,346,688.91	85.60
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	16,318,931.24	13.39
8	其他各项资产	1,232,776.91	1.01
9	合计	121,898,397.06	100.00

注：本集合计划通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 8,565,807.10 元，占资产净值比例为 7.04%。

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	442.16	0.00

B	采矿业	5,618,185.20	4.62
C	制造业	59,424,679.57	48.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,861,344.00	2.35
E	建筑业	2,615,469.00	2.15
F	批发和零售业	482,563.00	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	2,170,831.00	1.78
H	住宿和餐饮业	94,350.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,826,110.08	3.14
J	金融业	15,103,640.70	12.41
K	房地产业	1,302,176.00	1.07
L	租赁和商务服务业	935,000.29	0.77
M	科学研究和技术服务业	940,118.40	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	405,972.41	0.33
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	95,780,881.81	78.70

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	392,891.39	0.32
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	1,484,628.65	1.22
医疗保健	-	-
工业	5,438,195.97	4.47
信息技术	412,004.89	0.34
电信服务	838,086.20	0.69
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	8,565,807.10	7.04

注：1、以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

2、以上行业分类的统计中已包含港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	600519	贵州茅台	2,500	5,112,500.00	4.20
2	300750	宁德时代	6,000	3,204,000.00	2.63
3	600036	招商银行	61,600	2,599,520.00	2.14
4	601318	中国平安	50,400	2,353,176.00	1.93
5	002594	比亚迪	4,900	1,634,101.00	1.34
6	601012	隆基绿能	24,136	1,608,181.68	1.32
7	000858	五粮液	7,252	1,464,396.36	1.20
8	000333	美的集团	23,400	1,413,126.00	1.16
9	601166	兴业银行	66,100	1,315,390.00	1.08
10	600030	中信证券	60,220	1,304,365.20	1.07
11	01618	中国中冶	810,000	1,302,283.33	1.07
12	601668	中国建筑	237,200	1,261,904.00	1.04
13	600406	国电南瑞	43,320	1,169,640.00	0.96
14	300059	东方财富	45,045	1,144,143.00	0.94
15	600900	长江电力	49,000	1,132,880.00	0.93
16	002938	鹏鼎控股	36,800	1,111,728.00	0.91
17	600887	伊利股份	26,900	1,047,755.00	0.86
18	601899	紫金矿业	111,400	1,039,362.00	0.85
19	600089	特变电工	37,320	1,022,194.80	0.84
20	000708	中信特钢	48,800	983,320.00	0.81
21	03898	南车时代电气	27,000	893,588.03	0.73
22	601888	中国中免	3,653	850,893.29	0.70
23	603259	药明康德	8,160	848,558.40	0.70
24	600690	海尔智家	30,700	843,022.00	0.69
25	00941	中国移动	20,000	838,086.20	0.69
26	600048	保利发展	47,300	825,858.00	0.68
27	600018	上港集团	139,400	812,702.00	0.67
28	002202	金风科技	54,600	808,080.00	0.66
29	601877	正泰电器	22,300	797,894.00	0.66
30	603993	洛阳钼业	135,200	774,696.00	0.64
31	600028	中国石化	187,300	764,184.00	0.63
32	601669	中国电建	96,900	762,603.00	0.63
33	01800	中国交通建设	220,000	760,092.87	0.62
34	00390	中国中铁	180,000	746,580.87	0.61
35	01186	中国铁建	175,000	734,822.01	0.60
36	600760	中航沈飞	12,076	729,994.20	0.60
37	600764	中国海防	28,500	719,340.00	0.59
38	601898	中煤能源	68,800	714,144.00	0.59
39	000938	紫光股份	34,022	660,026.80	0.54
40	002129	TCL 中环	11,200	659,568.00	0.54
41	600219	南山铝业	178,500	658,665.00	0.54
42	03996	中国能源建设	700,000	652,509.97	0.54

43	601939	建设银行	103,000	624,180.00	0.51
44	601216	君正集团	127,500	622,200.00	0.51
45	01339	中国人民保险集团	297,000	609,579.43	0.50
46	601816	京沪高铁	115,100	577,802.00	0.47
47	300316	晶盛机电	8,500	574,515.00	0.47
48	002602	世纪华通	118,100	569,242.00	0.47
49	600489	中金黄金	76,600	566,074.00	0.47
50	002138	顺络电子	20,500	558,625.00	0.46
51	600919	江苏银行	78,300	557,496.00	0.46
52	300450	先导智能	8,800	555,984.00	0.46
53	600332	白云山	17,600	555,984.00	0.46
54	601169	北京银行	122,000	553,880.00	0.46
55	002916	深南电路	5,900	552,889.00	0.45
56	000568	泸州老窖	2,200	542,388.00	0.45
57	600050	中国联通	156,700	542,182.00	0.45
58	600176	中国巨石	31,062	540,789.42	0.44
59	600741	华域汽车	23,245	534,635.00	0.44
60	600352	浙江龙盛	52,000	529,360.00	0.43
61	600809	山西汾酒	1,620	526,176.00	0.43
62	603659	璞泰来	6,200	523,280.00	0.43
63	601857	中国石油	98,000	519,400.00	0.43
64	603790	雅运股份	47,900	509,177.00	0.42
65	002179	中航光电	7,700	487,564.00	0.40
66	002841	视源股份	6,400	482,048.00	0.40
67	000596	古井贡酒	1,900	474,354.00	0.39
68	002920	德赛西威	3,200	473,600.00	0.39
69	600926	杭州银行	31,200	467,376.00	0.38
70	000807	云铝股份	46,800	462,384.00	0.38
71	600584	长电科技	16,800	453,600.00	0.37
72	600893	航发动力	9,800	445,998.00	0.37
73	06881	中国银河	115,000	445,511.23	0.37
74	600346	恒力石化	19,900	442,576.00	0.36
75	300652	雷迪克	17,900	438,013.00	0.36
76	601916	浙商银行	131,500	436,580.00	0.36
77	600061	国投资本	68,600	436,296.00	0.36
78	603369	今世缘	8,500	433,500.00	0.36
79	003816	中国广核	154,800	433,440.00	0.36
80	601808	中海油服	30,300	422,685.00	0.35
81	002360	同德化工	51,400	417,368.00	0.34
82	002252	上海莱士	69,800	413,914.00	0.34
83	00981	中芯国际	26,500	412,004.89	0.34

84	601600	中国铝业	86,500	410,875.00	0.34
85	002074	国轩高科	8,900	405,840.00	0.33
86	601698	中国卫通	35,800	404,898.00	0.33
87	603882	金域医学	4,900	404,495.00	0.33
88	002648	卫星化学	15,559	402,200.15	0.33
89	600862	中航高科	14,300	401,830.00	0.33
90	001979	招商蛇口	29,800	400,214.00	0.33
91	300014	亿纬锂能	4,100	399,750.00	0.33
92	300274	阳光电源	3,900	383,175.00	0.31
93	600438	通威股份	6,400	383,104.00	0.31
94	002817	黄山胶囊	52,940	382,756.20	0.31
95	300207	欣旺达	12,000	379,200.00	0.31
96	601088	中国神华	11,300	376,290.00	0.31
97	003033	征和工业	14,000	375,200.00	0.31
98	601985	中国核电	54,500	373,870.00	0.31
99	000733	振华科技	2,700	367,119.00	0.30
100	600132	重庆啤酒	2,500	366,500.00	0.30
101	000977	浪潮信息	13,800	365,424.00	0.30
102	600426	华鲁恒升	12,410	362,372.00	0.30
103	601901	方正证券	53,900	361,669.00	0.30
104	000703	恒逸石化	34,410	361,649.10	0.30
105	300466	赛摩智能	65,500	358,940.00	0.29
106	002842	翔鹭钨业	41,500	354,410.00	0.29
107	600468	百利电气	76,800	352,512.00	0.29
108	605088	冠盛股份	26,100	351,828.00	0.29
109	601360	三六零	41,200	351,024.00	0.29
110	300067	安诺其	99,400	350,882.00	0.29
111	603321	梅轮电梯	53,500	348,285.00	0.29
112	002001	新和成	15,128	345,069.68	0.28
113	002364	中恒电气	44,100	339,129.00	0.28
114	300135	宝利国际	131,300	338,754.00	0.28
115	300018	中元股份	57,500	338,100.00	0.28
116	601211	国泰君安	22,200	337,440.00	0.28
117	300341	麦克奥迪	37,000	336,330.00	0.28
118	600000	浦发银行	41,700	334,017.00	0.27
119	300283	温州宏丰	54,800	332,636.00	0.27
120	002471	中超控股	130,700	330,671.00	0.27
121	601138	工业富联	33,300	327,672.00	0.27
122	000661	长春高新	1,400	326,788.00	0.27
123	601988	中国银行	99,900	325,674.00	0.27
124	601989	中国重工	86,400	320,544.00	0.26
125	600015	华夏银行	60,000	312,600.00	0.26

126	002352	顺丰控股	5,500	306,955.00	0.25
127	601998	中信银行	64,000	304,000.00	0.25
128	601818	光大银行	100,500	302,505.00	0.25
129	600104	上汽集团	16,700	297,427.00	0.24
130	002600	领益智造	58,900	295,678.00	0.24
131	000800	一汽解放	31,000	289,540.00	0.24
132	601766	中国中车	53,500	278,200.00	0.23
133	02333	长城汽车	20,000	276,055.33	0.23
134	002415	海康威视	7,500	271,500.00	0.22
135	688181	八亿时空	6,200	268,460.00	0.22
136	601006	大秦铁路	40,100	264,259.00	0.22
137	600979	广安爱众	82,000	263,220.00	0.22
138	601728	中国电信	70,200	261,846.00	0.22
139	600905	三峡能源	39,900	250,971.00	0.21
140	603019	中科曙光	8,600	249,572.00	0.21
141	002032	苏泊尔	4,400	247,896.00	0.20
142	601601	中国太保	10,500	247,065.00	0.20
143	002049	紫光国微	1,300	246,636.00	0.20
144	600183	生益科技	14,200	241,258.00	0.20
145	603339	四方科技	20,900	239,096.00	0.20
146	603799	华友钴业	2,470	236,181.40	0.19
147	300628	亿联网络	3,100	236,065.00	0.19
148	300433	蓝思科技	21,300	235,791.00	0.19
149	300214	日科化学	30,200	233,748.00	0.19
150	00670	中国东方航空股份	90,000	231,670.97	0.19
151	000100	TCL 科技	47,800	228,962.00	0.19
152	002064	华峰化学	26,900	227,036.00	0.19
153	300003	乐普医疗	12,000	222,840.00	0.18
154	603766	隆鑫通用	48,100	221,741.00	0.18
155	002736	国信证券	23,011	220,215.27	0.18
156	002304	洋河股份	1,200	219,780.00	0.18
157	000157	中联重科	35,500	218,680.00	0.18
158	000877	天山股份	17,300	212,790.00	0.17
159	000725	京东方 A	53,600	211,184.00	0.17
160	601288	农业银行	69,300	209,286.00	0.17
161	688396	华润微	3,500	206,745.00	0.17
162	600655	豫园股份	21,800	205,792.00	0.17
163	06806	申万宏源	150,400	203,220.51	0.17
164	601186	中国铁建	25,700	203,030.00	0.17
165	600585	海螺水泥	5,700	201,096.00	0.17
166	002812	恩捷股份	800	200,360.00	0.16

167	601390	中国中铁	32,400	198,936.00	0.16
168	600660	福耀玻璃	4,700	196,507.00	0.16
169	002475	立讯精密	5,760	194,630.40	0.16
170	000895	双汇发展	6,300	184,590.00	0.15
171	600188	兖矿能源	4,300	169,764.00	0.14
172	002389	航天彩虹	8,500	156,060.00	0.13
173	601168	西部矿业	12,900	152,607.00	0.13
174	688008	澜起科技	2,500	151,450.00	0.12
175	600436	片仔癀	400	142,692.00	0.12
176	601799	星宇股份	800	136,800.00	0.11
177	000786	北新建材	3,900	135,018.00	0.11
178	002597	金禾实业	3,100	134,323.00	0.11
179	002013	中航机电	10,600	130,910.00	0.11
180	000878	云南铜业	11,000	125,290.00	0.10
181	300760	迈瑞医疗	400	125,280.00	0.10
182	300634	彩讯股份	9,600	121,920.00	0.10
183	06178	光大证券	26,000	121,180.42	0.10
184	601225	陕西煤业	5,600	118,608.00	0.10
185	002401	中远海科	13,100	118,031.00	0.10
186	603788	宁波高发	9,400	117,124.00	0.10
187	02238	广汽集团	18,000	116,836.06	0.10
188	00753	中国国航	20,000	116,647.92	0.10
189	603986	兆易创新	820	116,612.20	0.10
190	603699	纽威股份	13,700	115,217.00	0.09
191	002098	浔兴股份	19,400	114,654.00	0.09
192	603012	创力集团	19,400	114,654.00	0.09
193	600273	嘉化能源	10,500	114,030.00	0.09
194	601229	上海银行	17,400	113,970.00	0.09
195	002371	北方华创	400	110,848.00	0.09
196	603585	苏利股份	5,700	110,751.00	0.09
197	600362	江西铜业	6,200	110,546.00	0.09
198	600029	南方航空	15,000	109,650.00	0.09
199	600236	桂冠电力	17,800	108,402.00	0.09
200	02628	中国人寿	9,000	105,137.06	0.09
201	601800	中国交建	11,300	104,864.00	0.09
202	601933	永辉超市	24,400	104,432.00	0.09
203	000987	越秀金控	14,040	98,701.20	0.08
204	600845	宝信软件	1,800	98,280.00	0.08
205	603613	国联股份	1,100	97,460.00	0.08
206	002180	纳思达	1,900	96,178.00	0.08
207	600886	国投电力	9,000	94,500.00	0.08
208	600754	锦江酒店	1,500	94,350.00	0.08

209	300739	明阳电路	5,800	92,916.00	0.08
210	300347	泰格医药	800	91,560.00	0.08
211	600829	人民同泰	13,900	87,709.00	0.07
212	600623	华谊集团	10,300	85,490.00	0.07
213	603328	依顿电子	13,400	85,090.00	0.07
214	300475	香农芯创	4,200	84,630.00	0.07
215	600667	太极实业	11,400	84,132.00	0.07
216	600415	小商品城	15,100	84,107.00	0.07
217	000960	锡业股份	5,000	83,850.00	0.07
218	600488	天药股份	19,300	82,990.00	0.07
219	603707	健友股份	2,900	81,780.00	0.07
220	600157	永泰能源	49,100	78,069.00	0.06
221	600177	雅戈尔	11,520	76,377.60	0.06
222	600639	浦东金桥	5,600	76,104.00	0.06
223	601066	中信建投	2,600	75,166.00	0.06
224	300677	英科医疗	2,880	73,036.80	0.06
225	002008	大族激光	2,200	72,886.00	0.06
226	300124	汇川技术	1,100	72,457.00	0.06
227	002271	东方雨虹	1,400	72,058.00	0.06
228	603087	甘李药业	1,500	71,955.00	0.06
229	600795	国电电力	18,100	70,771.00	0.06
230	000063	中兴通讯	2,700	68,931.00	0.06
231	002709	天赐材料	1,100	68,266.00	0.06
232	688012	中微公司	584	68,182.00	0.06
233	601838	成都银行	4,100	67,978.00	0.06
234	000625	长安汽车	3,900	67,548.00	0.06
235	603195	公牛集团	400	61,164.00	0.05
236	002460	赣锋锂业	400	59,480.00	0.05
237	688002	睿创微纳	1,475	58,587.00	0.05
238	601919	中远海控	4,210	58,519.00	0.05
239	002821	凯莱英	200	57,800.00	0.05
240	002459	晶澳科技	700	55,230.00	0.05
241	600025	华能水电	7,900	55,221.00	0.05
242	300601	康泰生物	1,120	50,601.60	0.04
243	002466	天齐锂业	400	49,920.00	0.04
244	603392	万泰生物	321	49,851.30	0.04
245	688981	中芯国际	1,100	49,687.00	0.04
246	603658	安图生物	1,000	48,890.00	0.04
247	601231	环旭电子	3,400	48,824.00	0.04
248	002414	高德红外	3,676	47,310.12	0.04
249	002624	完美世界	3,200	45,984.00	0.04
250	688599	天合光能	672	43,848.00	0.04

251	688363	华熙生物	300	42,654.00	0.04
252	002555	三七互娱	2,000	42,460.00	0.03
253	002120	韵达股份	2,400	40,944.00	0.03
254	600079	人福医药	2,500	40,000.00	0.03
255	601727	上海电气	2,600	10,686.00	0.01
256	600276	恒瑞医药	149	5,526.41	0.00
257	301201	诚达药业	46	3,290.84	0.00
258	301190	善水科技	131	3,108.63	0.00
259	002311	海大集团	49	2,940.49	0.00
260	301196	唯科科技	53	1,988.56	0.00
261	600570	恒生电子	40	1,741.60	0.00
262	300015	爱尔眼科	33	1,477.41	0.00
263	002230	科大讯飞	34	1,401.48	0.00
264	601966	玲珑轮胎	53	1,344.61	0.00
265	000538	云南白药	20	1,207.80	0.00
266	300595	欧普康视	20	1,143.80	0.00
267	600522	中天科技	44	1,016.40	0.00
268	603288	海天味业	10	903.60	0.00
269	002884	凌霄泵业	40	819.60	0.00
270	002142	宁波银行	13	465.53	0.00
271	002714	牧原股份	8	442.16	0.00
272	603638	艾迪精密	20	410.00	0.00
273	600547	山东黄金	20	371.20	0.00
274	603260	合盛硅业	3	353.88	0.00
275	002463	沪电股份	20	295.20	0.00
276	603685	晨丰科技	25	256.50	0.00
277	300056	中创环保	37	239.76	0.00
278	603228	景旺电子	10	233.30	0.00
279	002500	山西证券	40	229.60	0.00
280	603289	泰瑞机器	20	179.80	0.00
281	000166	申万宏源	35	150.15	0.00
282	002412	汉森制药	18	110.88	0.00
283	002945	华林证券	7	106.75	0.00
284	000848	承德露露	10	96.80	0.00
285	600010	包钢股份	34	79.90	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	3,020,705.00	2.17
2	01618	中国中冶	1,872,578.18	1.35

3	600519	贵州茅台	1,662,848.00	1.20
4	600085	同仁堂	1,551,153.00	1.12
5	601899	紫金矿业	1,491,124.00	1.07
6	002202	金风科技	1,429,265.00	1.03
7	600741	华域汽车	1,395,976.30	1.00
8	00981	中芯国际	1,360,060.94	0.98
9	01800	中国交通建设	1,317,181.09	0.95
10	000708	中信特钢	1,305,413.00	0.94
11	00941	中国移动	1,246,864.84	0.90
12	601066	中信建投	1,141,795.00	0.82
13	601898	中煤能源	1,123,572.00	0.81
14	601877	正泰电器	1,087,048.00	0.78
15	002841	视源股份	1,076,115.00	0.77
16	002001	新和成	1,058,911.00	0.76
17	300601	康泰生物	1,032,734.00	0.74
18	601328	交通银行	1,020,858.00	0.73
19	600690	海尔智家	1,019,272.00	0.73
20	603993	洛阳钼业	1,013,704.00	0.73

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	2,264,946.00	1.63
2	300750	宁德时代	1,634,940.00	1.18
3	06881	中国银河	1,521,446.94	1.09
4	601390	中国中铁	1,519,345.00	1.09
5	603986	兆易创新	1,481,524.00	1.07
6	600085	同仁堂	1,422,829.00	1.02
7	300601	康泰生物	1,380,908.54	0.99
8	601186	中国铁建	1,292,963.00	0.93
9	002736	国信证券	1,290,480.00	0.93
10	002049	紫光国微	1,271,794.00	0.91
11	603260	合盛硅业	1,268,161.00	0.91
12	002008	大族激光	1,252,872.00	0.90
13	600111	北方稀土	1,234,635.00	0.89
14	300124	汇川技术	1,219,918.00	0.88
15	600183	生益科技	1,193,974.00	0.86
16	601899	紫金矿业	1,185,711.00	0.85
17	600999	招商证券	1,134,697.00	0.82
18	688396	华润微	1,111,542.57	0.80
19	603517	绝味食品	1,110,425.00	0.80

20	01766	中国南车	1,104,803.26	0.79
----	-------	------	--------------	------

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	196,232,049.79
卖出股票收入（成交）总额	198,790,610.00

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

监测股指期货基差, 适时使用股指期货代替现货持仓。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本产品暂不涉及国债期货投资。

7.11.2 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

本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会山东监管局、陕西监管局的处罚。本集合计划对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及产品合同的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

集合计划投资的前十名股票中，没有投资于超出集合计划合同规定备选股票库之外的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,075,529.83
2	应收清算款	-
3	应收股利	157,147.20
4	应收利息	-
5	应收申购款	99.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,232,776.91

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	1,232	59,512.13	3,799,331.98	5.18	69,519,611.89	94.82
海通量化 价值精选 B	79	377,241.91	25,279,736.72	84.83	4,522,374.17	15.17
海通量化 价值精选	224	36,131.50	82,966.90	1.03	8,010,488.79	98.97

C						
合计	1,535	72,452.45	29,162,035.60	26.22	82,052,474.85	73.78

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	139,130.13	0.1898
	海通量化价值精选 B	260,501.53	0.8741
	海通量化价值精选 C	880.70	0.0109
	合计	400,512.36	0.3601

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海通量化价值精选 A	海通量化价值精选 B	海通量化价值精选 C
基金合同生效日（2021年2月24日）基金份额总额	-	77,523,307.45	-
本报告期期初基金份额总额	76,641,469.68	29,887,431.66	7,399,244.75
本报告期基金总申购份额	509,284.64	-	1,030,137.52
减：本报告期基金总赎回份额	3,831,810.45	85,320.77	335,926.58

本报告期基金 拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末 基金份额总额	73,318,943.87	29,802,110.89	8,093,455.69

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无集合计划份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2022 年 3 月 11 日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司第四届第三十四次董事会审议通过，周陶女士自 2022 年 3 月 10 日起不再担任公司合规总监，由总经理李井伟先生代任公司合规总监。

2、2022 年 5 月 20 日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司第四届第三十四次董事会审议通过，吴文然女士自 2022 年 5 月 18 日起担任公司合规总监。

3、本报告期集合计划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

1、因金融委托理财合同纠纷，四川信托有限公司向四川省成都市中级人民法院起诉，要求上海海通证券资产管理有限公司、海通证券股份有限公司等 13 个被告返还或赔偿原告委托财产 51,455 万元及相应利息。截止本报告披露日，该案尚未开庭审理。

2、本报告期内，无涉及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，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等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
海通证券	2	394,619,287.15	100.00	51,270.00	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	-	-	-	-	7,998.43	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	上海海通证券资产管理有限公司旗下参公集合资产管理计划转换业务规则说明	规定披露媒介	2022年3月30日
2	上海海通证券资产管理有限公司关于开通旗下部分集合资产管理计划转换业务及费率优惠活动的公告	规定披露媒介	2022年3月30日
3	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	规定披露媒介	2022年5月20日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内无单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，未发现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准海通稳健成长集合资产管理计划合同变更的文件
- (二) 海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同
- (三) 海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议
- (四) 海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书
- (五) 法律意见书

(六) 管理人业务资格批件、营业执照

(七) 托管人业务资格批件、营业执照

(八) 业务规则

(九) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人网站(www.htsamc.com)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

2022年8月31日