

# 海通量化成长精选一年持有期混合型集合 资产管理计划 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：上海海通证券资产管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

集合计划托管人中国工商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2023 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54

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
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>56</b>
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 .....	56
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 .....	56
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>57</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	57
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 .....	58
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
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	海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划		
基金简称	海通量化成长精选		
基金主代码	850010		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021 年 12 月 23 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	48,922,285.51 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	海通量化成长精选 A	海通量化成长精选 B	海通量化成长精选 C
下属分级基金的交易代码	851088	850010	851099
报告期末下属分级基金的份额总额	27,263,143.16 份	20,670,232.98 份	988,909.37 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>策略组合构建方法：</p> <p>（1）筛选有效因子</p> <p>基于对国内外证券市场运行特征的长期跟踪研究以及大量历史数据的实证检验，选取出符合 A 股投资逻辑的因子。因子库主要包括成长类因子、估值类因子、财务质量类因子、流动性因子、市场预期类因子等。</p> <p>其中成长因子包括但不限于主营收入增长率、净利润增长率、净资产增长率、一致预期净利润增长率、PEG 等；估值因子包括但不限于市盈率、市净率、市现率、市销率等；质量因子包括但不限于总</p>

资产收益率、净资产收益率、销售毛利率、营业总收入、每股收益、资产负债率、总资产周转率等；市场因子包括但不限于成交量、换手率、流通市值等。

投研团队将定期或不定期地对多因子选股体系进行复核与检验，适时剔除失效因子、酌情纳入重新发挥作用的有效因子或者由市场上新出现的投资逻辑归纳而来的有效因子，通过不断改善多因子选股体系的有效性与稳定性，使得产品能够持续的完成投资目标。

#### （2）动态优化因子权重

作为在投资决策时的可观测指标，不同因子从不同的侧面反映了投资标的真实运行状态。同一时点多个因子（及其近期值）所形成的向量，是影响这只股票市场表现的重要因素，这些因素的综合影响方式可能非常复杂，但是随着时间的推移也许有迹可循。数量模式的一个工作重点就在于动态追查这些痕迹，并从过往的轨迹中总结出有可能带来收益的量化投资模式并固定下来，从而有效避免主观情绪可能带来的负面影响，严格执行投资逻辑。整个过程具体来讲就是，通过历史数据建立因子矩阵和权重矩阵，并根据最新数据不断进行修正。

#### （3）生成股票组合并优化股票权重

在因子权重确定后，多因子选股体系对全市场股票进行综合评分，根据最新数据筛选出备选股票组合，同时综合风险收益目标、风险敞口约束和换仓成本优化备选组合内的个股权重。

在实际运行过程中，管理人将紧密追踪组合和市场的互动表现，及时对多因子选股体系定期或不定期地进行修正，优化股票投资组合。为控制组合风险，在个股偏离度和行业偏离度上也会设置阈值。

#### （4）港股投资策略

本集合计划将仅通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。本集合计划重点投资于基本面良好、主要收入来自于中国内地、相对 A 股市场估值合理，具有持续领先优势或核心竞争力及注重现金分红的上市公司进行长期投资。

### 3、债券投资策略

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。

### 4、股指期货投资策略

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>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 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、存托凭证投资策略 本集合计划将根据本集合计划的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>7、资产支持证券投资策略 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>8、融资业务投资策略 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>9、其他金融衍生产品的投资策略 本集合计划将根据集合计划的特点和要求，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%×中证 500 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
	联系电话	021-23154762
	电子邮箱	htam@haitong.com
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	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)		
数据和指标	海通量化成长精选 A	海通量化成长精选 B	海通量化成长精选 C
本期已实现收益	1,801,231.41	1,160,294.58	100,873.02
本期利润	2,349,031.62	1,488,065.10	214,102.02
加权平均基金份额本期利润	0.0722	0.0676	0.1282
本期加权平均净值利润率	6.55%	6.13%	11.72%
本期基金份额净值增长率	5.31%	5.36%	5.04%
3.1.2 期末	报告期末(2023 年 6 月 30 日)		
数据和指标			
期末可供分配利润	2,539,401.67	1,952,475.03	84,865.15
期末可供分配基金份额利润	0.0931	0.0945	0.0858
期末基金资产净值	29,802,544.83	22,622,708.01	1,073,774.52



期末基金份额净值	1.0931	1.0945	1.0858
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	-6.88%	-6.76%	-7.50%

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

海通量化成长精选 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	0.72%	0.75%	-0.63%	0.75%	1.35%	0.00%
过去三个月	-2.42%	0.70%	-4.28%	0.66%	1.86%	0.04%
过去六个月	5.31%	0.67%	1.92%	0.63%	3.39%	0.04%
过去一年	-0.24%	0.83%	-5.45%	0.77%	5.21%	0.06%
自基金合同生效起至今	-6.88%	1.04%	-14.09%	0.97%	7.21%	0.07%

海通量化成长精选 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	0.74%	0.75%	-0.63%	0.75%	1.37%	0.00%
过去三个月	-2.39%	0.70%	-4.28%	0.66%	1.89%	0.04%
过去六个月	5.36%	0.67%	1.92%	0.63%	3.44%	0.04%
过去一年	-0.13%	0.83%	-5.45%	0.77%	5.32%	0.06%
自基金合同生效起	-6.76%	1.04%	-14.09%	0.97%	7.33%	0.07%

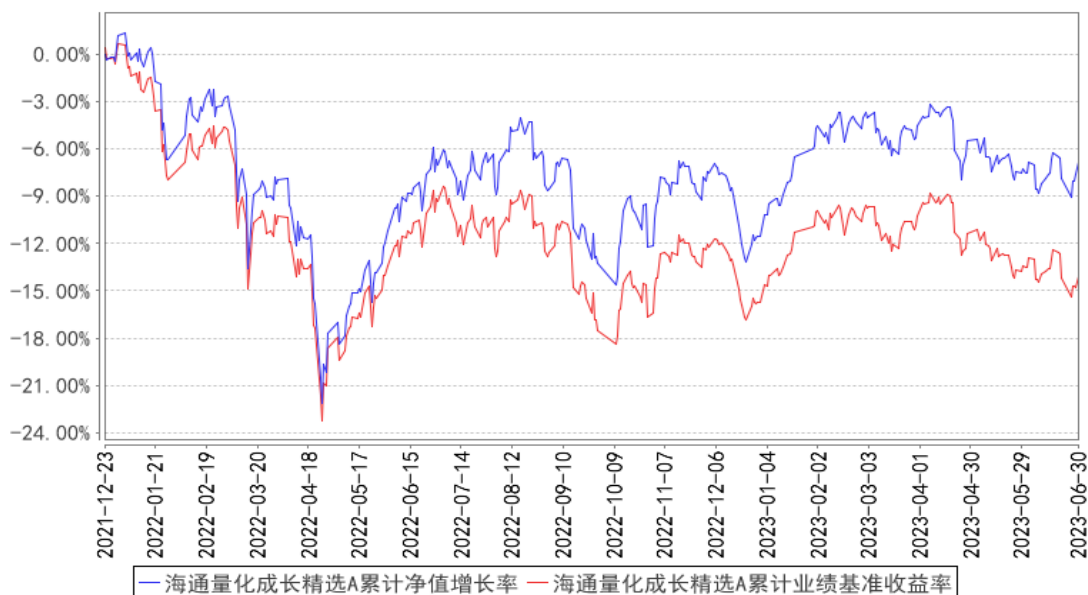
至今						
----	--	--	--	--	--	--

海通量化成长精选 C

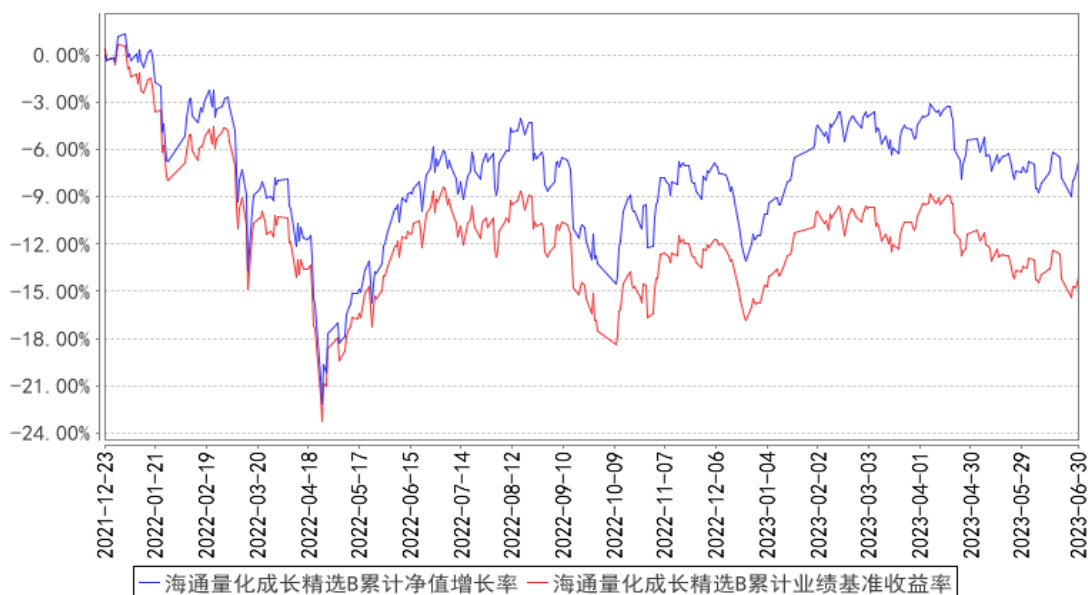
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.68%	0.75%	-0.63%	0.75%	1.31%	0.00%
过去三个月	-2.55%	0.70%	-4.28%	0.66%	1.73%	0.04%
过去六个月	5.04%	0.67%	1.92%	0.63%	3.12%	0.04%
过去一年	-0.75%	0.83%	-5.45%	0.77%	4.70%	0.06%
自基金合同生效起至今	-7.50%	1.04%	-14.09%	0.97%	6.59%	0.07%

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

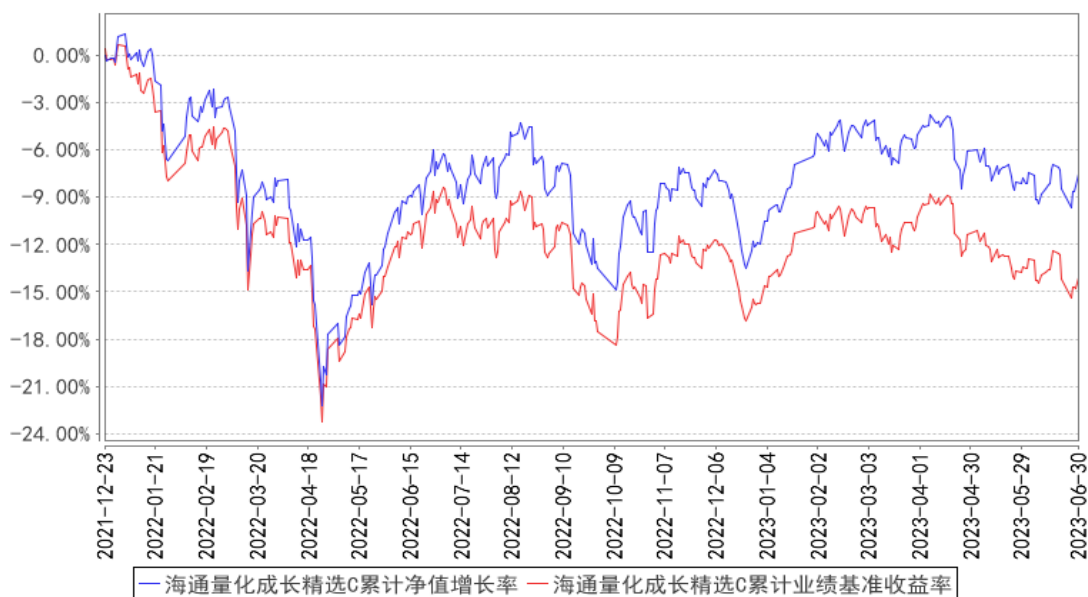
海通量化成长精选A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



海通量化成长精选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



海通量化成长精选C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

等全业务产品线。

截至 2023 年 6 月 30 日，本集合计划管理人共管理 17 只公募集合资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡倩	总经理助理，投资经理	2021 年 12 月 23 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。
董传盛	投资经理	2023 年 2 月 3 日	-	6 年	董传盛先生：吉林大学微电子系学士，复旦大学微电子系硕士，加拿大麦吉尔大学电子计算机工程系博士，曾任上海海通证券资产管理有限公司研究员，现任上海海通证券资产管理有限公司投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本集合计划进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本集合计划 A 份额净值为 1.0931 元，B 份额净值为 1.0945 元，C 份额净值为 1.0858 元。本报告期集合计划三类份额净值增长率分别为 5.31%，5.36%，5.04%，业绩比较基准收益率为 1.92%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年下半年，外部环境可能依然复杂，但国内经济仍有韧性。市场风格方面，在经历了一年多的调整后，高成长板块或许有更多投资机会，估值进一步压缩空间有限。权益资产投资价值已经显现，市场悲观情绪可能会逐渐消散，未来市场下跌空间或有限。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本集合计划本报告期无需要说明的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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

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

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

本报告期内，未发现本计划管理人存在损害份额持有人利益的行为。

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

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,688,861.69	8,918,114.23
结算备付金		1,283,089.49	1,814,642.31
存出保证金		478,640.86	939,833.57
交易性金融资产	6.4.7.2	46,272,627.15	56,638,767.53
其中：股票投资		46,272,627.15	56,638,767.53
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		208,980.36	-
应收股利		48,970.00	-
应收申购款		312.59	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		53,981,482.14	68,311,357.64
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		201,194.08	-
应付赎回款		191,380.36	-
应付管理人报酬		33,329.35	45,181.82
应付托管费		6,595.23	8,892.52
应付销售服务费		441.88	1,406.00
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	49,513.88	135,440.49
负债合计		482,454.78	190,920.83
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	48,922,285.51	65,620,024.81
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	4,576,741.85	2,500,412.00
净资产合计		53,499,027.36	68,120,436.81
负债和净资产总计		53,981,482.14	68,311,357.64

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，集合计划份额总额 48,922,285.51 份，其中海通量化成长精选 A 份额净值（暂估业绩报酬前）1.0931 元，份额总额 27,263,143.16 份，资产净值（暂估业绩报酬前）29,802,544.83 元，于 2023 年 6 月 30 日，相关暂估业绩报酬余额为 31.32 元（于 2022 年 12 月 31 日 0 元），资产净值（暂估业绩报酬后）29,802,513.51 元；海通量化成长精选 B 份额净值（暂估业绩报酬前）1.0945 元，份额总额 20,670,232.98 份，资产净值（暂估业绩报酬前）

22,622,708.01 元，于 2023 年 6 月 30 日，相关暂估业绩报酬余额为 83,081.59 元（于 2022 年 12 月 31 日 44,509.55 元），资产净值（暂估业绩报酬后）22,539,626.42 元；海通量化成长精选 C 份额净值（暂估业绩报酬前）1.0858 元，份额总额 988,909.37 份，资产净值（暂估业绩报酬前）1,073,774.52 元，于 2023 年 6 月 30 日，相关暂估业绩报酬余额为 1.65 元（于 2022 年 12 月 31 日 0 元），资产净值（暂估业绩报酬后）1,073,772.87 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：海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		4,394,119.95	-3,851,991.07
1. 利息收入		14,492.46	17,253.89
其中：存款利息收入	6.4.7.13	14,492.46	17,253.89
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,390,827.76	-6,768,136.84
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,573,379.65	-7,028,517.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	297,403.62	-412,464.04
股利收益	6.4.7.19	520,044.49	672,844.61
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	988,799.73	2,898,891.83
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	-	0.05
<b>减：二、营业总支出</b>		342,921.21	359,326.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	234,523.86	234,720.39
2. 托管费	6.4.10.2.2	46,214.75	45,993.09
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,605.85	6,411.52
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		13,212.31	-
8. 其他费用	6.4.7.23	44,364.44	72,201.64
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,051,198.74	-4,211,317.71
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,051,198.74	-4,211,317.71
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		4,051,198.74	-4,211,317.71

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	65,620,024.81	-	2,500,412.00	68,120,436.81
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)	65,620,024.81	-	2,500,412.00	68,120,436.81
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-16,697,739.30	-	2,076,329.85	-14,621,409.45
(一)、综合收益总额	-	-	4,051,198.74	4,051,198.74
(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)	-16,697,739.30	-	-1,974,868.89	-18,672,608.19
其中：1. 基金申购款	205,471.30	-	22,069.40	227,540.70
2. 基金赎回款	-16,903,210.60	-	-1,996,938.29	-18,900,148.89
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	48,922,285.51	-	4,576,741.85	53,499,027.36
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	29,781,603.61	-	5,577,126.68	35,358,730.29
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)	29,781,603.61	-	5,577,126.68	35,358,730.29
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	38,098,407.11	-	921,556.45	39,019,963.56
(一)、综合收益总额	-	-	-4,211,317.71	-4,211,317.71

(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)	38,098,407.11	-	5,132,874.16	43,231,281.27
其中: 1. 基金申购款	40,423,629.24	-	5,386,014.88	45,809,644.12
2. 基金赎回款	-2,325,222.13	-	-253,140.72	-2,578,362.85
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	67,880,010.72	-	6,498,683.13	74,378,693.85

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

海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)变更自原大集合“海通海蓝宝银集合资产管理计划”(以下简称“原集合计划”)。原集合计划为限定性集合资产管理计划,2012年6月6日经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可(2012)767号核准设立,自2012年7月2日起向社会公众发行,2012年7月18日结束募集并于2012年7月23日成立。本集合计划于2021年11月26日经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予海通海蓝宝银集合资产管理计划合同变更的回函》(机构部函[2021]3697号)批准,《海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“资产管理合同”)于2021年12月23日起正式变更生效。本集合计划为契约型开放式,自合同变更生效日起存续期不得超过3年。本集合计划的管理人为上海海通证券资产管理有限公

司，托管人为中国工商银行股份有限公司。

本集合计划根据申购/赎回规则、申购费用、赎回费用、销售服务费、业绩报酬收取方式的不同，将集合计划份额分为不同的类别。

**A 类份额：**在投资人申购时收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别集合计划资产中计提销售服务费的份额。

**B 类份额：**原集合计划份额自本资产管理合同生效之日起全部自动转换为 B 类份额。资产管理合同生效后，在本集合计划存续期间，管理人仅办理 B 类份额的赎回业务，不办理申购业务，红利再投资份额除外。对 B 类份额不设置最短持有期限，根据资产管理合同在每个开放日办理赎回业务。

**C 类份额：**从本类别集合计划资产中计提销售服务费而不收取申购费用，投资人赎回时根据持有期限收取赎回费用的份额。

本集合计划 A 类份额和 C 类份额设置最短持有期限。A 类份额和 C 类份额持有人持有的每份份额最短持有期限为一年，在最短持有期限内该类集合计划份额不可赎回或转换转出。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海通量化成长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（包含主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、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资产（含存托凭证）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  $80\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 20\% \times \text{商业银行活期存款利率}$ （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”）、2022 年中国证监会颁布的修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、2022 年财政部颁布的《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14 号）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海通量化成长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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本集合计划报告期所采用的其他会计政策、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

本集合计划本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

财政部、国家税务总局财税[2016]140 号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90

号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》对资产管理计划增值税做出相关规定。除增值税外，本集合计划比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，若遇政策法规调整，相关的税务问题将按照调整后的政策法规执行。主要税项列示如下：

### 1、增值税

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

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

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

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

### 2、印花税

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

### 3、所得税

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

## 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	5,688,861.69
等于：本金	5,688,314.94
加：应计利息	546.75
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	5,688,861.69

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	47,415,676.76	-	46,272,627.15	-1,143,049.61
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	47,415,676.76	-	46,272,627.15	-1,143,049.61

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

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

	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	4,001,400.00	-	-	-
其中：股指期货投资	4,001,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,001,400.00	-	-	-

#### 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
IM2309	IM2309	3.00	3,921,840.00	-79,560.00
合计				-79,560.00
减：可抵销期货暂收款				-79,560.00
净额				-

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

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本集合计划本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本集合计划本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。



## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

## 6.4.7.8 其他资产

注：本集合计划本报告期末其他资产无余额。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,378.84
其中：交易所市场	5,378.84
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	44,135.04
合计	49,513.88

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 海通量化成长精选 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,713,931.39	37,713,931.39
本期申购	162,070.50	162,070.50
本期赎回（以“-”号填列）	-10,612,858.73	-10,612,858.73
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	27,263,143.16	27,263,143.16

## 海通量化成长精选 B

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,776,888.46	24,776,888.46
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-4,106,655.48	-4,106,655.48
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	20,670,232.98	20,670,232.98

## 海通量化成长精选 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,129,204.96	3,129,204.96
本期申购	43,400.80	43,400.80
本期赎回（以“-”号填列）	-2,183,696.39	-2,183,696.39
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	988,909.37	988,909.37

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

## 海通量化成长精选 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,154,351.81	-1,719,935.38	1,434,416.43
本期利润	1,801,231.41	547,800.21	2,349,031.62
本期基金份额交易产生的变动数	-1,326,180.01	82,133.63	-1,244,046.38
其中：基金申购款	20,602.66	-2,922.46	17,680.20
基金赎回款	-1,346,782.67	85,056.09	-1,261,726.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,629,403.21	-1,090,001.54	2,539,401.67

## 海通量化成长精选 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,399,390.51	-4,438,988.65	960,401.86
本期利润	1,160,294.58	327,770.52	1,488,065.10
本期基金份额交易产生的变动数	-1,020,059.25	524,067.32	-495,991.93
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1,020,059.25	524,067.32	-495,991.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,539,625.84	-3,587,150.81	1,952,475.03

## 海通量化成长精选 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	253,484.16	-147,890.45	105,593.71
本期利润	100,873.02	113,229.00	214,102.02
本期基金份额交易产生的变动数	-228,351.41	-6,479.17	-234,830.58
其中：基金申购款	5,599.74	-1,210.54	4,389.20
基金赎回款	-233,951.15	-5,268.63	-239,219.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	126,005.77	-41,140.62	84,865.15

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	12,784.17
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	1,655.62
其他	52.67
合计	14,492.46

注：其他包括结算保证金利息收入、港股通风控资金利息收入。

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	155,281,216.01
减：卖出股票成本总额	152,488,273.11
减：交易费用	219,563.25
买卖股票差价收入	2,573,379.65

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本集合计划本报告期无债券投资收益。

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

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

注：本集合计划本报告期无资产支持证券投资收益。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本集合计划本报告期末未产生衍生工具买卖权证差价收入。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	297,403.62

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	520,044.49
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	520,044.49
----	------------

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	764,759.73
股票投资	764,759.73
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	224,040.00
权证投资	-
期货投资	224,040.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	988,799.73

#### 6.4.7.21 其他收入

注：本集合计划本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本集合计划本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	4,463.46
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	207.00
证券组合费	22.40
合计	44,364.44

#### 6.4.7.24 分部报告

本集合计划本报告期无分部报告。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本集合计划并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
海通证券	296,739,231.28	100.00	314,023,515.96	100.00

###### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
海通证券	37,819.38	100.00	5,378.84	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
海通证券	39,059.63	100.00	23,220.03	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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	234,523.86	234,720.39
其中：支付销售机构的客户维护费	86,739.90	75,454.17

注：本集合计划本期共发生应支付的固定管理费 234,420.88 元（其中 A 类份额 142,646.48 元，B 类份额 84,405.11 元，C 类份额 7,369.29 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 102.98 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 6%以上部分按照 25%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  $R \geq 6\%$  = 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  $R - 6.0\%$ ) \* 25% \* 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	46,214.75	45,993.09

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

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

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	海通量化成长精选 A	海通量化成长精选 B	海通量化成长精选 C	合计
工商银行	-	-	1,221.64	1,221.64
海通证券	-	-	3,306.89	3,306.89
合计	-	-	4,528.53	4,528.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	海通量化成长精选 A	海通量化成长精选 B	海通量化成长精选 C	合计
工商银行	-	-	1,413.31	1,413.31
海通证券	-	-	4,994.00	4,994.00
海通资管	-	-	0.21	0.21
合计	-	-	6,407.52	6,407.52

注：本集合计划 A 类份额、B 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.5%。

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



$$H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本集合计划报告期末与关联方通过银行间同业市场进债券（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市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1日至2023年 6月30日	本期 2023年1月1日至 2023年6月30日	本期 2023年1月1日至 2023年6月30日
	海通量化成长精选 A	海通量化成长精选 B	海通量化成长精选 C
基金合同生效日 (2021年12月23 日)持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金 份额	7,755,089.15	-	-
报告期间申购/买入 总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动 份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖 出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金 份额	7,755,089.15	-	-

报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	28.45%	-	-
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年6月30日
	海通量化成长精选 A	海通量化成长精选 B	海通量化成长精选 C
基金合同生效日 (2021年12月23 日)持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金 份额	-	-	-
报告期内申购/买入 总份额	7,755,089.15	-	-
报告期内因拆分变动 份额	-	-	-
减: 报告期内赎回/卖 出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金 份额	7,755,089.15	-	-
报告期末持有的基金 份额 占基金总份额比例	20.79%	-	-

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

注: 本报告期末除集合计划管理人之外的其他关联方未投资及持有本集合计划份额。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	5,688,861.69	12,784.17	9,832,287.46	14,981.93

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: 本集合计划本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本集合计划均无其他关联交易事项的说明。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本集合计划本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本集合计划本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本集合计划本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本集合计划本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本计划管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、经营层及其下设的合规与风险控制委员会、合规与法务部和风控与稽核部、各业务部门和职能部门构成的风险管理架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

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

本集合计划均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本集合计划投资于一家上市公司发行的证券市值不超过集合计划资产净值的 10%，且本集合

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

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

注：本集合计划本报告期末未持有长期信用评级列示的债券投资。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### **6.4.13.3 流动性风险**

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

#### **6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

#### **6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

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

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

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

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

本集合计划本报告期末无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,688,861.69	-	-	-	5,688,861.69
结算备付金	1,283,089.49	-	-	-	1,283,089.49
存出保证金	478,640.86	-	-	-	478,640.86
交易性金融资产	-	-	-	46,272,627.15	46,272,627.15
应收股利	-	-	-	48,970.00	48,970.00
应收申购款	-	-	-	312.59	312.59
应收清算款	-	-	-	208,980.36	208,980.36
资产总计	7,450,592.04	-	-	46,530,890.10	53,981,482.14

负债					
应付赎回款	-	-	-	191,380.36	191,380.36
应付管理人报酬	-	-	-	33,329.35	33,329.35
应付托管费	-	-	-	6,595.23	6,595.23
应付清算款	-	-	-	201,194.08	201,194.08
应付销售服务费	-	-	-	441.88	441.88
其他负债	-	-	-	49,513.88	49,513.88
负债总计	-	-	-	482,454.78	482,454.78
利率敏感度缺口	7,450,592.04	-	-	46,048,435.32	53,499,027.36
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,918,114.23	-	-	-	8,918,114.23
结算备付金	1,814,642.31	-	-	-	1,814,642.31
存出保证金	939,833.57	-	-	-	939,833.57
交易性金融资产	-	-	-	56,638,767.53	56,638,767.53
资产总计	11,672,590.11	-	-	56,638,767.53	68,311,357.64
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	45,181.82	45,181.82
应付托管费	-	-	-	8,892.52	8,892.52
应付销售服务费	-	-	-	1,406.00	1,406.00
其他负债	-	-	-	135,440.49	135,440.49
负债总计	-	-	-	190,920.83	190,920.83
利率敏感度缺口	11,672,590.11	-	-	56,447,846.70	68,120,436.81

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2023 年 6 月 30 日，本集合计划持有的交易性债券投资公允价值占集合计划净资产的比例为 0.00%（2022 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本集合计划净资产无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日

	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,341,075.22	-	1,341,075.22
资产合计	-	1,341,075.22	-	1,341,075.22
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	-	1,341,075.22	-	1,341,075.22
	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
项目	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				
资产合计	-	-	-	-
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	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	-		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	67,053.76	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-67,053.76	-

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	46,272,627.15	86.49	56,638,767.53	83.15
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	46,272,627.15	86.49	56,638,767.53	83.15

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

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）



	动	本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	股票价格上升 5%	2,313,631.36	2,831,938.38
	股票价格下降 5%	-2,313,631.36	-2,831,938.38

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	46,272,627.15	56,638,767.53
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	46,272,627.15	56,638,767.53

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至 2023 年 6 月 30 日，本集合计划无需要披露的其他重要事项。

### § 7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	46,272,627.15	85.72
	其中：股票	46,272,627.15	85.72
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	6,971,951.18	12.92
8	其他各项资产	736,903.81	1.37
9	合计	53,981,482.14	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 1,341,075.22 元，占资产净值比例为 2.51%。

#### 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	480,956.00	0.90
B	采矿业	1,692,092.50	3.16
C	制造业	30,416,685.21	56.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,945,222.55	3.64
E	建筑业	638,526.82	1.19
F	批发和零售业	811,669.16	1.52
G	交通运输、仓储和邮政业	333,594.00	0.62
H	住宿和餐饮业	147,810.00	0.28
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,692,545.69	5.03
J	金融业	3,921,890.54	7.33

K	房地产业	339,447.00	0.63
L	租赁和商务服务业	299,694.00	0.56
M	科学研究和技术服务业	126,367.00	0.24
N	水利、环境和公共设施管理业	565,101.40	1.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	51.26	0.00
R	文化、体育和娱乐业	374,817.80	0.70
S	综合	145,081.00	0.27
	合计	44,931,551.93	83.99

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	-	-
消费者常用品	-	-
能源	636,037.12	1.19
金融	494,826.66	0.92
医疗保健	-	-
工业	210,211.44	0.39
信息技术	-	-
电信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	1,341,075.22	2.51

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	600764	中国海防	24,400	664,168.00	1.24
2	601106	中国一重	183,900	617,904.00	1.15
3	603786	科博达	8,900	584,730.00	1.09
4	603160	汇顶科技	12,300	568,875.00	1.06
5	600582	天地科技	83,734	488,169.22	0.91
6	002444	巨星科技	19,300	422,284.00	0.79
7	600369	西南证券	114,300	417,195.00	0.78
8	600489	中金黄金	40,200	415,266.00	0.78
9	002624	完美世界	24,300	410,427.00	0.77
10	603338	浙江鼎力	6,400	358,464.00	0.67
11	002673	西部证券	55,500	352,425.00	0.66
12	688082	盛美上海	3,100	342,240.00	0.64

13	00857	中国石油股份	68,000	339,804.95	0.64
14	002568	百润股份	9,200	334,420.00	0.63
15	301029	怡合达	7,480	334,206.40	0.62
16	603868	飞科电器	5,200	328,068.00	0.61
17	002600	领益智造	47,200	326,152.00	0.61
18	002966	苏州银行	49,500	324,225.00	0.61
19	600038	中直股份	8,100	322,542.00	0.60
20	688777	中控技术	5,105	320,491.90	0.60
21	688002	睿创微纳	7,111	318,572.80	0.60
22	000739	普洛药业	17,900	317,546.00	0.59
23	300866	安克创新	3,600	315,000.00	0.59
24	01339	中国人民保险集团	120,000	314,210.78	0.59
25	002465	海格通信	29,104	300,935.36	0.56
26	300487	蓝晓科技	4,800	299,616.00	0.56
27	688072	拓荆科技	700	298,179.00	0.56
28	00386	中国石油化工股份	70,000	296,232.17	0.55
29	002223	鱼跃医疗	8,200	295,118.00	0.55
30	002025	航天电器	4,600	293,480.00	0.55
31	688385	复旦微电	5,800	290,580.00	0.54
32	000423	东阿阿胶	5,400	288,630.00	0.54
33	688289	圣湘生物	17,100	287,964.00	0.54
34	601128	常熟银行	42,000	286,440.00	0.54
35	002056	横店东磁	15,700	285,897.00	0.53
36	603688	石英股份	2,500	284,600.00	0.53
37	002422	科伦药业	9,500	281,960.00	0.53
38	600970	中材国际	21,300	271,575.00	0.51
39	002958	青农商行	99,700	271,184.00	0.51
40	688009	中国通号	46,400	269,120.00	0.50
41	600171	上海贝岭	14,500	264,625.00	0.49
42	688188	柏楚电子	1,400	263,984.00	0.49
43	600481	双良节能	18,700	261,426.00	0.49
44	603883	老百姓	8,700	259,695.00	0.49
45	600497	驰宏锌锗	51,300	257,526.00	0.48
46	603218	日月股份	13,400	254,466.00	0.48
47	002399	海普瑞	22,100	253,487.00	0.47
48	600642	申能股份	35,300	246,747.00	0.46
49	000738	航发控制	10,000	244,000.00	0.46
50	002092	中泰化学	36,600	236,070.00	0.44
51	000060	中金岭南	49,000	232,750.00	0.44
52	603858	步长制药	11,100	228,549.00	0.43
53	002273	水晶光电	18,400	219,696.00	0.41
54	600580	卧龙电驱	14,700	214,767.00	0.40

55	600909	华安证券	45,800	213,886.00	0.40
56	600316	洪都航空	9,100	213,395.00	0.40
57	600315	上海家化	7,300	211,773.00	0.40
58	600096	云天化	12,400	211,668.00	0.40
59	002249	大洋电机	37,000	210,900.00	0.39
60	688325	赛微微电	5,400	210,870.00	0.39
61	000750	国海证券	62,800	210,380.00	0.39
62	00317	中船防务	20,000	210,211.44	0.39
63	688006	杭可科技	6,894	210,060.18	0.39
64	601778	晶科科技	42,300	208,962.00	0.39
65	002518	科士达	5,200	208,052.00	0.39
66	600985	淮北矿业	17,700	203,904.00	0.38
67	600060	海信视像	8,100	200,475.00	0.37
68	601869	长飞光纤	5,400	199,854.00	0.37
69	600549	厦门钨业	10,400	197,912.00	0.37
70	600482	中国动力	8,200	192,208.00	0.36
71	300146	汤臣倍健	8,000	191,840.00	0.36
72	000959	首钢股份	54,600	191,100.00	0.36
73	000893	亚钾国际	8,300	190,402.00	0.36
74	000559	万向钱潮	34,500	188,025.00	0.35
75	600170	上海建工	68,600	184,534.00	0.34
76	600271	航天信息	13,400	183,446.00	0.34
77	603233	大参林	6,480	181,504.80	0.34
78	002353	杰瑞股份	7,200	180,936.00	0.34
79	02628	中国人寿	15,000	180,615.88	0.34
80	601966	玲珑轮胎	8,100	179,982.00	0.34
81	600905	三峡能源	33,000	177,210.00	0.33
82	600297	广汇汽车	84,900	176,592.00	0.33
83	600487	亨通光电	12,000	175,920.00	0.33
84	000967	盈峰环境	34,800	175,740.00	0.33
85	603317	天味食品	11,816	172,631.76	0.32
86	600348	华阳股份	21,750	172,042.50	0.32
87	002739	万达电影	13,700	171,798.00	0.32
88	601158	重庆水务	30,800	171,248.00	0.32
89	002595	豪迈科技	4,835	169,853.55	0.32
90	000050	深天马 A	18,500	169,830.00	0.32
91	688538	和辉光电	66,800	169,672.00	0.32
92	000155	川能动力	11,700	168,480.00	0.31
93	300438	鹏辉能源	3,500	168,140.00	0.31
94	002563	森马服饰	27,000	167,940.00	0.31
95	688772	珠海冠宇	8,300	167,245.00	0.31
96	688567	孚能科技	7,600	164,084.00	0.31
97	002408	齐翔腾达	25,300	161,161.00	0.30

98	688208	道通科技	5,300	160,643.00	0.30
99	600329	达仁堂	3,500	157,115.00	0.29
100	601098	中南传媒	13,500	156,600.00	0.29
101	000878	云南铜业	13,800	152,490.00	0.29
102	600862	中航高科	6,000	151,860.00	0.28
103	000997	新大陆	8,000	151,200.00	0.28
104	002867	周大生	8,500	151,130.00	0.28
105	603712	七一二	5,000	151,050.00	0.28
106	002372	伟星新材	7,300	149,942.00	0.28
107	002299	圣农发展	7,800	149,370.00	0.28
108	688029	南微医学	1,827	149,010.12	0.28
109	600258	首旅酒店	7,800	147,810.00	0.28
110	600901	江苏金租	35,700	147,441.00	0.28
111	300724	捷佳伟创	1,300	146,055.00	0.27
112	002945	华林证券	10,500	143,640.00	0.27
113	600718	东软集团	13,400	142,844.00	0.27
114	002500	山西证券	25,400	141,732.00	0.26
115	600155	华创云信	22,700	141,194.00	0.26
116	300118	东方日升	5,500	140,965.00	0.26
117	000039	中集集团	20,100	138,489.00	0.26
118	600906	财达证券	19,200	138,240.00	0.26
119	002939	长城证券	16,900	137,397.00	0.26
120	000415	渤海租赁	64,700	135,870.00	0.25
121	300595	欧普康视	4,500	135,855.00	0.25
122	603355	莱克电气	5,280	134,164.80	0.25
123	600967	内蒙一机	13,200	133,320.00	0.25
124	300308	中际旭创	900	132,705.00	0.25
125	300682	朗新科技	5,700	132,696.00	0.25
126	002384	东山精密	5,100	132,090.00	0.25
127	600956	新天绿能	15,100	131,672.00	0.25
128	300618	寒锐钴业	4,000	129,640.00	0.24
129	601958	金钼股份	11,600	129,340.00	0.24
130	002110	三钢闽光	30,500	128,710.00	0.24
131	000027	深圳能源	19,500	128,505.00	0.24
132	601016	节能风电	35,000	128,450.00	0.24
133	300395	菲利华	2,600	127,920.00	0.24
134	600598	北大荒	9,500	126,635.00	0.24
135	002198	嘉应制药	14,100	126,477.00	0.24
136	002065	东华软件	17,900	126,374.00	0.24
137	601665	齐鲁银行	32,000	125,440.00	0.23
138	600563	法拉电子	900	123,570.00	0.23
139	002152	广电运通	10,400	121,888.00	0.23
140	688281	华秦科技	600	121,500.00	0.23

141	300088	长信科技	20,100	121,203.00	0.23
142	603228	景旺电子	4,700	120,555.00	0.23
143	300383	光环新网	11,200	120,400.00	0.23
144	600008	首创环保	41,320	119,001.60	0.22
145	601997	贵阳银行	23,000	118,680.00	0.22
146	600623	华谊集团	19,000	118,370.00	0.22
147	002322	理工能科	11,300	117,520.00	0.22
148	600299	安迪苏	14,700	117,159.00	0.22
149	002028	思源电气	2,500	116,800.00	0.22
150	688069	德林海	5,460	115,970.40	0.22
151	688056	莱伯泰科	2,600	115,284.00	0.22
152	600109	国金证券	13,200	114,444.00	0.21
153	601233	桐昆股份	8,600	113,950.00	0.21
154	603577	汇金通	11,600	113,912.00	0.21
155	601000	唐山港	32,000	112,960.00	0.21
156	001208	华菱线缆	11,900	112,812.00	0.21
157	000990	诚志股份	14,800	112,776.00	0.21
158	605196	华通线缆	15,800	112,496.00	0.21
159	000655	金岭矿业	17,700	111,687.00	0.21
160	002212	天融信	11,500	111,550.00	0.21
161	002625	光启技术	7,300	111,398.00	0.21
162	605151	西上海	6,100	111,020.00	0.21
163	600392	盛和资源	8,600	110,682.00	0.21
164	300933	中辰股份	14,300	110,110.00	0.21
165	301097	天益医疗	2,300	110,009.00	0.21
166	002203	海亮股份	9,100	109,291.00	0.20
167	603759	海天股份	11,900	109,004.00	0.20
168	600673	东阳光	15,100	108,871.00	0.20
169	002185	华天科技	11,800	108,560.00	0.20
170	600863	内蒙华电	26,100	108,315.00	0.20
171	688329	艾隆科技	3,300	106,920.00	0.20
172	600351	亚宝药业	15,000	106,500.00	0.20
173	600359	新农开发	13,700	106,449.00	0.20
174	603903	中持股份	11,900	106,386.00	0.20
175	603987	康德莱	8,200	105,944.00	0.20
176	002724	海洋王	12,200	105,896.00	0.20
177	600968	海油发展	34,300	105,301.00	0.20
178	603579	荣泰健康	5,000	104,600.00	0.20
179	600080	金花股份	14,100	103,776.00	0.19
180	002390	信邦制药	23,200	102,776.00	0.19
181	300878	维康药业	4,500	102,150.00	0.19
182	002907	华森制药	6,700	101,974.00	0.19
183	300147	香雪制药	19,200	101,184.00	0.19

184	600885	宏发股份	3,100	98,735.00	0.18
185	002508	老板电器	3,900	98,631.00	0.18
186	603456	九洲药业	3,600	98,568.00	0.18
187	000636	风华高科	6,300	96,642.00	0.18
188	600066	宇通客车	6,400	94,336.00	0.18
189	300017	网宿科技	13,200	93,852.00	0.18
190	600637	东方明珠	11,700	91,494.00	0.17
191	000630	铜陵有色	31,400	90,746.00	0.17
192	601868	中国能建	38,573	90,260.82	0.17
193	601717	郑煤机	7,200	89,640.00	0.17
194	603589	口子窖	1,800	88,830.00	0.17
195	600535	天士力	6,100	88,511.00	0.17
196	002459	晶澳科技	2,100	87,570.00	0.16
197	000988	华工科技	2,300	87,423.00	0.16
198	000547	航天发展	8,500	85,000.00	0.16
199	600959	江苏有线	24,800	83,824.00	0.16
200	601100	恒立液压	1,300	83,629.00	0.16
201	600166	福田汽车	24,300	82,620.00	0.15
202	601168	西部矿业	7,800	81,978.00	0.15
203	603279	景津装备	2,600	81,536.00	0.15
204	603156	养元饮品	3,300	81,510.00	0.15
205	002484	江海股份	3,800	80,902.00	0.15
206	603298	杭叉集团	3,400	80,070.00	0.15
207	002128	电投能源	6,000	79,320.00	0.15
208	300316	晶盛机电	1,100	77,990.00	0.15
209	601877	正泰电器	2,800	77,420.00	0.14
210	600879	航天电子	9,100	77,259.00	0.14
211	603198	迎驾贡酒	1,200	76,560.00	0.14
212	002926	华西证券	9,200	76,452.00	0.14
213	601163	三角轮胎	4,800	76,176.00	0.14
214	600161	天坛生物	2,800	76,020.00	0.14
215	688516	奥特维	400	75,360.00	0.14
216	002179	中航光电	1,650	74,827.50	0.14
217	000783	长江证券	12,900	74,820.00	0.14
218	000596	古井贡酒	300	74,214.00	0.14
219	600143	金发科技	8,400	73,332.00	0.14
220	600600	青岛啤酒	700	72,541.00	0.14
221	603331	百达精工	4,900	72,422.00	0.14
222	603899	晨光股份	1,600	71,424.00	0.13
223	601866	中远海发	28,900	71,383.00	0.13
224	603367	辰欣药业	4,700	71,346.00	0.13
225	300777	中简科技	1,500	70,890.00	0.13
226	601577	长沙银行	9,100	70,616.00	0.13



227	002244	滨江集团	8,000	70,560.00	0.13
228	002010	传化智联	13,200	70,224.00	0.13
229	601156	东航物流	5,400	70,200.00	0.13
230	600323	瀚蓝环境	3,700	70,041.00	0.13
231	600377	宁沪高速	7,100	69,793.00	0.13
232	300470	中密控股	1,500	69,330.00	0.13
233	001914	招商积余	4,600	69,230.00	0.13
234	300373	扬杰科技	1,700	68,969.00	0.13
235	601179	中国西电	12,400	67,084.00	0.13
236	002304	洋河股份	500	65,675.00	0.12
237	000975	银泰黄金	5,600	65,520.00	0.12
238	603129	春风动力	400	64,760.00	0.12
239	601555	东吴证券	9,300	64,542.00	0.12
240	603369	今世缘	1,209	63,835.20	0.12
241	000568	泸州老窖	300	62,871.00	0.12
242	002463	沪电股份	3,000	62,820.00	0.12
243	300776	帝尔激光	960	62,304.00	0.12
244	601077	渝农商行	17,300	62,107.00	0.12
245	000807	云铝股份	4,800	61,104.00	0.11
246	000898	鞍钢股份	21,800	60,604.00	0.11
247	300568	星源材质	3,500	60,165.00	0.11
248	600529	山东药玻	2,200	59,884.00	0.11
249	601231	环旭电子	4,000	59,840.00	0.11
250	600808	马钢股份	23,000	59,110.00	0.11
251	603267	鸿远电子	900	58,770.00	0.11
252	002340	格林美	8,500	58,735.00	0.11
253	000581	威孚高科	3,700	58,275.00	0.11
254	000066	中国长城	4,200	58,086.00	0.11
255	600765	中航重机	2,180	57,791.80	0.11
256	002138	顺络电子	2,400	57,384.00	0.11
257	300009	安科生物	5,700	57,000.00	0.11
258	002506	协鑫集成	19,400	56,842.00	0.11
259	688276	百克生物	900	56,340.00	0.11
260	600372	中航电子	3,700	56,166.00	0.10
261	300850	新强联	1,500	56,070.00	0.10
262	688116	天奈科技	1,200	54,900.00	0.10
263	300003	乐普医疗	2,400	54,264.00	0.10
264	002557	洽洽食品	1,300	54,015.00	0.10
265	601991	大唐发电	16,200	53,622.00	0.10
266	603568	伟明环保	3,000	52,530.00	0.10
267	600867	通化东宝	5,012	52,325.28	0.10
268	300442	润泽科技	1,700	52,292.00	0.10
269	000869	张裕 A	1,700	52,122.00	0.10

270	002690	美亚光电	2,000	51,500.00	0.10
271	603866	桃李面包	5,024	50,842.88	0.10
272	300294	博雅生物	1,400	50,792.00	0.09
273	002936	郑州银行	22,000	50,600.00	0.09
274	300482	万孚生物	1,900	50,597.00	0.09
275	605077	华康股份	1,900	50,312.00	0.09
276	600597	光明乳业	4,800	49,920.00	0.09
277	603383	顶点软件	900	49,878.00	0.09
278	002901	大博医疗	1,600	49,728.00	0.09
279	600926	杭州银行	4,200	49,350.00	0.09
280	600362	江西铜业	2,600	49,348.00	0.09
281	601567	三星医疗	3,900	49,257.00	0.09
282	603444	吉比特	100	49,111.00	0.09
283	688105	诺唯赞	1,600	48,784.00	0.09
284	600570	恒生电子	1,100	48,719.00	0.09
285	300529	健帆生物	2,100	48,678.00	0.09
286	688819	天能股份	1,318	48,555.12	0.09
287	002929	润建股份	1,100	47,751.00	0.09
288	603187	海容冷链	2,380	47,576.20	0.09
289	600511	国药股份	1,200	46,620.00	0.09
290	603225	新凤鸣	4,200	46,410.00	0.09
291	000998	隆平高科	3,000	46,050.00	0.09
292	600079	人福医药	1,700	45,798.00	0.09
293	000883	湖北能源	9,900	45,144.00	0.08
294	600498	烽火通信	2,200	44,814.00	0.08
295	000728	国元证券	6,800	44,336.00	0.08
296	000400	许继电气	1,900	43,795.00	0.08
297	600998	九州通	4,172	43,305.36	0.08
298	600157	永泰能源	30,400	43,168.00	0.08
299	601139	深圳燃气	5,900	43,011.00	0.08
300	000683	远兴能源	5,900	42,421.00	0.08
301	002146	荣盛发展	26,800	41,272.00	0.08
302	000937	冀中能源	6,400	40,832.00	0.08
303	600917	重庆燃气	6,000	40,800.00	0.08
304	000930	中粮科技	5,000	40,500.00	0.08
305	002385	大北农	6,100	40,260.00	0.08
306	000402	金融街	8,800	39,776.00	0.07
307	600648	外高桥	3,500	39,585.00	0.07
308	000729	燕京啤酒	3,100	38,657.00	0.07
309	600499	科达制造	3,400	38,624.00	0.07
310	600663	陆家嘴	3,900	38,493.00	0.07
311	601118	海南橡胶	8,400	37,632.00	0.07
312	600699	均胜电子	2,100	37,044.00	0.07

313	600667	太极实业	5,100	37,026.00	0.07
314	600809	山西汾酒	200	37,014.00	0.07
315	002409	雅克科技	500	36,440.00	0.07
316	603927	中科软	940	36,246.40	0.07
317	000009	中国宝安	3,000	36,210.00	0.07
318	688248	南网科技	900	34,551.00	0.06
319	000031	大悦城	9,000	32,940.00	0.06
320	002373	千方科技	2,400	32,736.00	0.06
321	601198	东兴证券	4,000	32,080.00	0.06
322	603596	伯特利	400	31,704.00	0.06
323	300832	新产业	500	29,500.00	0.06
324	601699	潞安环能	1,800	29,376.00	0.05
325	600546	山煤国际	2,000	28,940.00	0.05
326	002080	中材科技	1,400	28,728.00	0.05
327	000537	广宇发展	2,400	28,008.00	0.05
328	603737	三棵树	420	27,476.40	0.05
329	601828	美凯龙	5,700	27,303.00	0.05
330	000785	居然之家	7,100	27,051.00	0.05
331	300001	特锐德	1,300	27,014.00	0.05
332	002078	太阳纸业	2,519	26,928.11	0.05
333	600567	山鹰国际	11,600	26,564.00	0.05
334	002850	科达利	200	26,450.00	0.05
335	002507	涪陵榨菜	1,430	26,183.30	0.05
336	600655	豫园股份	3,800	26,068.00	0.05
337	002429	兆驰股份	4,700	25,850.00	0.05
338	603529	爱玛科技	800	25,776.00	0.05
339	000703	恒逸石化	3,800	25,764.00	0.05
340	002701	奥瑞金	5,700	25,707.00	0.05
341	601636	旗滨集团	2,800	24,136.00	0.05
342	002266	浙富控股	5,800	23,954.00	0.04
343	002242	九阳股份	1,600	23,920.00	0.04
344	300012	华测检测	1,200	23,400.00	0.04
345	603605	珀莱雅	208	23,379.20	0.04
346	002127	南极电商	6,000	22,980.00	0.04
347	002925	盈趣科技	1,180	22,892.00	0.04
348	601611	中国核建	2,700	22,815.00	0.04
349	601992	金隅集团	10,300	22,454.00	0.04
350	600801	华新水泥	1,800	22,230.00	0.04
351	688234	天岳先进	300	22,182.00	0.04
352	002081	金螳螂	4,900	22,099.00	0.04
353	600707	彩虹股份	4,600	21,896.00	0.04
354	600737	中粮糖业	2,700	21,735.00	0.04
355	000401	冀东水泥	2,900	21,373.00	0.04

356	002745	木林森	2,300	21,160.00	0.04
357	600054	黄山旅游	1,600	20,480.00	0.04
358	600380	健康元	1,600	20,336.00	0.04
359	300073	当升科技	400	20,132.00	0.04
360	000156	华数传媒	2,300	20,010.00	0.04
361	603127	昭衍新药	480	19,632.00	0.04
362	601058	赛轮轮胎	1,700	19,363.00	0.04
363	601928	凤凰传媒	1,607	18,319.80	0.03
364	300922	天秦装备	900	17,991.00	0.03
365	300699	光威复材	560	17,276.00	0.03
366	600398	海澜之家	2,400	16,512.00	0.03
367	600177	雅戈尔	2,500	15,775.00	0.03
368	002458	益生股份	1,200	14,820.00	0.03
369	002738	中矿资源	280	14,263.20	0.03
370	600839	四川长虹	2,700	13,635.00	0.03
371	002368	太极股份	300	12,351.00	0.02
372	002511	中顺洁柔	1,100	12,265.00	0.02
373	002531	天顺风能	800	12,184.00	0.02
374	600131	国网信通	600	12,114.00	0.02
375	603000	人民网	400	11,680.00	0.02
376	600418	江淮汽车	900	11,331.00	0.02
377	603517	绝味食品	300	11,145.00	0.02
378	000591	太阳能	1,600	10,848.00	0.02
379	600517	国网英大	1,900	10,830.00	0.02
380	600021	上海电力	1,000	10,770.00	0.02
381	600705	中航产融	2,800	10,724.00	0.02
382	601990	南京证券	1,300	10,634.00	0.02
383	600516	方大炭素	1,700	10,540.00	0.02
384	002423	中粮资本	1,300	10,400.00	0.02
385	002797	第一创业	1,800	10,296.00	0.02
386	600390	五矿资本	1,900	10,222.00	0.02
387	600820	隧道股份	1,700	10,217.00	0.02
388	600095	湘财股份	1,300	10,140.00	0.02
389	601108	财通证券	1,400	10,136.00	0.02
390	002131	利欧股份	4,300	9,890.00	0.02
391	601162	天风证券	3,300	9,834.00	0.02
392	000563	陕国投 A	3,200	9,760.00	0.02
393	600927	永安期货	600	9,756.00	0.02
394	600895	张江高科	700	9,744.00	0.02
395	000623	吉林敖东	600	9,624.00	0.02
396	600208	新湖中宝	3,800	9,424.00	0.02
397	600827	百联股份	700	9,359.00	0.02
398	603885	吉祥航空	600	9,258.00	0.02

399	300888	稳健医疗	220	9,167.40	0.02
400	600415	小商品城	1,000	8,530.00	0.02
401	002985	北摩高科	190	8,382.80	0.02
402	300251	光线传媒	1,000	8,090.00	0.02
403	300058	蓝色光标	800	7,736.00	0.01
404	300037	新宙邦	100	5,189.00	0.01
405	603613	国联股份	123	4,542.39	0.01
406	603658	安图生物	84	4,345.32	0.01
407	603816	顾家家居	26	991.90	0.00
408	603707	健友股份	40	540.00	0.00
409	603893	瑞芯微	7	509.95	0.00
410	000685	中山公用	35	264.95	0.00
411	600528	中铁工业	22	217.36	0.00
412	600864	哈投股份	34	173.74	0.00
413	300227	光韵达	20	159.40	0.00
414	000686	东北证券	20	138.80	0.00
415	601568	北元集团	10	52.70	0.00
416	300244	迪安诊断	2	51.26	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600764	中国海防	975,138.00	1.43
2	01339	中国人民保险集团	430,322.80	0.63
2	601319	中国人保	415,920.00	0.61
3	603160	汇顶科技	839,643.00	1.23
4	02628	中国人寿	417,756.57	0.61
4	601628	中国人寿	408,807.00	0.60
5	002444	巨星科技	817,519.00	1.20
6	601106	中国一重	720,855.00	1.06
7	603786	科博达	673,046.00	0.99
8	002690	美亚光电	672,352.00	0.99
9	600489	中金黄金	671,225.00	0.99
10	002624	完美世界	654,879.00	0.96
11	002056	横店东磁	638,533.00	0.94
12	002506	协鑫集成	604,700.00	0.89
13	600549	厦门钨业	586,003.00	0.86
14	000050	深天马 A	579,166.00	0.85
15	603688	石英股份	565,481.00	0.83
16	002595	豪迈科技	552,001.00	0.81
17	301029	怡合达	545,586.00	0.80

18	000783	长江证券	544,798.00	0.80
19	002153	石基信息	539,721.83	0.79
20	000739	普洛药业	534,063.00	0.78

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	300308	中际旭创	1,381,313.00	2.03
2	600885	宏发股份	1,119,371.00	1.64
3	300832	新产业	963,686.00	1.41
4	603596	伯特利	952,315.00	1.40
5	603228	景旺电子	941,275.00	1.38
6	002409	雅克科技	940,431.00	1.38
7	002273	水晶光电	903,583.00	1.33
8	002690	美亚光电	875,468.00	1.29
9	601231	环旭电子	852,393.00	1.25
10	300357	我武生物	832,005.00	1.22
11	600862	中航高科	822,959.62	1.21
12	000783	长江证券	804,659.00	1.18
13	600521	华海药业	771,063.00	1.13
14	600968	海油发展	770,946.00	1.13
15	601607	上海医药	753,919.30	1.11
16	002153	石基信息	751,453.52	1.10
17	002399	海普瑞	738,847.00	1.08
18	002384	东山精密	738,674.00	1.08
19	000869	张裕 A	731,914.62	1.07
20	603127	昭衍新药	710,727.00	1.04

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	141,357,373.00
卖出股票收入（成交）总额	155,281,216.01

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**

无

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

无

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，西南证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾被宁夏证监局及重庆证监局出具警示函。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	478,640.86
2	应收清算款	208,980.36
3	应收股利	48,970.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	312.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	736,903.81

#### 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 (%)
海通量化成长精选 A	391	69,726.71	7,755,089.15	28.45	19,508,054.01	71.55
海通量化成长精选 B	119	173,699.44	-	-	20,670,232.98	100.00
海通量化成长精选 C	76	13,011.97	-	-	988,909.37	100.00
合计	586	83,485.13	7,755,089.15	15.85	41,167,196.36	84.15

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	海通量化成长精选 A	335,470.66	1.2305
	海通量化成长精选 B	271,123.41	1.3117
	海通量化成长精选 C	1,743.55	0.1763
	合计	608,337.62	1.2435

注：本表报告期末持有份额总数占总份额比例的计算中，A、B、C 级比例分母为各自级别的份额。

#### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	------	-------------------



本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海通量化成长精选 A	10~50
	海通量化成长精选 B	10~50
	海通量化成长精选 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	海通量化成长精选 A	10~50
	海通量化成长精选 B	10~50
	海通量化成长精选 C	0
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海通量化成长精选 A	海通量化成长精选 B	海通量化成长精选 C
基金合同生效日（2021 年 12 月 23 日）基金份额总额	-	29,781,603.61	-
本报告期期初基金份额总额	37,713,931.39	24,776,888.46	3,129,204.96
本报告期基金总申购份额	162,070.50	-	43,400.80
减：本报告期基金总赎回份额	10,612,858.73	4,106,655.48	2,183,696.39
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	27,263,143.16	20,670,232.98	988,909.37

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无集合计划份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、本报告期本集合计划管理人无重大人事变动。
- 2、本报告期内，集合计划托管人的专门集合计划托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

1. 因金融委托理财合同纠纷，四川信托有限公司向四川省成都市中级人民法院起诉，要求上海海通证券资产管理有限公司等多个被告返还或赔偿原告委托财产 51,455 万元及相应利息。

2022 年 11 月 10 日案件开庭，开庭结果正等待法院后续通知。

2. 报告期内未发生涉及基金托管业务的重大诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

无

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内集合计划管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本集合托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
海通证券	2	296,739,231.28	100.00	37,819.38	100.00	-

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

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

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，未发现影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准海通海蓝宝银集合资产管理计划资产管理合同变更的文件
- （二）《海通量化成长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）《海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议》
- （四）法律意见书
- （五）管理人业务资格批件、营业执照
- （六）托管人业务资格批件、营业执照
- （七）业务规则
- （八）中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

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

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

客户服务中心电话：95553

上海海通证券资产管理有限公司

2023 年 8 月 31 日