海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划
2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：上海海通证券资产管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 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。本年度报告已经全部董事签字同意，并由董事长签发。

集合计划托管人中国工商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2025 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告的财务资料经审计，立信会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期为 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 12 月 31 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 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 9
3.3 过去三年基金的利润分配情况 13

§4 管理人报告 13

4.1 基金管理人及基金经理情况 13
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 14
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 15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
4.9 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 16

§5 托管人报告 16

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
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 16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 16

§6 审计报告 17

6.1 审计报告基本信息 17
6.2 审计报告的基本内容 17

§7 年度财务报表 19

7.1 资产负债表 19
7.2 利润表 20
7.3 净资产变动表 22
7.4 报表附注 23

§8 投资组合报告 52

8.1 期末基金资产组合情况 52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 53

8.3 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 54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 61
8.6 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 62
8.7 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 62
8.8 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 62
8.9 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 62
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 62
8.12 投资组合报告附注 62

§9 基金份额持有人信息 63

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 63
9.3 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 64

§10 开放式基金份额变动 64

§11 重大事件揭示 64

11.1 基金份额持有人大会决议 64
11.2 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 64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 65
11.4 基金投资策略的改变 65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 65
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 65
11.8 其他重大事件 66

§12 影响投资者决策的其他重要信息 66

12.1 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 66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 67

§13 备查文件目录 67

13.1 备查文件目录 67
13.2 存放地点 67
13.3 查阅方式 67

§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	66,715,052.61 份		
基金合同存续期	2021 年 2 月 24 日至 2025 年 6 月 30 日		
下属分级基金的基金简称	海通量化价值精选 A	海通量化价值精选 B	海通量化价值精选 C
下属分级基金的交易代码	850088	850004	850099
报告期末下属分级基金的份额总额	39,729,553.72 份	22,972,821.92 份	4,012,676.97 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现集合计划资产的增值。
投资策略	本集合计划基于长期量化研究构建投资模型，坚持数据驱动，挖掘市场中的潜在逻辑，通过优化量化投资模型来规避情绪带来的负面影响，力图获得超越业绩基准的投资回报。 本集合计划基于实证检验，选取出符合 A 股投资逻辑的因子，并根据对经济周期和资本市场发展的不同阶段的分析和判断动态调整因子权重，从而构建多因子选股体系。策略组合构建方法包括：（1）筛选有效因子；（2）动态优化因子权重；（3）生成股票组合并优化股票权重；（4）港股投资策略。 主要投资策略有：资产配置策略、以超越业绩基准为目的的股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略、融资业务投资策略、其他金融衍生产品的投资策略。
业绩比较基准	80%×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	本集合计划为混合型集合资产管理计划，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划。 本集合计划可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	上海海通证券资产管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	吴文然	王棐庭
	联系电话	021-23154762	021-68089632
	电子邮箱	htam@haitong.com	wangfeiting@sh.icbc.com.cn
客户服务电话		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		路颖	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.htsamc.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区南京东路 61 号 4 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年			2023 年			2022 年		
	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	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	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	327,541.24	173,784.73	35,522.22	-1,564,978.62	-891,411.74	-155,502.91	-13,129,354.41	-5,283,346.60	-1,467,235.88

益									
本期利润	6,946,480.56	4,435,275.22	642,704.52	-2,183,171.27	-1,332,477.93	-132,799.98	-17,535,505.29	-6,889,352.25	-1,855,603.08
加权平均基金份额本期利润	0.1500	0.1625	0.1467	-0.0380	-0.0453	-0.0259	-0.2417	-0.2311	-0.2376
本期加权平均净值利润率	15.21%	16.44%	15.08%	-3.75%	-4.47%	-2.58%	-23.02%	-22.04%	-22.80%
本期基金份额净值增长率	16.73%	16.83%	16.13%	-4.80%	-4.70%	-5.27%	-18.98%	-18.90%	-19.39%
3.1.2 期末数	2024 年末			2023 年末			2022 年末		

据和指标									
期末可供分配利润	1,185,849.28	2,366,944.13	46,264.63	-3,098,828.12	-1,615,878.22	-338,792.01	-685,906.35	-277,165.43	-133,572.97
期末可供分配基金份额利润	0.0298	0.1030	0.0115	-0.0583	-0.0559	-0.0709	-0.0108	-0.0093	-0.0192
期末基金资产净值	43,669,708.76	25,339,766.05	4,329,482.30	50,066,445.44	27,288,301.49	4,436,911.86	62,777,897.05	29,521,112.98	6,825,184.84
期末基金份额净值	1.0992	1.1030	1.0790	0.9417	0.9441	0.9291	0.9892	0.9907	0.9808
3.1.3 累计	2024 年末			2023 年末			2022 年末		

期末指标									
基金份额累计净值增长率	-12.50%	-12.20%	-14.11%	-25.04%	-24.85%	-26.04%	-21.26%	-21.14%	-21.93%

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
过去三个月	-0.26%	1.60%	-1.49%	1.39%	1.23%	0.21%
过去六个月	12.19%	1.48%	11.13%	1.33%	1.06%	0.15%
过去一年	16.73%	1.22%	12.05%	1.07%	4.68%	0.15%
过去三年	-9.98%	1.06%	-15.79%	0.94%	5.81%	0.12%
自基金合同生效起至今	-12.50%	1.04%	-21.80%	0.93%	9.30%	0.11%

海通量化价值精选 B

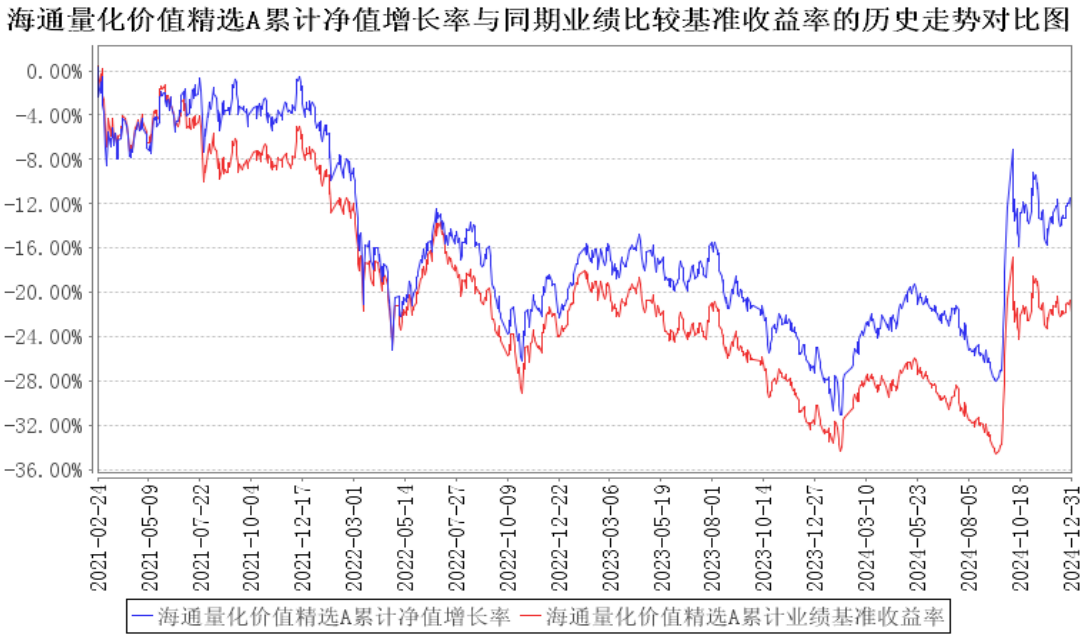
阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较	业绩比较基	①－③	②－④

	增长率①	长率标准差②	基准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	-0.24%	1.60%	-1.49%	1.39%	1.25%	0.21%
过去六个月	12.23%	1.48%	11.13%	1.33%	1.10%	0.15%
过去一年	16.83%	1.21%	12.05%	1.07%	4.78%	0.14%
过去三年	-9.71%	1.06%	-15.79%	0.94%	6.08%	0.12%
自基金合同生效起至今	-12.20%	1.04%	-21.80%	0.93%	9.60%	0.11%

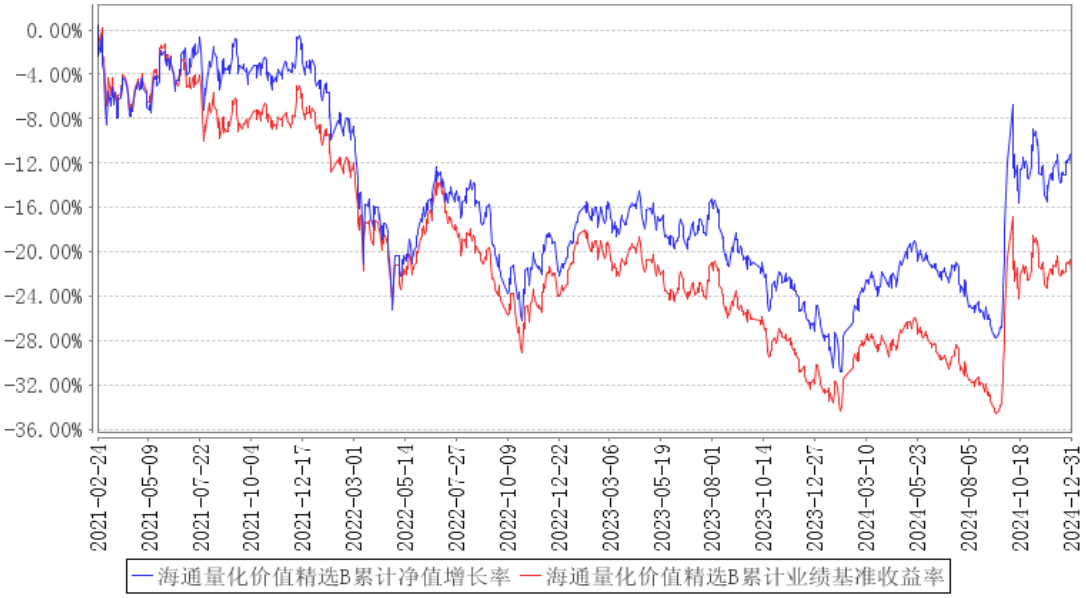
海通量化价值精选 C

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
过去三个月	-0.39%	1.60%	-1.49%	1.39%	1.10%	0.21%
过去六个月	11.89%	1.48%	11.13%	1.33%	0.76%	0.15%
过去一年	16.13%	1.21%	12.05%	1.07%	4.08%	0.14%
过去三年	-11.32%	1.06%	-15.79%	0.94%	4.47%	0.12%
自基金合同生效起至今	-14.11%	1.04%	-21.80%	0.93%	7.69%	0.11%

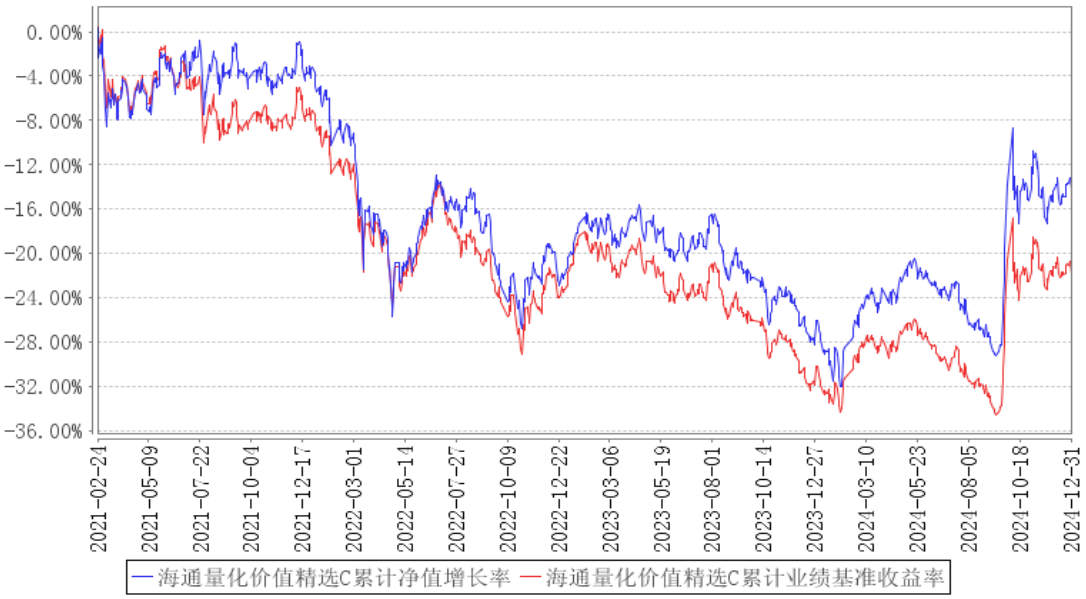
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



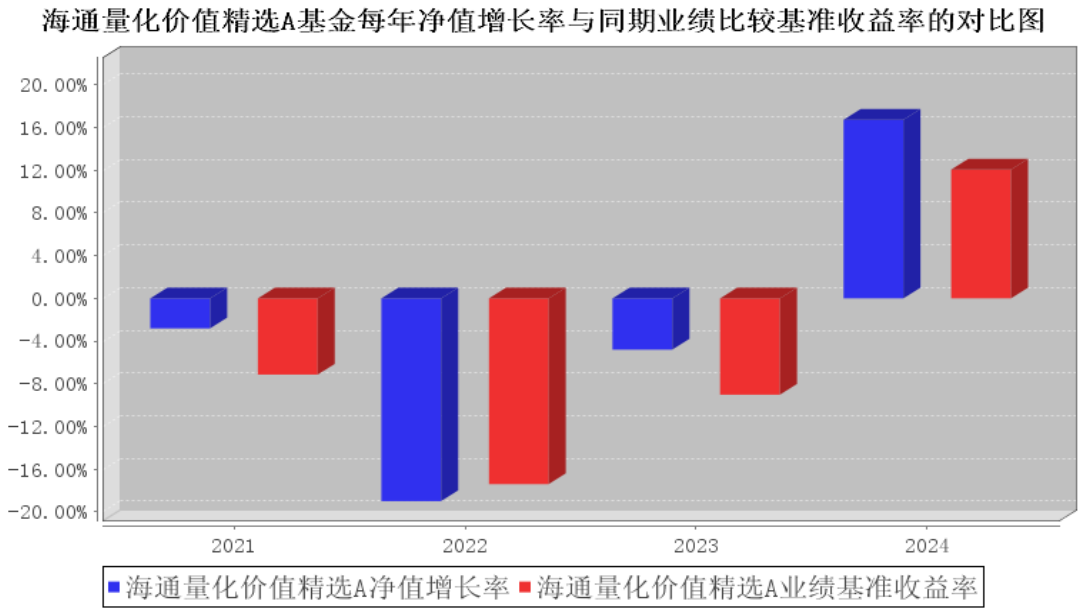
海通量化价值精选B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

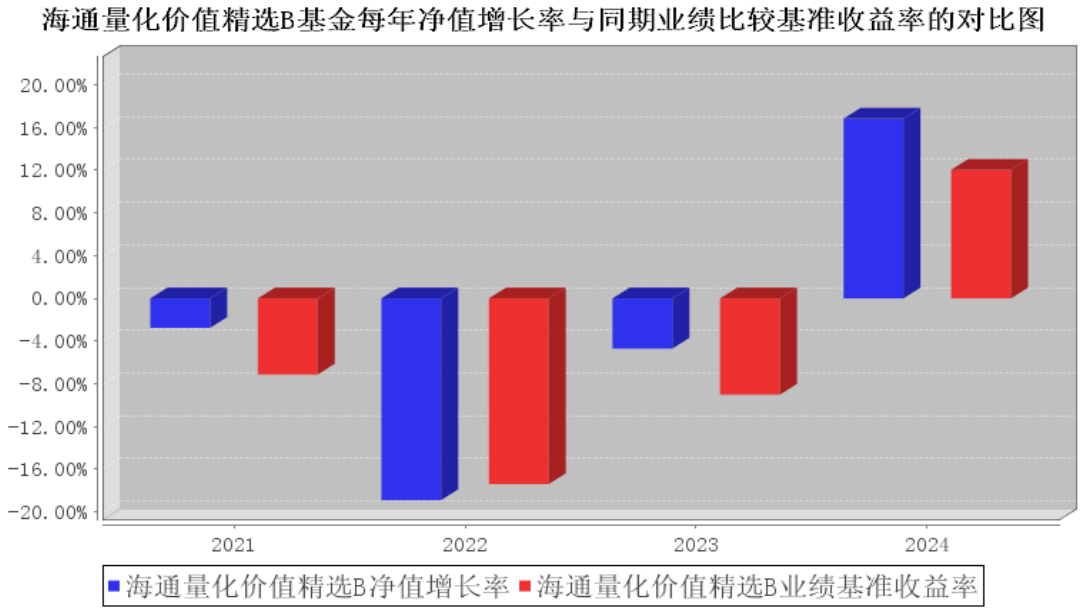


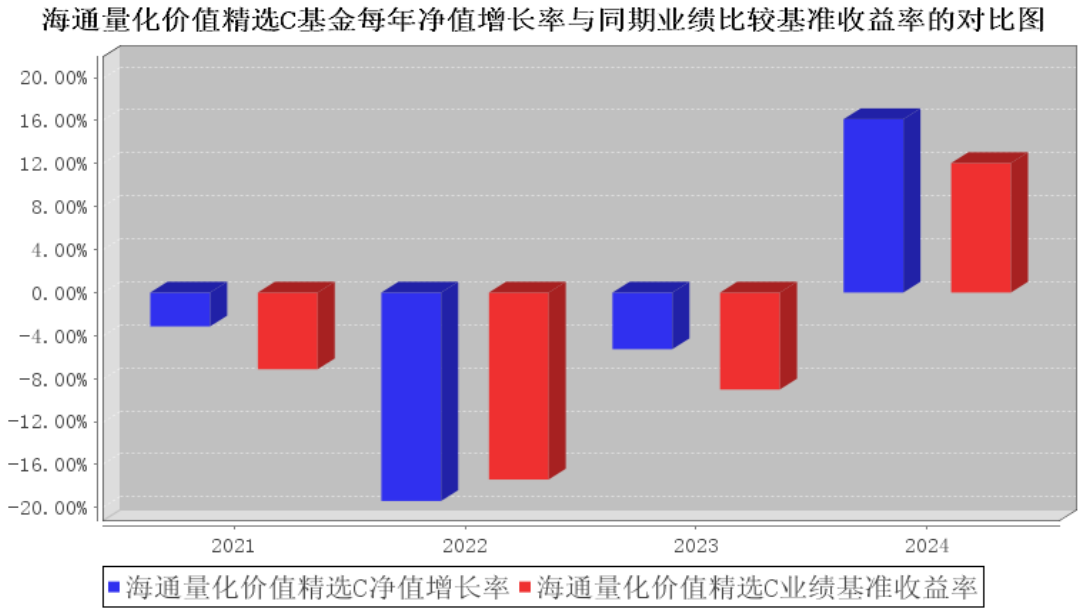
海通量化价值精选C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较







3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本集合计划2021年2月24日（集合计划合同生效日）至2024年12月31日未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2024 年 12 月 31 日，集合资产管理计划管理人共管理 17 只公募集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡倩	投资经理	2021 年 2 月 24 日	-	22 年	胡倩女士:上海财经大学经济学博士，现任上海海通证券资产管理有限公司专家。曾任海通证券首席分析师，长信基金金融工程总监、基金经理。
董传	投资经理	2023 年 2	2024 年	8 年	董传盛先生：吉林大学微电子系学士，复

盛		月 3 日	12 月 27 日		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。

4.1.3 基金经理薪酬机制

公司以《上海海通证券资产管理有限公司薪酬管理办法》为核心建立薪酬管理体系，根据员工不同的工作内容及工作职责，设立不同序列、不同职级。基金经理薪酬严格按照《上海海通证券资产管理有限公司薪酬管理办法》进行管理。

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 公平交易制度和控制方法

本管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的具体要求，建立了与公平交易相关的管理制度，通过集中交易和公平的交易分配制度，确保管理的各产品享有公平的交易执行机会，同时定期对同向交易、反向交易等进行监控和分析，通过对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，确保公司在投资管理活动中公平对待各投资组合，避免利益冲突、切实防范利益输送行为。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本集合计划的管理人严格按照《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等有关法规要求加强对兼任私募资产管理计划的投资经理的投资交易行为管理和公平交易监控，确保公平对待所管理的公私募投资组合，防范利益输送行为，避免利益冲突。

4.3.3 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

2024 年 A 股走势跌宕起伏。年初历经流动性风波小盘股大幅下跌，市场短暂回升后，又因信心缺乏继续调整。9.24 政策出台后，市场信心提振，权益资产大涨，最终主要指数录得两位数涨幅。这也是上证指数连续两年调整后，首个年度正收益。总体而言，2024 年 A 股市场，体现了权益资产高波动特性，这让我们增添了一层对市场的敬畏，也提醒我们为各种可能情形做好应对。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本集合计划 A 份额净值为 1.0992 元， B 份额净值为 1.1030 元，C 份额净值为 1.0790 元。本报告期集合计划三类份额净值增长率分别为 16.73%，16.83%，16.13%，业绩比较基准收益率为 12.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，国际贸易面临挑战，地缘政治冲突不断，政策不确定性在加大。但国内正在推行的资本市场改革，有助于给资本市场创造一个良好的投资环境，新“国九条”政策的落地将推动中长期资金入市，鼓励上市公司现金分红政策也将提升投资者的获得感。deepseek 新模型的推出和《哪吒 2》连破票房纪录，让大家感受到了中国经济的创新动能和消费潜力，为新的一年开了一个好头。当下时点，市场成交已经恢复到了一个较为活跃的水平，投资者信心也在逐步回归。随着资本市场自身改革的推进，扩大内需政策的持续发力，也许可以期待 A 股市场下一个正回报年份。在投资策略上，我们基于长期量化研究构建投资模型，坚持数据驱动，挖掘市场中的潜在逻辑，通过优化量化投资模型来规避情绪带来的负面影响，力图获得超越业绩基准的投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本管理人从合法合规运作、切实维护投资人合法利益的角度出发，持续推进全面风险管理理念，优化公司内部控制体系，更新完善相关内控制度和业务流程，强化员工合规和风险意识，不断推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。本管理人秉持客观、公正的原则，通过系统监控、合规审核、信息披露、现场检查等一系列方式开展监察稽核工作，加强了风险控制与合规管理的力度，推动了内控管理体系的落实。

本集合计划管理人将继续本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理集合计划资产，加强风险控制与合规管理，确保集合计划份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本集合计划本报告期无需要说明的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

本报告期内，未发现本计划管理人存在损害份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度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 2024 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告中账务数据内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2025]第 ZA30760 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	我们审计了上海海通证券资产管理有限公司（以下简称“集合计划管理人”）作为集合计划管理人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（以下简称“海通量化价值精选”）的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的行业实务操作编制，公允反映了海通量化价值精选 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于海通量化价值精选，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	集合计划管理人对其他信息负责。其他信息包括海通量化价值精选 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	集合计划管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和

	维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，集合计划管理人管理层负责评估海通量化价值精选的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 集合计划管理人治理层负责监督海通量化价值精选的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （三）评价集合计划管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （四）对集合计划管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对海通量化价值精选持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致海通量化价值精选不能持续经营。 （五）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与集合计划管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	黄晔　　迟媛
会计师事务所的地址	上海市黄浦区南京东路 61 号 4 楼
审计报告日期	2025 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 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：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	7,692,245.72	7,989,034.50
结算备付金		1,202,614.26	1,545,890.78
存出保证金		570,228.97	541,040.92
交易性金融资产	7.4.7.2	64,182,289.76	71,915,049.92
其中：股票投资		64,182,289.76	71,915,049.92
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		52,177.65	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		73,699,556.36	81,991,016.12
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2024 年 12 月 31 日**	**上年度末 2023 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		11.48	1.47
应付赎回款		24,087.81	-

应付管理人报酬		47,604.10	52,947.17
应付托管费		9,326.92	10,358.62
应付销售服务费		1,879.32	1,869.67
应付投资顾问费		-	-
应交税费		188,689.62	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	89,000.00	134,180.40
负债合计		360,599.25	199,357.33
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	66,715,052.61	86,845,157.14
未分配利润	7.4.7.12	6,623,904.50	-5,053,498.35
净资产合计		73,338,957.11	81,791,658.79
负债和净资产总计		73,699,556.36	81,991,016.12

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，集合计划份额总额 66,715,052.61 份，其中海通量化价值精选 A 份额净值（暂估业绩报酬前）1.0992 元，份额总额 39,729,553.72 份，资产净值（暂估业绩报酬前）43,669,708.76 元，相关暂估业绩报酬余额 959.72 元（于 2023 年 12 月 31 日 12.61 元），资产净值（暂估业绩报酬后） 43,668,749.04 元；海通量化价值精选 B 份额净值（暂估业绩报酬前）1.1030 元，份额总额 22,972,821.92 份，资产净值（暂估业绩报酬前）25,339,766.05 元，相关暂估业绩报酬余额 49,428.50 元（于 2023 年 12 月 31 日 0.00 元），资产净值（暂估业绩报酬后） 25,290,337.55 元；海通量化价值精选 C 份额净值（暂估业绩报酬前）1.0790 元，份额总额 4,012,676.97 份，资产净值（暂估业绩报酬前）4,329,482.30 元，相关暂估业绩报酬余额 352.24 元（于 2023 年 12 月 31 日 0.00 元），资产净值（暂估业绩报酬后）4,329,130.06 元。暂估业绩报酬为假设本集合计划于本报告期末按照当日的集合计划份额净值（计提业绩报酬前）清算，根据集合计划份额持有人持有的集合计划份额（包括未到期份额）至该日持有期间的收益情况估算的业绩报酬。该暂估业绩报酬余额是各集合计划份额持有人于期末时点的暂估业绩报酬的合计，各集合计划份额持有人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认，可能与上述暂估业绩报酬金额存在差异。

7.2 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		12,868,600.87	-2,623,578.81

1.利息收入		50,235.96	54,527.64
其中：存款利息收入	7.4.7.13	50,235.96	54,527.64
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,330,752.80	-1,641,550.54
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-1,522,331.88	-3,861,277.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	585,471.89	134,210.05
股利收益	7.4.7.19	2,267,612.79	2,085,516.77
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	11,487,612.11	-1,036,555.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		844,140.57	1,024,870.37
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	617,024.36	716,930.27
2．托管费	7.4.10.2.2	115,595.74	140,024.61
3．销售服务费	7.4.10.2.3	21,333.47	25,898.74
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	7.4.7.22	-	-
7．税金及附加		-	12,124.69
8．其他费用	7.4.7.23	90,187.00	129,892.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,024,460.30	-3,648,449.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,024,460.30	-3,648,449.18
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		12,024,460.30	-3,648,449.18

7.3 净资产变动表

会计主体：海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	86,845,157.14	-5,053,498.35	81,791,658.79
二、本期期初净资产	86,845,157.14	-5,053,498.35	81,791,658.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-20,130,104.53	11,677,402.85	-8,452,701.68
（一）、综合收益总额	-	12,024,460.30	12,024,460.30
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-20,130,104.53	-347,057.45	-20,477,161.98
其中：1.基金申购款	194,857.31	11,609.27	206,466.58
2.基金赎回款	-20,324,961.84	-358,666.72	-20,683,628.56
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	66,715,052.61	6,623,904.50	73,338,957.11
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	100,220,839.62	-1,096,644.75	99,124,194.87
二、本期期初净资产	100,220,839.62	-1,096,644.75	99,124,194.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-13,375,682.48	-3,956,853.60	-17,332,536.08
（一）、综合收益总额	-	-3,648,449.18	-3,648,449.18
（二）、本期基金份额交易产生的净资	-13,375,682.48	-308,404.42	-13,684,086.90

产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	164,107.79	-1,955.39	162,152.40
2.基金赎回款	-13,539,790.27	-306,449.03	-13,846,239.30
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	86,845,157.14	-5,053,498.35	81,791,658.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

左秀海	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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）变更自原大集合“海通稳健成长集合资产管理计划”（以下简称“原集合计划”）。原集合计划为非限定性集合资产管理计划，2009 年 5 月 31 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2009〕447 号核准设立，自 2009 年 7 月 13 日起向社会公众发行，2009 年 8 月 20 日结束募集并于 2009 年 8 月 24 日成立。本集合计划于 2021 年 1 月 22 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予海通稳健成长集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2021]263 号）批准，《海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”）于 2021 年 2 月 24 日起正式变更生效。本集合计划为契约型开放式，自合同变更生效日起存续期至 2025 年 6 月 30 日。本集合计划的管理人为上海海通证券资产管理有限公司，托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

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

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

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、银行存款、同业存单、债券回购、股指期货、股票期权、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本集合计划根据法律法规的规定参与融资业务。在法律法规允许的情况下并履行适当程序后，本集合计划可以参与融券业务和转融通证券出借业务。在法律法规允许的情况下，本集合计划可以投资各类期权品种。

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

本集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于股票的比例占集合计划资产的 60%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的 0%-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本集合计划将港股通标的股票投资的比例下限设为零，本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股通标的股票或选择不将集合计划资产投资于港股通标的股票，集合计划资产并非必然投资港股通标的股票。

本集合计划的业绩比较基准为 80%×沪深 300 指数收益率+20%×商业银行活期存款利率（税

后）。

本财务报表由本集合计划的管理人上海海通证券资产管理有限公司于 2025 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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 7.4.4、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

7.4.4.1 会计年度

自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止为一个会计年度。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划采用人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本集合计划成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本集合计划管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本集合计划现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本集合计划持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本集合计划管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本集合计划持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本集合计划将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本集合计划将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

2、金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本集合计划对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本集合计划考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的

概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本集合计划对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本集合计划按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本集合计划按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本集合计划按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本集合计划假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本集合计划对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本集合计划将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的股票投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本集合计划持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本集合计划依法有权抵销债权债务且该法定权利现在是可执行的，同时交易双方准备按净额进行结算，或同时结清资产和负债时，金融资产和负债以抵销后的净额在财务报表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行集合计划份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占集合计划净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由本集合计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则

按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本集合计划的收益分配政策为：

（1）在符合有关集合计划收益分配条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《资产管理合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

（2）本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；因红利再投资转换的份额类别，与集合计划份额持有人在收益分配基准日持有的份额同属一个类别；如集合计划份额持有人持有多个类别份额的，则根据不同类别收益分配方案分别计算该类别红利再投资份额；如投资者选择将现金红利自动转为相应类别的集合计划份额进行再投资，再投资集合计划份额的持有期限与原持有集合计划份额相同（红利再投资取得的 A 类份额和 C 类份额，其最短持有期限的起算日与原持有集合计划份额相同）；

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

（4）由于本集合计划 A 类份额、B 类份额不收取销售服务费，C 类份额收取销售服务费，各类别集合计划份额对应的可分配收益将有所不同，本集合计划同一类别的每一份集合计划份额享有同等分配权；

（5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

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

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本集合计划的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本集合计划确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

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

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

（3）根据中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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：

(一)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。

(二)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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(三)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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	7,692,245.72	7,989,034.50
等于：本金	7,691,412.86	7,988,179.09
加：应计利息	832.86	855.41
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	7,692,245.72	7,989,034.50

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		57,943,941.21	-	64,182,289.76	6,238,348.55
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		57,943,941.21	-	64,182,289.76	6,238,348.55
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		77,037,543.10	-	71,915,049.92	-5,122,493.18
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		77,037,543.10	-	71,915,049.92	-5,122,493.18

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	4,442,420.00	-	-	-
其中：股指期货投资	4,442,420.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,442,420.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 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	4,504,720.00	-	-	-
其中：股指期货投资	4,504,720.00	-	-	-
其他衍	-	-	-	-

生工具				
合计	4,504,720.00	-	-	-

7.4.7.3.2 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
IF2506	IF2506	2.00	2,346,840.00	-112,980.00
IM2503	IM2503	2.00	2,352,560.00	369,960.00
合计				256,980.00
减：可抵销期货暂收款				256,980.00
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。

7.4.7.3.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 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及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

7.4.7.8 其他资产

注：本集合计划本报告期末及上年度末其他资产均无余额。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 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	-	5,180.40
其中：交易所市场	-	5,180.40
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	89,000.00	129,000.00
合计	89,000.00	134,180.40

7.4.7.10 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	53,165,273.56	53,165,273.56
本期申购	151,641.38	151,641.38
本期赎回（以“-”号填列）	-13,587,361.22	-13,587,361.22
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	39,729,553.72	39,729,553.72

海通量化价值精选 B

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,904,179.71	28,904,179.71
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-5,931,357.79	-5,931,357.79
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	22,972,821.92	22,972,821.92

海通量化价值精选 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	4,775,703.87	4,775,703.87
本期申购	43,215.93	43,215.93
本期赎回（以“-”号填列）	-806,242.83	-806,242.83
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	4,012,676.97	4,012,676.97

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）。

7.4.7.11 其他综合收益

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

海通量化价值精选 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	519,527.62	-3,618,355.74	-3,098,828.12
本期期初	519,527.62	-3,618,355.74	-3,098,828.12
本期利润	327,541.24	6,618,939.32	6,946,480.56
本期基金份额交易产生的变动数	338,780.42	-246,277.82	92,502.60
其中：基金申购款	1,501.51	9,797.69	11,299.20
基金赎回款	337,278.91	-256,075.51	81,203.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,185,849.28	2,754,305.76	3,940,155.04

海通量化价值精选 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,610,017.18	-4,225,895.40	-1,615,878.22
本期期初	2,610,017.18	-4,225,895.40	-1,615,878.22
本期利润	173,784.73	4,261,490.49	4,435,275.22
本期基金份额交易产生的变动数	-221,867.09	-230,585.78	-452,452.87
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-221,867.09	-230,585.78	-452,452.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,561,934.82	-194,990.69	2,366,944.13

海通量化价值精选 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-15,127.34	-323,664.67	-338,792.01
本期期初	-15,127.34	-323,664.67	-338,792.01
本期利润	35,522.22	607,182.30	642,704.52
本期基金份额交易产生的变动数	25,869.75	-12,976.93	12,892.82
其中：基金申购款	-1,173.29	1,483.36	310.07

基金赎回款	27,043.04	-14,460.29	12,582.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	46,264.63	270,540.70	316,805.33

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	33,866.29	36,352.45
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	16,246.30	18,030.50
其他	123.37	144.69
合计	50,235.96	54,527.64

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。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	223,646,098.95	326,251,637.39
减：卖出股票成本总额	224,943,772.38	329,679,657.50
减：交易费用	224,658.45	433,257.25
买卖股票差价收入	-1,522,331.88	-3,861,277.36

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本集合计划本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

7.4.7.16.2 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内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 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及上年度可比期间未产生衍生工具买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	585,471.89	134,210.05

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,267,612.79	2,085,516.77
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	2,267,612.79	2,085,516.77

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	11,360,841.73	-764,155.91
股票投资	11,360,841.73	-764,155.91
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	315,460.00	-272,400.00
权证投资	-	-
期货投资	315,460.00	-272,400.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	188,689.62	-
合计	11,487,612.11	-1,036,555.91

7.4.7.21 其他收入

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间无其他收入。

7.4.7.22 信用减值损失

注：本集合计划本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	9,000.00	9,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	309.00	357.00
证券组合费	878.00	535.06
合计	90,187.00	129,892.06

7.4.7.24 分部报告

本集合计划本报告期无分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，除本集合计划管理人的股东海通证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14

日与上市公司国泰君安证券股份有限公司进行吸收合并交割外，本集合计划无需要披露的其他资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

7.4.10 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。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31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	429,496,269.44	100.00	646,365,877.35	100.00

7.4.10.1.2 权证交易

注：本集合计划本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31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	57,050.76	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31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	84,029.05	100.00	5,180.40	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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	617,024.36	716,930.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	106,191.79	122,517.08
应支付基金管理人的净管理费	510,832.57	594,413.19

注：1.本集合计划本期共发生应支付的固定管理费 589,452.49 元（其中 A 类份额 365,914.19 元，B 类份额 189,404.75 元，C 类份额 34,133.55 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×各类份额的年固定管理费率÷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 27,571.87 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≥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≥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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	115,595.74	140,024.61

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×0.15%÷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。

7.4.10.2.3 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	海通量化价值精选 A	海通量化价值精选 B	海通量化价值精选 C	合计
工商银行	-	-	5,271.92	5,271.92
海通证券	-	-	15,903.53	15,903.53
海通资管	-	-	3.66	3.66
合计	-	-	21,179.11	21,179.11
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	海通量化价值精选 A	海通量化价值精选 B	海通量化价值精选 C	合计
工商银行	-	-	5,558.11	5,558.11
海通证券	-	-	20,186.63	20,186.63
海通资管	-	-	3.65	3.65
合计	-	-	25,748.39	25,748.39

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×0.5%÷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。

7.4.10.3 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内及上年度可比期间均未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 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内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	海通量化价值精选 A	海通量化价值精选 B	海通量化价值精选 C
基金合同生效日（2021 年 2 月 24 日）持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	15,279,736.72	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	5,180,000.00	-
报告期末持有的基金	-	10,099,736.72	-

份额			
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	43.96%	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	海通量化价值精选 A	海通量化价值精选 B	海通量化价值精选 C
基金合同生效日（2021 年 2 月 24 日）持有的基金份额	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	15,279,736.72	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	15,279,736.72	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	52.86%	-

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。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

海通量化价值精选 B

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023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	43.53	10,000,000.00	34.60

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。

7.4.10.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	7,692,245.72	33,866.29	7,989,034.50	36,352.45

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

注：本集合计划本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2024 年 12 月 23 日	重大事项停牌	7.22	2025 年 1 月 7 日	6.93	6,700	51,912.38	48,374.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 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。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

7.4.13.3.2 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 7.4.12 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,692,245.72	-	-	-	7,692,245.72
结算备付金	1,202,614.26	-	-	-	1,202,614.26
存出保证金	570,228.97	-	-	-	570,228.97
交易性金融资产	-	-	-	64,182,289.76	64,182,289.76
应收股利	-	-	-	52,177.65	52,177.65
资产总计	9,465,088.95	-	-	64,234,467.41	73,699,556.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	24,087.81	24,087.81
应付管理人报酬	-	-	-	47,604.10	47,604.10
应付托管费	-	-	-	9,326.92	9,326.92
应付清算款	-	-	-	11.48	11.48
应付销售服务费	-	-	-	1,879.32	1,879.32
应交税费	-	-	-	188,689.62	188,689.62
其他负债	-	-	-	89,000.00	89,000.00
负债总计	-	-	-	360,599.25	360,599.25
利率敏感度缺口	9,465,088.95	-	-	63,873,868.16	73,338,957.11
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,989,034.50	-	-	-	7,989,034.50
结算备付金	1,545,890.78	-	-	-	1,545,890.78
存出保证金	541,040.92	-	-	-	541,040.92
交易性金融资产	-	-	-	71,915,049.92	71,915,049.92
资产总计	10,075,966.20	-	-	71,915,049.92	81,991,016.12
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	52,947.17	52,947.17
应付托管费	-	-	-	10,358.62	10,358.62
应付清算款	-	-	-	1.47	1.47
应付销售服务费	-	-	-	1,869.67	1,869.67
其他负债	-	-	-	134,180.40	134,180.40
负债总计	-	-	-	199,357.33	199,357.33
利率敏感度缺口	10,075,966.20	-	-	71,715,692.59	81,791,658.79

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2024 年 12 月 31 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%（2023 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（2023 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	12,981,376.90	-	12,981,376.90
资产合计	-	12,981,376.90	-	12,981,376.90
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	12,981,376.90	-	12,981,376.90
项目	上年度末 2023 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	-	6,657,460.06	-	6,657,460.06

资产合计	-	6,657,460.06	-	6,657,460.06
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	-	6,657,460.06	-	6,657,460.06

7.4.13.4.2.2 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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	649,068.85	332,873.00
	所有外币相对人民币贬值 5%	-649,068.85	-332,873.00

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023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	64,182,289.76	87.51	71,915,049.92	87.92
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	64,182,289.76	87.51	71,915,049.92	87.92

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注 7.4.7.3）。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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	-		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末 （2023 年 12 月 31 日 ）
	股票价格上升 5%	3,209,114.49	3,595,752.50
	股票价格下降 5%	-3,209,114.49	-3,595,752.50

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	64,133,915.76	71,915,049.92
第二层次	48,374.00	-
第三层次	-	-
合计	64,182,289.76	71,915,049.92

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 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(2023 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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，本集合计划无需要披露的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	64,182,289.76	87.09
	其中：股票	64,182,289.76	87.09
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	8,894,859.98	12.07
8	其他各项资产	622,406.62	0.84
9	合计	73,699,556.36	100.00

注：本集合计划通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 12,981,376.90 元，占资产净值比例为 17.70%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	753.29	0.00
B	采矿业	1,871,738.00	2.55
C	制造业	36,286,166.26	49.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,300,870.00	1.77
E	建筑业	398,854.76	0.54
F	批发和零售业	328,700.00	0.45
G	交通运输、仓储和邮政业	411,148.00	0.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,314,317.09	3.16
J	金融业	8,067,134.46	11.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	132,150.00	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	89,081.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	51,200,912.86	69.81

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	1,166,532.59	1.59
消费者常用品	-	-
能源	1,600,882.39	2.18
金融	3,877,986.97	5.29
医疗保健	367,841.61	0.50
工业	3,128,505.76	4.27
信息技术	1,775,607.62	2.42
电信服务	1,064,019.96	1.45
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	12,981,376.90	17.70

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。

8.3 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	000792	盐湖股份	110,300	1,815,538.00	2.48
2	01766	中国中车	190,000	881,497.48	1.20
2	601766	中国中车	91,900	770,122.00	1.05
3	002594	比亚迪	5,600	1,582,896.00	2.16
4	600372	中航机载	125,166	1,543,296.78	2.10
5	300750	宁德时代	5,045	1,341,970.00	1.83
6	01339	中国人民保险集团	345,000	1,236,402.31	1.69
7	000333	美的集团	15,900	1,195,998.00	1.63
8	600150	中国船舶	32,800	1,179,488.00	1.61
9	00981	中芯国际	40,000	1,177,922.88	1.61
10	600019	宝钢股份	168,100	1,176,700.00	1.60
11	00175	吉利汽车	85,000	1,166,532.59	1.59
12	601877	正泰电器	46,150	1,080,371.50	1.47
13	00941	中国移动	15,000	1,064,019.96	1.45
14	601318	中国平安	20,000	1,053,000.00	1.44
15	02628	中国人寿	74,000	1,005,975.77	1.37
16	00857	中国石油股份	150,000	848,715.66	1.16
16	601857	中国石油	16,700	149,298.00	0.20
17	06099	招商证券	64,000	948,264.96	1.29

17	600999	招商证券	416	7,970.56	0.01
18	002371	北方华创	2,400	938,400.00	1.28
19	600406	国电南瑞	36,600	923,052.00	1.26
20	600036	招商银行	22,900	899,970.00	1.23
21	03898	时代电气	27,000	820,101.02	1.12
21	688187	时代电气	1,500	71,880.00	0.10
22	300059	东方财富	32,300	833,986.00	1.14
23	600900	长江电力	26,600	786,030.00	1.07
24	00386	中国石油化工股份	170,000	700,549.26	0.96
24	600028	中国石化	9,800	65,464.00	0.09
25	600765	中航重机	36,600	749,202.00	1.02
26	300408	三环集团	19,400	747,094.00	1.02
27	01800	中国交通建设	133,000	676,166.63	0.92
28	002601	龙佰集团	37,800	667,926.00	0.91
29	600875	东方电气	40,400	641,956.00	0.88
30	01186	中国铁建	110,000	583,683.01	0.80
30	601186	中国铁建	5,200	47,684.00	0.07
31	688041	海光信息	4,195	628,369.05	0.86
32	002475	立讯精密	15,260	621,997.60	0.85
33	601138	工业富联	28,500	612,750.00	0.84
34	600887	伊利股份	20,200	609,636.00	0.83
35	601899	紫金矿业	40,300	609,336.00	0.83
36	03969	中国通号	186,000	597,684.74	0.81
37	600219	南山铝业	147,900	578,289.00	0.79
38	601688	华泰证券	30,900	543,531.00	0.74
39	000858	五粮液	3,852	539,434.08	0.74
40	600885	宏发股份	16,900	537,758.00	0.73
41	600104	上汽集团	25,032	519,664.32	0.71
42	000166	申万宏源	95,600	511,460.00	0.70
43	600050	中国联通	95,839	508,905.09	0.69
44	000977	浪潮信息	9,700	503,236.00	0.69
45	601166	兴业银行	26,000	498,160.00	0.68
46	688047	龙芯中科	3,736	494,198.08	0.67
47	688012	中微公司	2,550	482,358.00	0.66
48	601601	中国太保	13,600	463,488.00	0.63
49	600926	杭州银行	29,900	436,839.00	0.60
50	002736	国信证券	37,511	420,123.20	0.57
51	600031	三一重工	25,100	413,648.00	0.56
52	002128	电投能源	21,000	411,180.00	0.56
53	603296	华勤技术	5,400	383,130.00	0.52
54	601615	明阳智能	30,100	379,561.00	0.52
55	000768	中航西飞	13,400	378,416.00	0.52
56	600741	华域汽车	20,700	364,527.00	0.50

57	000651	格力电器	8,000	363,600.00	0.50
58	002938	鹏鼎控股	9,900	361,152.00	0.49
59	600276	恒瑞医药	7,849	360,269.10	0.49
60	600089	特变电工	27,616	351,827.84	0.48
61	000997	新大陆	17,600	351,120.00	0.48
62	00939	建设银行	58,000	348,042.87	0.47
63	600183	生益科技	14,200	341,510.00	0.47
64	000425	徐工机械	42,900	340,197.00	0.46
65	01658	邮储银行	80,000	339,301.06	0.46
66	601077	渝农商行	55,800	337,590.00	0.46
67	000963	华东医药	9,500	328,700.00	0.45
68	600660	福耀玻璃	5,200	324,480.00	0.44
69	002226	江南化工	59,700	323,574.00	0.44
70	601336	新华保险	6,500	323,050.00	0.44
71	601728	中国电信	44,500	321,290.00	0.44
72	601229	上海银行	34,800	318,420.00	0.43
73	02607	上海医药	27,000	315,538.87	0.43
74	002273	水晶光电	14,000	311,080.00	0.42
75	300433	蓝思科技	14,200	310,980.00	0.42
76	000725	京东方 A	70,000	307,300.00	0.42
77	002648	卫星化学	16,100	302,519.00	0.41
78	000738	航发控制	13,300	295,792.00	0.40
79	600023	浙能电力	49,700	281,302.00	0.38
80	002001	新和成	12,768	280,512.96	0.38
81	601117	中国化学	33,400	276,886.00	0.38
82	601169	北京银行	45,000	276,750.00	0.38
83	601799	星宇股份	2,000	266,960.00	0.36
84	600489	中金黄金	22,000	264,660.00	0.36
85	000807	云铝股份	19,300	261,129.00	0.36
86	000895	双汇发展	10,000	259,600.00	0.35
87	000708	中信特钢	22,500	256,725.00	0.35
88	600585	海螺水泥	10,600	252,068.00	0.34
89	601006	大秦铁路	36,200	245,436.00	0.33
90	600332	白云山	8,300	235,886.00	0.32
91	603501	韦尔股份	2,100	219,261.00	0.30
92	000776	广发证券	13,400	217,214.00	0.30
93	603290	斯达半导	2,400	215,568.00	0.29
94	002916	深南电路	1,700	212,500.00	0.29
95	600618	氯碱化工	21,500	211,990.00	0.29
96	300628	亿联网络	5,400	208,440.00	0.28
97	688126	沪硅产业	10,400	195,728.00	0.27
98	601311	骆驼股份	23,400	193,986.00	0.26
99	688223	晶科能源	26,220	186,424.20	0.25

100	688599	天合光能	9,300	179,490.00	0.24
101	601838	成都银行	9,800	167,678.00	0.23
102	01618	中国中冶	110,000	167,057.62	0.23
103	002444	巨星科技	5,100	164,985.00	0.22
104	000400	许继电气	5,900	162,427.00	0.22
105	300627	华测导航	3,600	150,480.00	0.21
106	600436	片仔癀	700	150,150.00	0.20
107	002396	星网锐捷	7,600	144,324.00	0.20
108	002028	思源电气	1,900	138,130.00	0.19
109	002265	建设工业	5,900	137,293.00	0.19
110	601100	恒立液压	2,600	137,202.00	0.19
111	002705	新宝股份	9,000	135,000.00	0.18
112	600176	中国巨石	11,800	134,402.00	0.18
113	002142	宁波银行	5,500	133,705.00	0.18
114	600380	健康元	11,800	132,986.00	0.18
115	601965	中国汽研	7,500	132,150.00	0.18
116	600862	中航高科	5,100	128,826.00	0.18
117	002839	张家港行	26,700	116,679.00	0.16
118	601825	沪农商行	12,700	108,077.00	0.15
119	688617	惠泰医疗	290	107,975.70	0.15
120	000063	中兴通讯	2,600	105,040.00	0.14
121	000423	东阿阿胶	1,600	100,352.00	0.14
122	601058	赛轮轮胎	6,600	94,578.00	0.13
123	600690	海尔智家	3,200	91,104.00	0.12
124	600919	江苏银行	9,200	90,344.00	0.12
125	603893	瑞芯微	800	88,048.00	0.12
126	600487	亨通光电	5,100	87,822.00	0.12
127	600522	中天科技	6,100	87,352.00	0.12
128	600938	中国海油	2,900	85,579.00	0.12
129	605117	德业股份	1,000	84,800.00	0.12
130	603568	伟明环保	3,900	84,357.00	0.12
131	000513	丽珠集团	2,200	83,600.00	0.11
132	603337	杰克股份	2,700	82,242.00	0.11
133	300661	圣邦股份	1,000	81,780.00	0.11
134	601919	中远海控	5,200	80,600.00	0.11
135	603019	中科曙光	1,100	79,552.00	0.11
136	300979	华利集团	1,000	78,650.00	0.11
137	600803	新奥股份	3,600	78,048.00	0.11
138	600584	长电科技	1,900	77,634.00	0.11
139	600893	航发动力	1,800	74,610.00	0.10
140	600528	中铁工业	9,200	74,152.00	0.10
141	000938	紫光股份	2,600	72,358.00	0.10
142	600583	海油工程	13,100	71,657.00	0.10

143	600096	云天化	3,200	71,360.00	0.10
144	600968	海油发展	16,400	70,028.00	0.10
145	601088	中国神华	1,600	69,568.00	0.09
146	600273	嘉化能源	8,700	69,339.00	0.09
147	601816	京沪高铁	11,200	68,992.00	0.09
148	600295	鄂尔多斯	7,000	68,320.00	0.09
149	603606	东方电缆	1,300	68,315.00	0.09
150	002202	金风科技	6,600	68,178.00	0.09
151	002340	格林美	10,300	67,259.00	0.09
152	605499	东鹏饮料	270	67,100.40	0.09
153	601377	兴业证券	10,645	66,637.70	0.09
154	601179	中国西电	8,700	66,033.00	0.09
155	600248	陕建股份	14,700	65,856.00	0.09
156	002074	国轩高科	3,100	65,782.00	0.09
157	688120	华海清科	400	65,196.00	0.09
158	000539	粤电力 A	14,200	64,326.00	0.09
159	601168	西部矿业	4,000	64,280.00	0.09
160	300832	新产业	900	63,765.00	0.09
161	000966	长源电力	13,400	63,650.00	0.09
162	688772	珠海冠宇	3,900	62,712.00	0.09
163	600271	航天信息	6,800	61,948.00	0.08
164	603235	天新药业	2,400	61,344.00	0.08
165	688122	西部超导	1,400	59,948.00	0.08
166	002410	广联达	4,900	57,624.00	0.08
167	603288	海天味业	1,200	55,080.00	0.08
168	000783	长江证券	8,000	54,560.00	0.07
169	688188	柏楚电子	280	54,390.00	0.07
170	02196	复星医药	4,000	52,302.74	0.07
171	01898	中煤能源	6,000	51,617.47	0.07
172	002179	中航光电	1,300	51,090.00	0.07
173	002252	上海莱士	6,700	48,374.00	0.07
174	002415	海康威视	1,400	42,980.00	0.06
175	000617	中油资本	4,900	33,761.00	0.05
176	600582	天地科技	5,200	32,136.00	0.04
177	000338	潍柴动力	2,200	30,140.00	0.04
178	600958	东方证券	2,300	24,288.00	0.03
179	600918	中泰证券	3,500	22,995.00	0.03
180	002311	海大集团	449	22,023.45	0.03
181	600061	国投资本	2,900	21,808.00	0.03
182	000786	北新建材	700	21,217.00	0.03
183	603195	公牛集团	295	20,720.80	0.03
184	000661	长春高新	200	19,888.00	0.03
185	000999	华润三九	440	19,509.60	0.03

186	600737	中粮糖业	1,900	19,399.00	0.03
187	600595	中孚实业	6,800	19,244.00	0.03
188	603515	欧普照明	1,100	18,095.00	0.02
189	002807	江阴银行	3,900	16,965.00	0.02
190	000100	TCL 科技	3,340	16,800.20	0.02
191	600161	天坛生物	800	16,400.00	0.02
192	600909	华安证券	2,700	16,362.00	0.02
193	002352	顺丰控股	400	16,120.00	0.02
194	601998	中信银行	2,300	16,054.00	0.02
195	600795	国电电力	3,500	16,030.00	0.02
196	000728	国元证券	1,900	15,884.00	0.02
197	000001	平安银行	1,300	15,210.00	0.02
198	300919	中伟股份	400	14,448.00	0.02
199	002011	盾安环境	1,200	12,972.00	0.02
200	600588	用友网络	1,200	12,876.00	0.02
201	600562	国睿科技	600	11,958.00	0.02
202	000683	远兴能源	2,100	11,739.00	0.02
203	688819	天能股份	400	10,888.00	0.01
204	002152	广电运通	800	9,328.00	0.01
205	600426	华鲁恒升	400	8,644.00	0.01
206	300957	贝泰妮	200	8,538.00	0.01
207	601668	中国建筑	1,400	8,400.00	0.01
208	002463	沪电股份	200	7,930.00	0.01
209	600549	厦门钨业	400	7,708.00	0.01
210	300418	昆仑万维	200	7,696.00	0.01
211	002262	恩华药业	300	7,305.00	0.01
212	601231	环旭电子	400	6,600.00	0.01
213	002555	三七互娱	400	6,256.00	0.01
214	601567	三星医疗	200	6,152.00	0.01
215	601958	金钼股份	600	6,036.00	0.01
216	300413	芒果超媒	200	5,378.00	0.01
217	601717	郑煤机	400	5,192.00	0.01
218	600323	瀚蓝环境	200	4,724.00	0.01
219	601225	陕西煤业	200	4,652.00	0.01
220	000009	中国宝安	500	4,575.00	0.01
221	603369	今世缘	100	4,523.00	0.01
222	300373	扬杰科技	100	4,352.00	0.01
223	000403	派林生物	200	4,226.00	0.01
224	601985	中国核电	400	4,172.00	0.01
225	600873	梅花生物	400	4,012.00	0.01
226	600483	福能股份	400	3,988.00	0.01
227	600131	国网信通	200	3,782.00	0.01
228	600809	山西汾酒	20	3,684.20	0.01

229	601126	四方股份	200	3,392.00	0.00
230	600886	国投电力	200	3,324.00	0.00
231	002236	大华股份	200	3,200.00	0.00
232	600699	均胜电子	200	3,134.00	0.00
233	300498	温氏股份	27	445.77	0.00
234	002714	牧原股份	8	307.52	0.00
235	603228	景旺电子	10	278.40	0.00
236	600820	隧道股份	4	28.76	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000792	盐湖股份	2,416,697.00	2.95
2	600999	招商证券	1,263,366.00	1.54
2	06099	招商证券	1,121,036.78	1.37
3	600372	中航机载	2,138,098.28	2.61
4	300750	宁德时代	2,020,057.00	2.47
5	688009	中国通号	1,049,141.97	1.28
5	03969	中国通号	864,492.33	1.06
6	601877	正泰电器	1,856,461.50	2.27
7	600406	国电南瑞	1,815,530.00	2.22
8	03328	交通银行	1,404,795.38	1.72
8	601328	交通银行	369,833.00	0.45
9	000333	美的集团	1,746,225.00	2.13
10	002475	立讯精密	1,744,956.00	2.13
11	600019	宝钢股份	1,590,324.00	1.94
12	000166	申万宏源	1,105,188.00	1.35
12	06806	申万宏源	374,182.38	0.46
13	01339	中国人民保险集团	1,390,717.92	1.70
13	601319	中国人保	80,738.00	0.10
14	601211	国泰君安	1,444,106.00	1.77
15	000963	华东医药	1,434,670.00	1.75
16	601766	中国中车	1,282,913.00	1.57
16	01766	中国中车	140,699.27	0.17
17	002415	海康威视	1,407,825.00	1.72
18	000651	格力电器	1,400,731.00	1.71
19	600031	三一重工	1,378,788.00	1.69
20	002601	龙佰集团	1,378,098.00	1.68

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。

8.4.2 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	3,545,530.00	4.33
2	600999	招商证券	2,078,032.00	2.54
2	06099	招商证券	778,108.60	0.95
3	300750	宁德时代	2,760,641.00	3.38
4	002415	海康威视	2,089,924.00	2.56
5	600104	上汽集团	2,007,253.00	2.45
6	03328	交通银行	1,493,577.04	1.83
6	601328	交通银行	397,993.00	0.49
7	000333	美的集团	1,866,150.00	2.28
8	601211	国泰君安	1,853,284.00	2.27
9	01288	农业银行	1,325,291.89	1.62
9	601288	农业银行	412,306.00	0.50
10	02238	广汽集团	1,271,124.56	1.55
10	601238	广汽集团	398,891.00	0.49
11	300919	中伟股份	1,607,445.00	1.97
12	600183	生益科技	1,556,312.00	1.90
13	000338	潍柴动力	1,500,812.00	1.83
14	000963	华东医药	1,477,811.00	1.81
15	01776	广发证券	820,589.49	1.00
15	000776	广发证券	641,321.00	0.78
16	002938	鹏鼎控股	1,434,893.00	1.75
17	03988	中国银行	1,028,530.26	1.26
17	601988	中国银行	399,466.00	0.49
18	688009	中国通号	1,153,196.94	1.41
18	03969	中国通号	274,171.84	0.34
19	000651	格力电器	1,389,781.00	1.70
20	600918	中泰证券	1,379,434.00	1.69

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关税费。

8.4.3 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	205,850,170.49
卖出股票收入（成交）总额	223,646,098.95

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

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

监测股指期货基差，适时投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

8.11.2 本期国债期货投资评价

8.12 投资组合报告附注

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

本集合计划投资的前十名证券的发行主体中中国人民保险集团在报告编制日前一年内曾收到国家金融监督管理总局处罚。本集合计划对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及产品合同的要求。

8.12.2 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。

8.12.3 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	570,228.97
2	应收清算款	-
3	应收股利	52,177.65
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	622,406.62

8.12.4 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。

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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	736	53,980.37	-	-	39,729,553.72	100.00
海通量化价值精选 B	57	403,031.96	20,099,736.72	87.49	2,873,085.20	12.51
海通量化价值精选 C	146	27,484.09	82,966.90	2.07	3,929,710.07	97.93
合计	939	71,049.04	20,182,703.62	30.25	46,532,348.99	69.75

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）。

9.2 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	156,841.20	0.3948
	海通量化价值精选 B	132,772.73	0.5780
	海通量化价值精选 C	28.77	0.0007
	合计	289,642.70	0.4341

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。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§10 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	53,165,273.56	28,904,179.71	4,775,703.87
本报告期基金总申购份额	151,641.38	-	43,215.93
减：本报告期基金总赎回份额	13,587,361.22	5,931,357.79	806,242.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	39,729,553.72	22,972,821.92	4,012,676.97

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）。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

1.2024 年 1 月 8 日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司董事会审议通过，路颖女士自 2024 年 1 月 5 日担任公司董事长。

2.2024 年 3 月 20 日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司董事会审议通过，曾丽琼女士自 2024 年 3 月 19 日不再担任公司总经理助理。

3.2024 年 9 月 20 日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司董事会审议通过，胡倩女士自 2024 年 9 月 20 日不再担任公司总经理助理。

4.本报告期集合计划托管人的专门集合计划托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

1、因金融委托理财合同纠纷，四川信托有限公司向四川省成都市中级人民法院起诉，要求上海海通证券资产管理有限公司等多个被告返还或赔偿原告委托财产 51，455 万元及相应利息。2023 年 9 月 27 日法院作出一审判决，判决驳回原告对海通资管的所有诉讼请求。上诉期内原告提起上诉，目前案件正在二审程序中。

2、报告期内未发生涉及集合计划托管业务的重大诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

无

11.5 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。本年度应支付的审计费用是 9,000.00 元，目前事务所已提供审计服务的连续年限是 4 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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，本集合计划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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	429,496,269.44	100.00	57,050.76	100.00	-

11.7.2 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	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划基金经理变更公告	规定披露媒介	2024 年 12 月 27 日
2	海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划暂停申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	规定披露媒介	2024 年 12 月 18 日
3	关于海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告	规定披露媒介	2024 年 12 月 18 日
4	上海海通证券资产管理有限公司关于终止北京中植基金销售有限公司办理旗下集合资产管理计划相关销售业务的公告	规定披露媒介	2024 年 11 月 8 日
5	海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划暂停申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	规定披露媒介	2024 年 2 月 7 日
6	关于海通量化价值精选一年持有期混合型集合资产管理计划延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告	规定披露媒介	2024 年 2 月 7 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	2024/09/12-2024/09/18,2024/09/25-202	15,279,736.72	-	5,180,000.00	10,099,736.72	15.14

		4/09/26,2024/10/09-2024/10/09					
产品特有风险							
报告期内，本集合计划存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括： 1、当集合计划份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一集合计划份额持有人大额赎回而引发集合计划净值剧烈波动的风险； 2、若某单一集合计划份额持有人巨额赎回有可能引发集合计划的流动性风险，集合计划管理人可能无法及时变现集合计划资产以应对集合计划份额持有人的赎回申请，集合计划份额持有人可能无法及时赎回持有的全部集合计划份额； 3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致集合计划资产净值连续出现六十个工作日低于 5000 万元的风险，集合计划可能会面临转换运作方式、与其他集合计划合并或者终止集合计划合同等情形； 4、其他可能的风险。							

12.2 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。

§13 备查文件目录

13.1 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

13.2 存放地点

集合计划管理人和集合计划托管人的办公场所。

13.3 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

2025 年 3 月 31 日