

海通策略优选混合型集合资产管理计划 2022 年年度报告

2022 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2023 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民生银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2023 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 2022 年 10 月 31 日起至 2022 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	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 审计报告	13
6.1 审计报告基本信息	13
6.2 审计报告的基本内容	13
§ 7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	17
7.3 净资产（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45

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	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	55
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	55
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
8.12 投资组合报告附注	56
§ 9 基金份额持有人信息	56
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 10 开放式基金份额变动	57
§ 11 重大事件揭示	58
11.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
11.4 基金投资策略的改变	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8 其他重大事件	59
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 13 备查文件目录	60
13.1 备查文件目录	60
13.2 存放地点	60
13.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海通策略优选混合型集合资产管理计划	
基金简称	海通策略优选	
基金主代码	852200	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 10 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	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	16,505,274.86 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海通策略优选 A	海通策略优选 C
下属分级基金的交易代码	852200	852289
报告期末下属分级基金的份额总额	13,461,311.11 份	3,043,963.75 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>本集合计划在投资中将以集合计划的权益类资产和固定收益类资产配置作为基础，采用量化选股模型，并将对集合计划整体的波动和风险进行控制，力求集合计划资产长期、稳定的增值。</p> <p>运用量化选股模型，力求寻找基本面良好，并能带来长期稳定超额收益的股票投资组合。另一方面，本集合计划也将对集合计划整体的波动和风险进行控制，力求在风险可控的情况下追求集合计划资产长期、稳定的增值。主要包括但不限于以下投资策略：（1）多因子选股策略；（2）事件驱动策略；（3）股票投资组合的风险控制；（4）港股通标的股票投资策略；（5）存托凭证投资策略。</p> <p>主要投资策略有：大类资产配置策略、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。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+商业银行活期存款利率（税后）×20%
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	中国民生银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	吴文然	罗菲菲
	联系电话	021-23154762	010-58560666
	电子邮箱	htam@haitong.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话	95553、4008888001	95568	
传真	021-63410460	010-57093382	
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 2 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 2 号	
邮政编码	200001	100031	
法定代表人	裴长江	高迎欣	

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	2022 年 10 月 31 日(基金合同生效日)-2022 年 12 月 31 日	
	海通策略优选 A	海通策略优选 C
本期已实现收益	220,714.66	-12,721.23
本期利润	136,991.44	-141,858.42
加权平均基金份额本期利润	0.0122	-0.1520
本期加权平均净值利润率	0.88%	-11.29%
本期基金份额净值增长率	0.21%	0.20%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	
期末可供分配利润	-53,168.67	11,562.48

期末可供分配基金份额利润	-0.0039	0.0038
期末基金资产净值	13,513,829.93	3,055,526.23
期末基金份额净值	1.0039	1.0038
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	
基金份额累计净值增长率	0.21%	0.20%

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）。

4、本财务报表的实际编制期间为 2022 年 10 月 31 日（集合计划合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海通策略优选 A

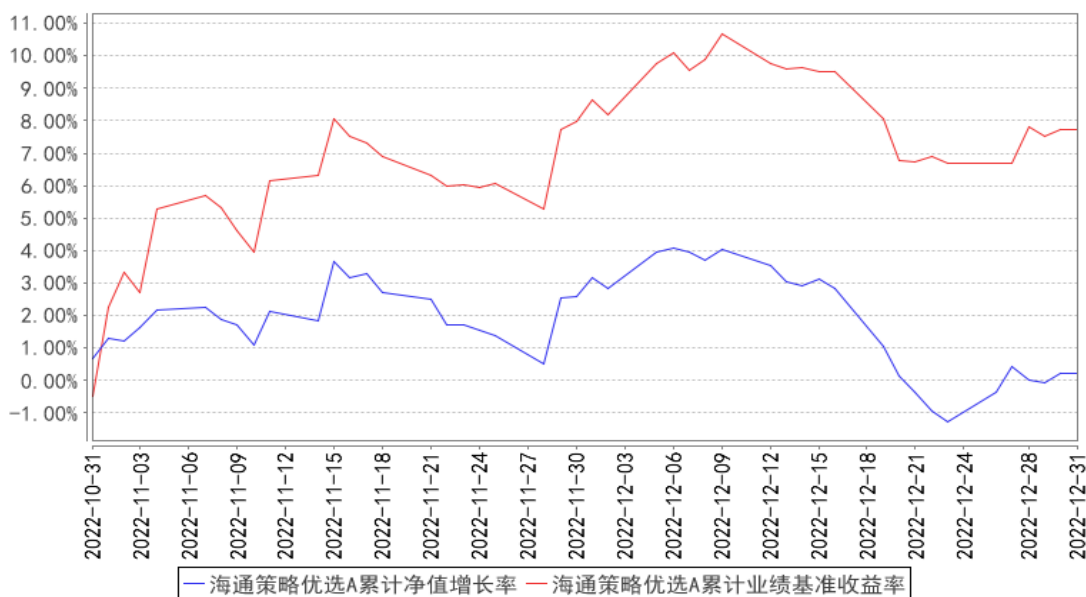
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.21%	0.68%	7.74%	0.92%	-7.53%	-0.24%

海通策略优选 C

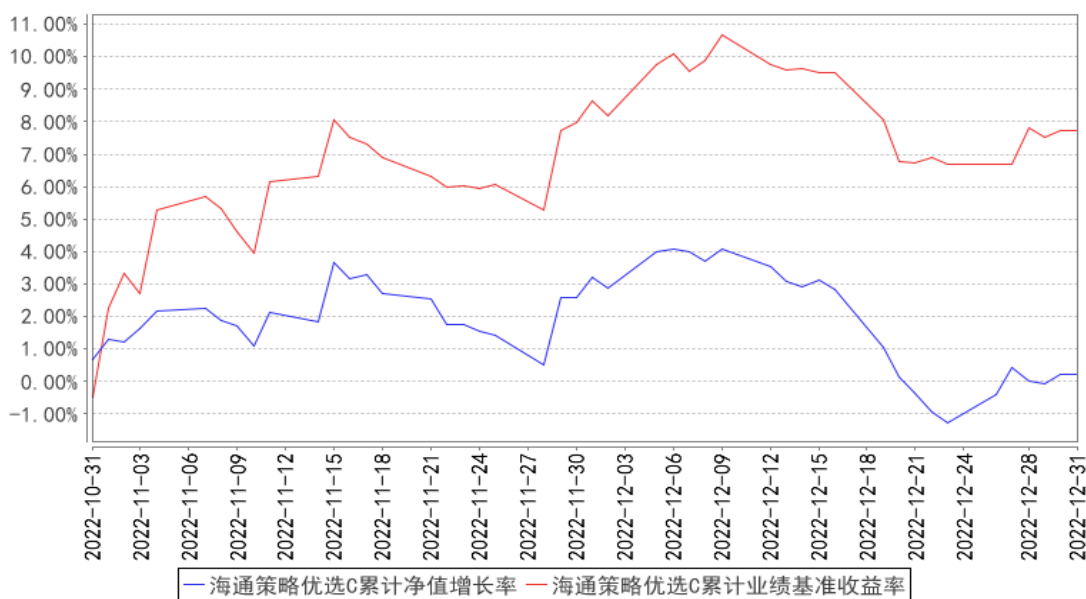
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.20%	0.68%	7.74%	0.92%	-7.54%	-0.24%

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

海通策略优选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



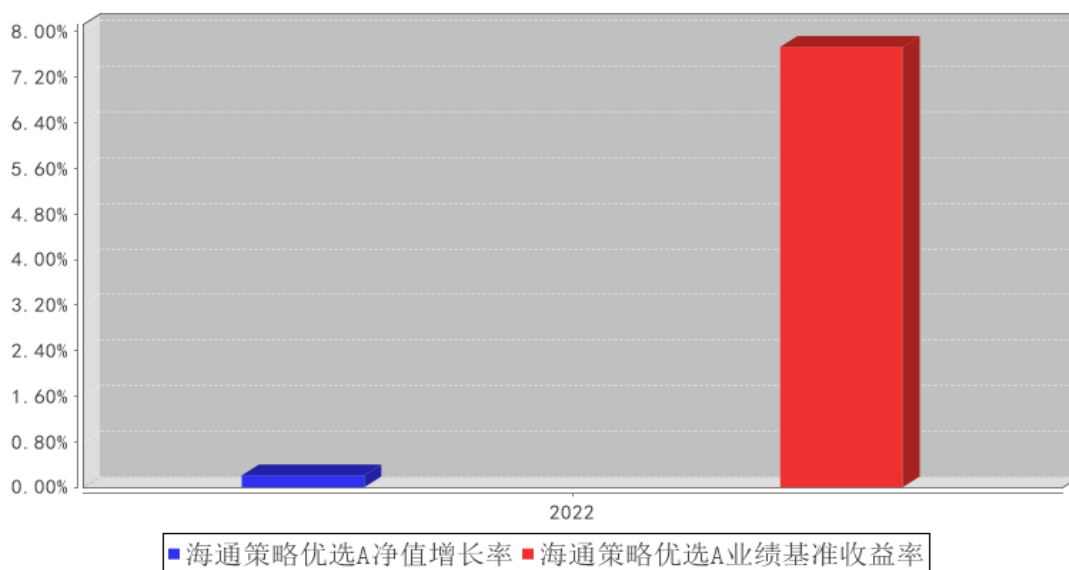
海通策略优选C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



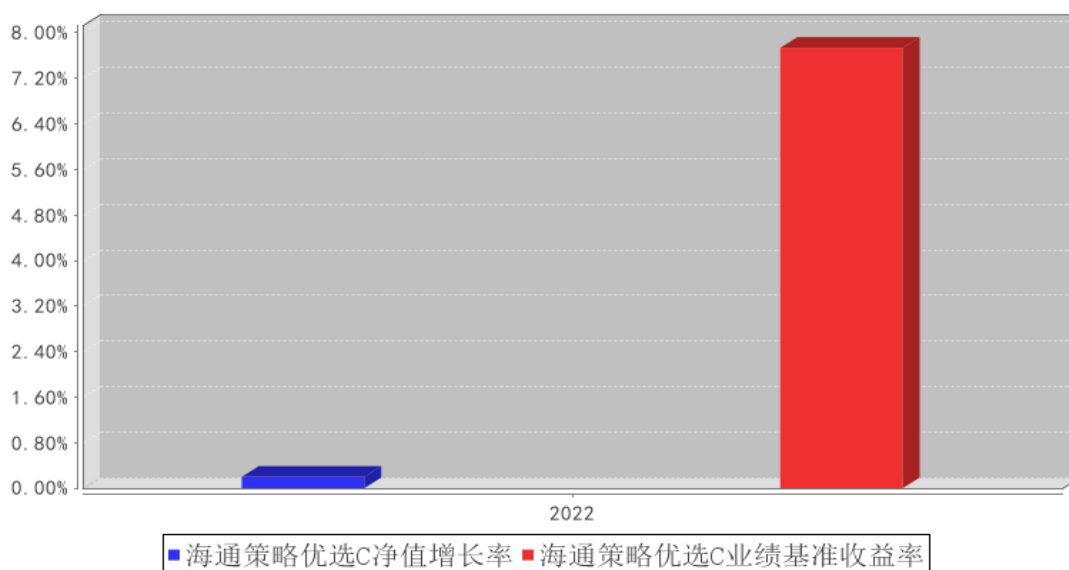
注：本集合计划合同生效日为 2022 年 10 月 31 日，按资产管理合同约定，管理人应当自资产管理合同生效之日起 6 个月内使集合计划的投资组合比例符合资产管理合同的有关约定。

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

海通策略优选A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



海通策略优选C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本集合计划2022年10月31日（集合计划合同生效日）至2022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 2022 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	2016 年 4 月 15 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	2022 年 10 月 31 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。

4.1.3 基金经理薪酬机制

公司用薪酬管理办法作为薪酬管理机制，根据员工不同的工作内容及工作职责，设立不同序列、不同职级以及不同职等。

基金经理薪酬严格按照薪酬管理办法进行管理。基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，该基金经理的薪酬激励不直接与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩。

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

2022 年一季度，外部冲击不断。俄乌冲突叠加美国加息，扰动全球市场。与此同时，国内经济受到疫情反弹影响，外资加速流出。上证综指下跌 10.65%，沪深 300 下跌 14.53%。四月份，市场触底，上证综指短暂跌破 2900 点。之后市场逐渐走出前期的悲观情绪，主要指数估值迅速修复，部分热门标的已经创出历史新高，但同时大部分行业还处在弱势反弹阶段。2022 年三季度，市场开始新一轮的下跌，上证综指在七月初短暂突破 3400 点后，开始了单边下跌行情，并于国庆假期后第一个交易日跌破 3000 点的心理关口。2022 年四季度，二十大胜利召开，同时疫情管控政策出现重大变化。防疫政策变化前，市场在不断憧憬疫情防控政策放松；疫情冲击开始后，市场又开始新一轮的调整。11 月份对市场复苏的乐观情绪被 12 月份的真实疫情所替代，市场成交量低迷，很大一部分投资者不同程度受到新冠疫情影响。

2022 年，市场经历了大幅的震荡，整体下跌。在这种市场环境下，投资者的耐心显得尤为珍贵。投资者的情绪和由此带来的股价的波动，既是投资烦恼的来源，也是超额收益的沃土。经历了过去两年的市场震荡和调整，很多优质资产显现出了更多的投资价值。未来权益市场表现或许会给耐心的投资者合理的回报。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本集合计划 A 份额净值为 1.0039 元，C 份额净值为 1.0038 元。自合同生效以来，集合计划各类份额净值增长率分别为 0.21%，0.20%，业绩比较基准收益率为 7.74%。

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，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。2022 年的市场悲观情绪释放需要一段时间，经济状况的改善同样是一个漫长的过程，时点和节奏都很难预测。一季度，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。

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

本报告期内，本集合计划于 2022 年 10 月 31 日至 2022 年 12 月 31 日出现了集合计划资产净值低于 5000 万元的情形，于 2022 年 10 月 31 日至 2022 年 12 月 31 日出现了集合计划持有人数少于 200 人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了集合计划托管人义务，不存在损害本集合计划份额持有人利益的行为。

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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、集合计划合同、托管协议的规定，对本集合计划的投资运作、集合计划资产净值计算、集合计划费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现集合计划管理人有损害集合计划份额持有人利益的行为。

报告期内，本集合计划未实施利润分配。

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

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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[2023]第 ZA30361 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	海通策略优选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策略优选混合型集合资产管理计划（以下简称“海通策略优选”）的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年 10 月 31 日（合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日的利润表、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财政部、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，公允反映了海通策略优选 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 10 月 31 日（合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。
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。

	<p>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，我们独立于海通策略优选，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。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>集合计划管理人对其他信息负责。其他信息包括海通策略优选 2022 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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时，集合计划管理人管理层负责评估海通策略优选的持续经营能力，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。</p> <p>集合计划管理人治理层负责监督海通策略优选的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>（1）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。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，</p>

	<p>但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 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。</p> <p>(4) 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，就可能导致对海通策略优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策略优选不能持续经营。</p> <p>(5) 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。</p> <p>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。</p>
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	2023 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海通策略优选混合型集合资产管理计划

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	2,224,060.29
结算备付金		253,330.80
存出保证金		187,296.00
交易性金融资产	7.4.7.2	14,055,534.18
其中：股票投资		14,055,534.18
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		-
应收申购款		50,500.00
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		16,770,721.27
负债和净资产	附注号	本期末 2022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		-
应付赎回款		49,849.50
应付管理人报酬		14,047.43
应付托管费		2,809.50
应付销售服务费		858.68
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	7.4.7.9	133,800.00
负债合计		201,365.11
净资产：		
实收基金	7.4.7.10	16,505,274.86
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	64,081.30
净资产合计		16,569,356.16
负债和净资产总计		16,770,721.27

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，本集合计划份额总额 16,505,274.86 份，其中 A 类份额净值 1.0039 元，份额总额 13,461,311.11 份；C 类份额净值 1.0038 元，份额总额 3,043,963.75 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2022 年 10 月 31 日（集合计划合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日，无上年度同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体：海通策略优选混合型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 10 月 31 日（基金合同 生效日）至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		159,409.23
1. 利息收入		2,762.19
其中：存款利息收入	7.4.7.13	2,762.19
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）		359,696.25
其中：股票投资收益	7.4.7.14	281,200.60
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	70,605.14
股利收益	7.4.7.19	7,890.51
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）	7.4.7.20	-212,860.41
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	9,811.20
减：二、营业总支出		164,276.21
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	28,664.38
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,732.90
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	858.93
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		-
8. 其他费用	7.4.7.23	129,020.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号 填列）		-4,866.98

减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,866.98
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-4,866.98

注：本财务报表的实际编制期间为 2022 年 10 月 31 日（集合计划合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日，无上年度同期对比数据。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：海通策略优选混合型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 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）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产（基金净值）	17,445,819.89	-	31,519.29	17,477,339.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-940,545.03	-	32,562.01	-907,983.02
（一）、综合收益总额	-	-	-4,866.98	-4,866.98
（二）、本期基金份额交易产生的基	-940,545.03	-	37,428.99	-903,116.04

金净值 变动数 (净值 减少以 “-”号 填列)				
其中:1. 基金申 购款	5,824,238.93	-	221,165.25	6,045,404.18
2 .基金赎 回款	-6,764,783.96	-	-183,736.26	-6,948,520.22
(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)	16,505,274.86	-	64,081.30	16,569,356.16

注：本财务报表的实际编制期间为 2022 年 10 月 31 日（集合计划合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日，无上年度同期对比数据。

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：

李井伟

基金管理人负责人

陈颖

主管会计工作负责人

刘雯

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

海通策略优选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“海通半年升集合资产管理计划”（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，自 2013 年 5 月 20 日起向社会公众发行，2013 年 5 月 23 日结束募集并于 2013 年 5 月 29 日成立。2013 年 6 月 5 日获得中国证券业协会（中证协函【2013】581 号）《关于上海海通证券资产管理有限公司发起设立海通半年升集合资产管理计划的备案确认函》。本集合计划于 2022 年 10 月 8 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予海通半年升集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2022]1650 号）批准，《海通策略优选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 2022 年 10 月 31 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，托管人为中国民生银行股份有限公司。

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。

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。

投资者依据原《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》获得的原集合计划份额，自本资产管理合同生效之日起全部自动转换为本集合计划 A 类份额。原集合计划份额在资产管理合同生效后变更为 A 类份额的，其持有期限从登记机构确认投资人持有原集合计划份额之日起连续计算。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海通策略优选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、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、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。

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交易保证金后，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。

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

本集合计划的业绩比较基准为中证 800 指数收益率×70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+商业银行活期存款利率（税后）×20%。

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》、《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》和在财务报表 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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 10 月 31 日（合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日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。本期财务报表的实际编制期间为 2022 年 10 月 31 日（合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日。

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

1、 金融资产的分类

根据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，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和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本集合计划持有的股票投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本集合计划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。

除非本集合计划改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本集合计划将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 一业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 一合同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。

除上述以摊余成本计量的资产外，本集合计划将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

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

1、金融工具的初始确认

本集合计划在成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

2、金融工具的后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产初始确认后按公允价值进行后续计量，公允价值变动计入当期损益。

以摊余成本计量的金融资产初始确认后采用实际利率法以摊余成本计量，持有期间采用实际利率法计算的利息计入当期损益。收回或处置时，将取得的价款与该金融资产账面价值之间的差额计入当期损益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债初始确认后以公允价值进行后续计量，公允价值变动计入当期损益。终止确认时，其账面价值与支付的对价之间的差额计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债初始确认后采用实际利率法以摊余成本计量。持有期间采用实际利率法计算的利息计入当期损益。终止确认时，将支付的对价与该金融负债账面价值之间的差额计入当期损益。

3、金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本集合计划终止确认金融资产：

- 收取金融资产现金流量的合同权利终止；
- 金融资产已转移，且已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；
- 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，但是未保留对金融资产的控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，将下列两项金额的差额计入当期损益：

- (1) 所转移金融资产的账面价值；
- (2) 因转移而收到的对价。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，则终止确认该金融负债或其一部分。

4、金融工具的减值

本集合计划以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

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。如果该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本集合计划按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；如果该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本集合计划按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。由此形成的损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本集合计划通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的相对变化，以评估金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

如果金融工具于资产负债表日的信用风险较低，本集合计划即认为该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

如果有客观证据表明某项金融资产已经发生信用减值，则本集合计划在单项基础上对该金融资产计提减值准备。

对于应收款项，无论是否包含重大融资成分，本集合计划始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

本集合计划不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回的，直接减记该金融资产的账面余额。

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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在履行了合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

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，具体分红方案见管理人根据集合计划运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若《资产管理合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为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；

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

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末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期末发生会计估计变更。

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：

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日
活期存款	2,224,060.29
等于：本金	2,223,760.84
加：应计利息	299.45
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	2,224,060.29

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	14,749,598.95	-	14,055,534.18	-694,064.77
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	14,749,598.95	-	14,055,534.18	-694,064.77

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 2022年12月31日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	1,312,680.00	-	-	
其中：股指期货投资	1,312,680.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	1,312,680.00	-	-	

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
IM2303	IM2303	1.00	1,248,640.00	-64,040.00
合计				-64,040.00
减：可抵销期货暂收款				-64,040.00
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其他资产无余额。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	133,800.00
合计	133,800.00

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

海通策略优选 A

项目	本期 2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	17,445,819.89	17,445,819.89
本期申购	852,784.25	852,784.25
本期赎回（以“-”号填列）	-4,837,293.03	-4,837,293.03
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	13,461,311.11	13,461,311.11

海通策略优选 C

项目	本期 2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	4,971,454.68	4,971,454.68
本期赎回（以“-”号填列）	-1,927,490.93	-1,927,490.93
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	3,043,963.75	3,043,963.75

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

海通策略优选 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-277,129.54	308,648.83	31,519.29
本期利润	220,714.66	-83,723.22	136,991.44
本期基金份额交易产生的变动数	3,246.21	-119,238.12	-115,991.91
其中：基金申购款	-470.45	33,464.68	32,994.23
基金赎回款	3,716.66	-152,702.80	-148,986.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-53,168.67	105,687.49	52,518.82

海通策略优选 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-12,721.23	-129,137.19	-141,858.42
本期基金份额交易产生的变动数	88,648.57	64,772.33	153,420.90
其中：基金申购款	140,476.01	47,695.01	188,171.02
基金赎回款	-51,827.44	17,077.32	-34,750.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	75,927.34	-64,364.86	11,562.48

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,247.77
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	1,503.33
其他	11.09
合计	2,762.19

注：其他包括结算保证金利息收入。

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
	2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	16,875,368.93
减：卖出股票成本总额	16,524,590.72
减：交易费用	69,577.61
买卖股票差价收入	281,200.60

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	本期收益金额
	2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股指期货投资收益	70,605.14

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	7,890.51
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	7,890.51

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	425,256.65
股票投资	425,256.65
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	-638,117.06
权证投资	-

期货投资	-638,117.06
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	-212,860.41

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年10月31日（基金合同生效日）至2022 年12月31日
基金赎回费收入	9,811.20
合计	9,811.20

7.4.7.22 信用减值损失

注：本集合计划本报告期无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年10月31日（基金合同生效日）至2022 年12月31日
审计费用	9,000.00
信息披露费	120,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	20.00
合计	129,020.00

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，本集合计划并无须作披露的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
中国民生银行股份有限公司（“民生银行”）	基金托管人
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 2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年 12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
海通证券	33,045,440.57	100.00

7.4.10.1.2 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。

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 2022年10月31日（基金合同生效日）至2022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	50,096.40	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 2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	28,664.38
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：本集合计划本期共发生应支付的固定管理费 28,664.38 元。本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 1% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	5,732.90

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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。

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		
	2022 年 10 月 31 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海通策略优选 A	海通策略优选 C	合计
海通证券	-	858.93	858.93
合计	-	858.93	858.93

注：本集合计划 A 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 0.4%。

C 类份额的销售服务费按前一日 C 类份额资产净值的 0.4% 年费率计提，计算方法如下：

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

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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末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。

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。

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 2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日	本期 2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日
	海通策略优选 A	海通策略优选 C
基金合同生效日（2022年10月31日）持有的基金份额	3,203,045.56	-
报告期初持有的基金份额	-	-
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	1,100,000.00	-
报告期末持有的基金份额	2,103,045.56	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	15.62%	-

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、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

注：本集合计划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。

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 2022年10月31日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
民生银行	6,656.70	257.92
海通证券	2,217,403.59	989.85

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末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2022 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

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。

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 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	2,224,060.29	-	-	-	2,224,060.29
结算备付金	253,330.80	-	-	-	253,330.80
存出保证金	187,296.00	-	-	-	187,296.00
交易性金融资产	-	-	-	14,055,534.18	14,055,534.18
应收申购款	-	-	-	50,500.00	50,500.00
资产总计	2,664,687.09	-	-	14,106,034.18	16,770,721.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	49,849.50	49,849.50

应付管理人报酬	-	-	-	14,047.43	14,047.43
应付托管费	-	-	-	2,809.50	2,809.50
应付销售服务费	-	-	-	858.68	858.68
其他负债	-	-	-	133,800.00	133,800.00
负债总计	-	-	-	201,365.11	201,365.11
利率敏感度缺口	2,664,687.09	-	-	13,904,669.07	16,569,356.16

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

假设	-	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2022年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-
	市场利率下降 25 个基点	-

注：于 2022 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%，因此市场利率的变动对于本集合计划净资产无重大影响。

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。于 2022 年 12 月 31 日，本集合计划未持有外币计价的资产和负债，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

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

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交易保证金后，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 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	14,055,534.18	84.83
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	14,055,534.18	84.83

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	-
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
	本期末（2022 年 12 月 31 日）

分析	股票价格上升 5%	702, 776. 71
	股票价格下降 5%	-702, 776. 71

7. 4. 14 公允价值

7. 4. 14. 1 金融工具公允价值计量的方法

<p>公允价值计量所使用的输入值划分为三个层次：</p> <p>第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。</p> <p>第二层次输入值是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。</p> <p>第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。</p> <p>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。</p>

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 2022 年 12 月 31 日
第一层次	14, 055, 534. 18
第二层次	-
第三层次	-
合计	14, 055, 534. 18

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 2022 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。

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说明的其他重要事项。

§ 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	14,055,534.18	83.81
	其中：股票	14,055,534.18	83.81
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	2,477,391.09	14.77
8	其他各项资产	237,796.00	1.42
9	合计	16,770,721.27	100.00

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	12,702.00	0.08
B	采矿业	477,219.00	2.88
C	制造业	9,183,663.28	55.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	309,421.00	1.87
E	建筑业	197,465.00	1.19
F	批发和零售业	142,413.00	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	322,410.50	1.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	387,681.80	2.34
J	金融业	2,412,202.80	14.56
K	房地产业	210,089.00	1.27

L	租赁和商务服务业	110,140.80	0.66
M	科学研究和技术服务业	211,926.00	1.28
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	78,200.00	0.47
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,055,534.18	84.83

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本集合计划本报告期末未持有港股通股票。

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	600519	贵州茅台	300	518,100.00	3.13
2	300750	宁德时代	700	275,394.00	1.66
3	600036	招商银行	6,200	231,012.00	1.39
4	601318	中国平安	4,500	211,500.00	1.28
5	601012	隆基绿能	4,524	191,184.24	1.15
6	601939	建设银行	31,500	177,345.00	1.07
7	000333	美的集团	3,238	167,728.40	1.01
8	601166	兴业银行	7,800	137,202.00	0.83
9	603259	药明康德	1,640	132,840.00	0.80
10	601857	中国石油	25,700	127,729.00	0.77
11	000858	五粮液	700	126,483.00	0.76
12	600999	招商证券	8,800	117,040.00	0.71
13	600900	长江电力	5,200	109,200.00	0.66
14	601818	光大银行	35,300	108,371.00	0.65
15	600089	特变电工	5,200	104,416.00	0.63
16	002821	凯莱英	700	103,600.00	0.63
17	002594	比亚迪	400	102,788.00	0.62
18	603290	斯达半导	300	98,790.00	0.60
19	000895	双汇发展	3,800	98,534.00	0.59
20	300450	先导智能	2,400	96,600.00	0.58
21	002179	中航光电	1,660	95,881.60	0.58
22	300760	迈瑞医疗	300	94,791.00	0.57
23	600015	华夏银行	17,800	92,382.00	0.56
24	002049	紫光国微	700	92,274.00	0.56
25	002273	水晶光电	7,800	91,962.00	0.56
26	002001	新和成	4,900	91,875.00	0.55
27	600660	福耀玻璃	2,600	91,182.00	0.55

28	000708	中信特钢	5,200	89,232.00	0.54
29	002938	鹏鼎控股	3,200	87,808.00	0.53
30	601888	中国中免	400	86,412.00	0.52
31	600018	上港集团	15,700	83,838.00	0.51
32	002736	国信证券	9,400	83,472.00	0.50
33	600000	浦发银行	11,400	82,992.00	0.50
34	002475	立讯精密	2,600	82,550.00	0.50
35	600887	伊利股份	2,600	80,600.00	0.49
36	601319	中国人保	15,400	80,388.00	0.49
37	000733	振华科技	700	79,961.00	0.48
38	300308	中际旭创	2,900	78,387.00	0.47
39	603882	金域医学	1,000	78,200.00	0.47
40	600276	恒瑞医药	2,020	77,830.60	0.47
41	600438	通威股份	2,000	77,160.00	0.47
42	600028	中国石化	17,400	75,864.00	0.46
43	300059	东方财富	3,852	74,728.80	0.45
44	300357	我武生物	1,300	71,630.00	0.43
45	601138	工业富联	7,800	71,604.00	0.43
46	600332	白云山	2,400	71,496.00	0.43
47	601006	大秦铁路	10,400	69,472.00	0.42
48	601288	农业银行	23,400	68,094.00	0.41
49	601988	中国银行	21,500	67,940.00	0.41
50	000408	藏格矿业	2,600	67,522.00	0.41
51	000876	新希望	5,200	67,132.00	0.41
52	002399	海普瑞	5,200	66,820.00	0.40
53	000725	京东方 A	19,600	66,248.00	0.40
54	688006	杭可科技	1,500	65,655.00	0.40
55	601211	国泰君安	4,800	65,232.00	0.39
56	300832	新产业	1,300	65,182.00	0.39
57	000651	格力电器	2,000	64,640.00	0.39
58	002304	洋河股份	400	64,200.00	0.39
59	688599	天合光能	1,000	63,760.00	0.38
60	603605	珀莱雅	380	63,642.40	0.38
61	300316	晶盛机电	1,000	63,560.00	0.38
62	603658	安图生物	1,000	61,850.00	0.37
63	600528	中铁工业	8,100	61,803.00	0.37
64	600873	梅花生物	5,900	60,062.00	0.36
65	600584	长电科技	2,600	59,930.00	0.36
66	300150	世纪瑞尔	16,500	59,565.00	0.36
67	601360	三六零	9,100	59,514.00	0.36
68	002384	东山精密	2,400	59,352.00	0.36
69	688012	中微公司	600	58,806.00	0.35
70	601689	拓普集团	1,000	58,580.00	0.35

71	603127	昭衍新药	1,000	58,410.00	0.35
72	601390	中国中铁	10,400	57,824.00	0.35
73	601328	交通银行	12,000	56,880.00	0.34
74	600521	华海药业	2,600	56,836.00	0.34
75	601231	环旭电子	3,500	56,805.00	0.34
76	603596	伯特利	700	55,860.00	0.34
77	300123	亚光科技	9,300	54,963.00	0.33
78	300763	锦浪科技	300	54,015.00	0.33
79	601229	上海银行	9,100	53,781.00	0.32
80	600663	陆家嘴	5,500	53,570.00	0.32
81	601688	华泰证券	4,200	53,508.00	0.32
82	000800	一汽解放	6,900	53,337.00	0.32
83	002602	世纪华通	13,900	52,959.00	0.32
84	002414	高德红外	4,800	52,800.00	0.32
85	601009	南京银行	4,900	51,058.00	0.31
86	601799	星宇股份	400	50,948.00	0.31
87	600871	石化油服	25,700	50,886.00	0.31
88	300699	光威复材	700	50,575.00	0.31
89	600362	江西铜业	2,900	50,547.00	0.31
90	600104	上汽集团	3,500	50,435.00	0.30
91	002409	雅克科技	1,000	50,370.00	0.30
92	600918	中泰证券	7,800	49,998.00	0.30
93	600901	江苏金租	9,100	49,868.00	0.30
94	601238	广汽集团	4,500	49,635.00	0.30
95	300009	安科生物	5,200	48,672.00	0.29
96	600638	新黄浦	8,500	48,025.00	0.29
97	600563	法拉电子	300	47,964.00	0.29
98	600820	隧道股份	9,100	47,957.00	0.29
99	603868	飞科电器	700	47,131.00	0.28
100	301029	怡合达	700	46,018.00	0.28
101	603993	洛阳钼业	10,000	45,500.00	0.27
102	600848	上海临港	3,800	45,296.00	0.27
103	600845	宝信软件	1,000	44,800.00	0.27
104	601989	中国重工	12,652	44,155.48	0.27
105	600968	海油发展	15,200	43,776.00	0.26
106	000738	航发控制	1,700	43,588.00	0.26
107	002311	海大集团	700	43,211.00	0.26
108	600025	华能水电	6,500	42,900.00	0.26
109	601869	长飞光纤	1,300	42,419.00	0.26
110	300628	亿联网络	700	42,413.00	0.26
111	603185	上机数控	400	42,340.00	0.26
112	600886	国投电力	3,900	42,237.00	0.25
113	002202	金风科技	3,800	41,800.00	0.25

114	600183	生益科技	2,900	41,789.00	0.25
115	601766	中国中车	8,100	41,391.00	0.25
116	002841	视源股份	700	41,328.00	0.25
117	601169	北京银行	9,500	40,945.00	0.25
118	603228	景旺电子	2,000	40,480.00	0.24
119	600233	圆通速递	2,000	40,180.00	0.24
120	601808	中海油服	2,400	39,792.00	0.24
121	002465	海格通信	4,900	39,788.00	0.24
122	000425	徐工机械	7,800	39,546.00	0.24
123	002064	华峰化学	5,800	39,440.00	0.24
124	002650	加加食品	8,500	39,270.00	0.24
125	601618	中国中冶	12,000	38,160.00	0.23
126	600115	中国东航	6,900	38,157.00	0.23
127	600862	中航高科	1,700	37,893.00	0.23
128	600300	维维股份	10,400	37,024.00	0.22
129	300448	浩云科技	7,800	36,504.00	0.22
130	600039	四川路桥	3,200	35,584.00	0.21
131	601816	京沪高铁	7,200	35,424.00	0.21
132	600885	宏发股份	1,060	35,414.60	0.21
133	601106	中国一重	12,000	35,160.00	0.21
134	002252	上海莱士	5,500	34,870.00	0.21
135	002521	齐峰新材	6,900	34,845.00	0.21
136	600535	天士力	3,200	34,432.00	0.21
137	300214	日科化学	5,200	34,060.00	0.21
138	300120	经纬辉开	5,500	33,220.00	0.20
139	300600	国瑞科技	4,500	33,210.00	0.20
140	300121	阳谷华泰	3,200	33,152.00	0.20
141	002743	富煌钢构	6,200	33,108.00	0.20
142	002831	裕同科技	1,000	33,070.00	0.20
143	603079	圣达生物	2,600	32,630.00	0.20
144	600208	新湖中宝	12,700	32,258.00	0.19
145	600582	天地科技	6,200	32,240.00	0.19
146	002224	三力士	7,400	32,042.00	0.19
147	601601	中国太保	1,300	31,876.00	0.19
148	600406	国电南瑞	1,300	31,720.00	0.19
149	300543	朗科智能	3,800	31,692.00	0.19
150	600967	内蒙一机	3,800	31,388.00	0.19
151	000002	万科 A	1,700	30,940.00	0.19
152	002623	亚玛顿	1,000	30,140.00	0.18
153	000100	TCL 科技	8,100	30,132.00	0.18
154	000157	中联重科	5,500	29,920.00	0.18
155	002936	郑州银行	12,600	29,610.00	0.18
156	300243	瑞丰高材	3,800	29,374.00	0.18

157	000783	长江证券	5,500	29,315.00	0.18
158	603890	春秋电子	3,200	29,248.00	0.18
159	002673	西部证券	4,800	29,232.00	0.18
160	002733	雄韬股份	1,700	29,155.00	0.18
161	000887	中鼎股份	2,000	28,940.00	0.17
162	600655	豫园股份	3,800	28,918.00	0.17
163	600436	片仔癀	100	28,846.00	0.17
164	600809	山西汾酒	100	28,499.00	0.17
165	603355	莱克电气	1,000	28,040.00	0.17
166	600309	万华化学	300	27,795.00	0.17
167	002430	杭氧股份	700	27,552.00	0.17
168	000166	申万宏源	6,900	27,462.00	0.17
169	600585	海螺水泥	1,000	27,380.00	0.17
170	600941	中国移动	400	27,068.00	0.16
171	601778	晶科科技	4,900	26,950.00	0.16
172	002281	光迅科技	1,700	26,724.00	0.16
173	002422	科伦药业	1,000	26,610.00	0.16
174	603218	日月股份	1,300	26,390.00	0.16
175	600160	巨化股份	1,700	26,367.00	0.16
176	002812	恩捷股份	200	26,258.00	0.16
177	000301	东方盛虹	2,000	26,080.00	0.16
177	600998	九州通	2,000	26,080.00	0.16
179	000883	湖北能源	6,200	26,040.00	0.16
180	600481	双良节能	2,000	25,880.00	0.16
181	002434	万里扬	3,200	25,760.00	0.16
182	603369	今世缘	500	25,450.00	0.15
183	000938	紫光股份	1,300	25,363.00	0.15
184	300227	光韵达	3,800	25,232.00	0.15
185	300484	蓝海华腾	2,400	25,200.00	0.15
186	002429	兆驰股份	7,200	25,128.00	0.15
187	600686	金龙汽车	4,200	24,990.00	0.15
188	600468	百利电气	6,200	24,986.00	0.15
189	600642	申能股份	4,500	24,705.00	0.15
190	688981	中芯国际	600	24,684.00	0.15
191	603016	新宏泰	1,300	24,648.00	0.15
192	300011	鼎汉技术	4,500	24,480.00	0.15
193	603111	康尼机电	5,900	24,426.00	0.15
194	002364	中恒电气	3,500	24,325.00	0.15
195	002428	云南锗业	2,600	24,232.00	0.15
196	600588	用友网络	1,000	24,170.00	0.15
197	002002	鸿达兴业	7,400	23,976.00	0.14
198	300283	温州宏丰	4,900	23,961.00	0.14
199	603089	正裕工业	2,900	23,954.00	0.14

200	300376	易事特	3,500	23,905.00	0.14
201	600699	均胜电子	1,700	23,885.00	0.14
202	600867	通化东宝	2,600	23,868.00	0.14
203	688036	传音控股	300	23,856.00	0.14
204	002255	海陆重工	5,200	23,764.00	0.14
205	600352	浙江龙盛	2,400	23,760.00	0.14
206	000415	渤海租赁	10,700	23,647.00	0.14
207	000878	云南铜业	2,010	23,617.50	0.14
208	002506	协鑫集成	8,100	23,571.00	0.14
209	603926	铁流股份	2,600	23,556.00	0.14
210	300644	南京聚隆	1,700	23,477.00	0.14
211	300665	飞鹿股份	3,200	23,424.00	0.14
212	600216	浙江医药	2,000	23,380.00	0.14
213	300265	通光线缆	2,900	23,316.00	0.14
214	300177	中海达	3,800	23,294.00	0.14
215	600339	中油工程	7,800	23,244.00	0.14
216	600360	华微电子	3,500	23,065.00	0.14
217	000581	威孚高科	1,300	23,049.00	0.14
218	002249	大洋电机	4,500	23,040.00	0.14
219	603683	晶华新材	2,900	23,026.00	0.14
220	300407	凯发电气	3,200	22,976.00	0.14
221	300003	乐普医疗	1,000	22,970.00	0.14
222	300045	华力创通	3,500	22,855.00	0.14
223	603087	甘李药业	700	22,806.00	0.14
224	300082	奥克股份	2,900	22,794.00	0.14
225	300328	宜安科技	3,800	22,724.00	0.14
226	603328	依顿电子	3,500	22,715.00	0.14
227	002236	大华股份	2,000	22,620.00	0.14
228	002371	北方华创	100	22,530.00	0.14
229	600741	华域汽车	1,300	22,529.00	0.14
230	300463	迈克生物	1,300	22,490.00	0.14
231	301042	安联锐视	700	22,477.00	0.14
232	600150	中国船舶	1,000	22,280.00	0.13
233	300411	金盾股份	3,500	22,225.00	0.13
234	600031	三一重工	1,400	22,120.00	0.13
235	300739	明阳电路	1,706	21,973.28	0.13
236	002241	歌尔股份	1,300	21,879.00	0.13
237	003816	中国广核	8,100	21,789.00	0.13
238	601728	中国电信	5,200	21,788.00	0.13
239	300529	健帆生物	700	21,679.00	0.13
240	603367	辰欣药业	1,700	21,420.00	0.13
241	600489	中金黄金	2,600	21,294.00	0.13
242	300433	蓝思科技	2,000	21,060.00	0.13

243	601336	新华保险	700	21,056.00	0.13
244	300373	扬杰科技	400	21,040.00	0.13
245	000625	长安汽车	1,700	20,927.00	0.13
246	600372	中航电子	1,300	20,761.00	0.13
247	000063	中兴通讯	800	20,688.00	0.12
248	300676	华大基因	400	20,676.00	0.12
249	600989	宝丰能源	1,700	20,519.00	0.12
250	000877	天山股份	2,400	20,448.00	0.12
251	002600	领益智造	4,500	20,430.00	0.12
252	000338	潍柴动力	2,000	20,360.00	0.12
253	600346	恒力石化	1,300	20,189.00	0.12
254	002074	国轩高科	700	20,181.00	0.12
255	601600	中国铝业	4,500	20,115.00	0.12
256	002557	洽洽食品	400	20,000.00	0.12
257	000630	铜陵有色	6,400	19,968.00	0.12
258	600482	中国动力	1,300	19,877.00	0.12
259	002353	杰瑞股份	700	19,537.00	0.12
260	601877	正泰电器	700	19,390.00	0.12
261	601179	中国西电	4,200	19,362.00	0.12
262	601088	中国神华	700	19,334.00	0.12
263	603939	益丰药房	300	19,152.00	0.12
264	688303	大全能源	400	19,072.00	0.12
265	688122	西部超导	200	18,938.00	0.11
266	601228	广州港	5,900	18,585.00	0.11
267	601881	中国银河	2,000	18,580.00	0.11
268	601198	东兴证券	2,400	18,528.00	0.11
269	000060	中金岭南	4,500	18,450.00	0.11
270	601077	渝农商行	5,200	18,356.00	0.11
271	002221	东华能源	2,400	18,312.00	0.11
272	600928	西安银行	5,200	18,304.00	0.11
273	600884	杉杉股份	1,000	18,200.00	0.11
274	600307	酒钢宏兴	11,000	18,150.00	0.11
275	000786	北新建材	700	18,116.00	0.11
276	002048	宁波华翔	1,300	18,070.00	0.11
277	000723	美锦能源	2,000	18,040.00	0.11
278	601005	重庆钢铁	11,400	18,012.00	0.11
279	002008	大族激光	700	17,955.00	0.11
280	600170	上海建工	6,900	17,940.00	0.11
281	002958	青农商行	6,200	17,918.00	0.11
282	000563	陕国投 A	5,900	17,877.00	0.11
283	000768	中航西飞	700	17,815.00	0.11
284	002670	国盛金控	2,400	17,784.00	0.11
285	688126	沪硅产业	1,000	17,610.00	0.11

286	601577	长沙银行	2,600	17,576.00	0.11
287	601997	贵阳银行	3,200	17,568.00	0.11
288	600111	北方稀土	700	17,535.00	0.11
289	600126	杭钢股份	4,200	17,346.00	0.10
290	000750	国海证券	5,200	17,316.00	0.10
291	601899	紫金矿业	1,700	17,000.00	0.10
292	002500	山西证券	3,200	16,960.00	0.10
293	600517	国网英大	3,500	16,940.00	0.10
294	300073	当升科技	300	16,920.00	0.10
295	000997	新大陆	1,300	16,913.00	0.10
296	600893	航发动力	400	16,912.00	0.10
297	600155	华创阳安	2,600	16,900.00	0.10
298	002152	广电运通	1,700	16,898.00	0.10
299	600369	西南证券	4,500	16,875.00	0.10
300	601066	中信建投	700	16,625.00	0.10
301	000538	云南白药	300	16,308.00	0.10
302	601985	中国核电	2,600	15,600.00	0.09
303	688116	天奈科技	200	15,428.00	0.09
304	601901	方正证券	2,400	15,312.00	0.09
305	601298	青岛港	2,600	14,586.00	0.09
306	600299	安迪苏	1,700	14,042.00	0.08
307	000963	华东医药	300	14,040.00	0.08
308	600378	昊华科技	300	12,873.00	0.08
309	600985	淮北矿业	1,000	12,800.00	0.08
310	601118	海南橡胶	2,900	12,702.00	0.08
311	600623	华谊集团	2,000	12,640.00	0.08
312	601607	上海医药	700	12,481.00	0.08
313	000869	张裕 A	400	12,096.00	0.07
314	603233	大参林	300	11,880.00	0.07
315	600297	广汇汽车	5,500	11,550.00	0.07
316	600350	山东高速	2,000	11,380.00	0.07
317	000050	深天马 A	1,300	11,258.00	0.07
318	688256	寒武纪	200	10,912.00	0.07
319	002185	华天科技	1,300	10,777.00	0.07
320	600377	宁沪高速	1,300	10,686.00	0.06
321	600705	中航产融	3,200	10,496.00	0.06
322	688321	微芯生物	400	8,792.00	0.05
323	688819	天能股份	200	7,348.00	0.04
324	603392	万泰生物	45	5,701.50	0.03
325	603613	国联股份	20	1,768.80	0.01
326	002925	盈趣科技	34	561.68	0.00
327	600717	天津港	25	102.50	0.00
328	000785	居然之家	20	81.80	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601939	建设银行	181,769.00	1.10
2	600519	贵州茅台	165,199.00	1.00
3	601989	中国重工	163,229.16	0.99
4	600028	中国石化	158,555.00	0.96
5	601857	中国石油	136,406.00	0.82
6	601012	隆基绿能	126,964.00	0.77
7	600362	江西铜业	126,797.00	0.77
8	600036	招商银行	123,851.00	0.75
9	002938	鹏鼎控股	121,195.00	0.73
10	601766	中国中车	117,855.00	0.71
11	600999	招商证券	116,626.00	0.70
12	600183	生益科技	114,064.00	0.69
13	002414	高德红外	109,691.00	0.66
14	002252	上海莱士	107,654.00	0.65
15	603259	药明康德	107,194.00	0.65
16	601390	中国中铁	105,517.00	0.64
17	300122	智飞生物	103,825.00	0.63
18	688126	沪硅产业	103,514.81	0.62
19	000301	东方盛虹	102,093.00	0.62
20	002001	新和成	101,512.00	0.61

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	156,328.00	0.94
2	600161	天坛生物	141,276.00	0.85
3	601989	中国重工	140,542.00	0.85
4	601800	中国交建	134,258.00	0.81
5	600028	中国石化	122,162.80	0.74
6	601865	福莱特	116,092.00	0.70
7	600887	伊利股份	114,452.00	0.69
8	601766	中国中车	111,722.00	0.67
9	601966	玲珑轮胎	109,248.00	0.66
10	601857	中国石油	106,985.00	0.65
11	600547	山东黄金	105,841.00	0.64
12	300491	通合科技	105,618.00	0.64

13	603121	华培动力	104,383.00	0.63
14	600690	海尔智家	102,912.00	0.62
15	601211	国泰君安	102,675.00	0.62
16	600362	江西铜业	101,474.00	0.61
17	601939	建设银行	101,112.00	0.61
18	300122	智飞生物	98,308.00	0.59
19	002938	鹏鼎控股	97,345.00	0.59
20	600332	白云山	94,434.00	0.57

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。

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	16,170,071.64
卖出股票收入（成交）总额	16,875,368.93

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。

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，适时使用股指期货代替现货持仓。

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

无

8.11.2 本期国债期货投资评价

无

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，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到厦门证监局处罚，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到厦门证监局及中国银行间市场交易商协会处罚，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到厦门证监局及山东证监局处罚。

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	187,296.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	50,500.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	237,796.00

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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
海通策略 优选 A	141	95,470.29	2,103,045.56	15.62	11,358,265.55	84.38
海通策略 优选 C	32	95,123.87	-	-	3,043,963.75	100
合计	173	95,406.21	2,103,045.56	12.74	14,402,229.30	87.26

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、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	海通策略优选 A	893,469.78	6.6373
	海通策略优选 C	55,592.98	1.8263
	合计	949,062.76	5.7501

注：本表报告期末持有份额总数占总份额比例的计算中，A、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	海通策略优选 A	50~100
	海通策略优选 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本 开放式基金	海通策略优选 A	0~10
	海通策略优选 C	0
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海通策略优选 A	海通策略优选 C
基金合同生效日 (2022 年 10 月 31 日) 基金份额总额	17,445,819.89	-
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	852,784.25	4,971,454.68

减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	4,837,293.03	1,927,490.93
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,461,311.11	3,043,963.75

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

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

3. 2022年12月2日，上海海通证券资产管理有限公司发布公告，经公司第四届第四十七次董事会审议通过，邓航先生自2022年12月1日起不再担任公司副总经理。

4. 本报告期内，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、海通证券股份有限公司等13个被告返还或赔偿原告委托财产51,455万元及相应利息。2022年11月10日案件第一次开庭，开庭结果正等待法院后续通知。

2. 本报告期内，无涉及集合计划托管业务的诉讼。

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1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，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

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	33,045,440.57	100.00	50,096.40	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

注：本集合计划本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

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	海通半年升集合资产管理计划变更为海通策略优选混合型集合资产管理计划合同生效的公告	中国证券报及公司官网	2022年10月31日
2	海通策略优选混合型集合资产管理计划开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	中国证券报及公司官网	2022年11月14日
3	关于海通策略优选混合型集合资产管理计划参与直销渠道开展申购费率及转换费率优惠活动的公告	中国证券报及公司官网	2022年11月14日
4	上海海通证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	中国证券报及公司官网	2022年12月2日
5	上海海通证券资产管理有限公司关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下部分集合资产管理计划代理销售机构的公告	中国证券报及公司官网	2022年12月9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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况

类别	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	2022/11/23-2022/11/24	3,203,045.56	-	1,100,000.00	2,103,045.56	12.74
产品特有风险							
<p>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。</p>							

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半年升集合资产管理计划资产管理合同变更的文件
- (二) 海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同
- (三) 海通策略优选混合型集合资产管理计划托管协议
- (四) 海通策略优选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

2023 年 3 月 31 日