

海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金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基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 22 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§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遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	58
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	58
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 市场中性策略执行情况.....	59
7.13 投资组合报告附注.....	59
§8 基金份额持有人信息	61

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	62
9 开放式基金份额变动	62
§10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息	67
§12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	海富通安益对冲混合	
基金主代码	008830	
交易代码	008830	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 1 月 22 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,849,466,227.49 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C
下属分级基金的交易代码	008831	008830
报告期末下属分级基金的份额总额	2,662,670,697.03 份	186,795,530.46 份

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，灵活应用多种策略对冲投资组合的市场风险，谋求投资组合资产的长期增值。
投资策略	基金主要采用量化对冲等投资策略，在力求有效控制投资风险的前提下，通过全市场选股构建预期收益高于市场回报的投资组合，同时利用股指期货等多种策略对冲投资组合的市场风险。本基金将根据沪深 300 股指期货当月合约与现货指数的差除以股指指数的情况来灵活调整股票资产的配置比例，以求获得不依赖市场整体走向的稳定收益。
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期三年期定期存款基准利率(税后)
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，通过采用量化对冲策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金将投资港股通标的股票，需承担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		海富通基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	陆志俊
	联系电话	021-38650788	95559
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		40088-40099	95559

传真	021-33830166	021-62701216
注册地址	上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦 36-37层	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦 36-37层	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码	200120	200336
法定代表人	杨仓兵	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	海富通基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号 东亚银行金融大厦 36-37 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月22日(基金合同生效日)至2020年6月30日)	
	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C
本期已实现收益	-37,504.46	-700,757.94
本期利润	57,277,738.43	5,314,209.50
加权平均基金份额本期利润	0.0233	0.0148
本期加权平均净值利润率	2.33%	1.48%
本期基金份额净值增长率	2.27%	2.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C
期末可供分配利润	-419,738.80	-368,064.55
期末可供分配基金份额利润	-0.0002	-0.0020
期末基金资产净值	2,723,062,932.25	190,686,858.36

期末基金份额净值	1.0227	1.0208
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C
基金份额累计净值增长率	2.27%	2.08%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，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、本基金合同生效日为 2020 年 1 月 22 日，合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

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

海富通安益对冲混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.47%	0.25%	0.24%	0.01%	1.23%	0.24%
过去三个月	2.51%	0.22%	0.68%	0.01%	1.83%	0.21%
自基金合同生效起至今	2.27%	0.20%	1.20%	0.01%	1.07%	0.19%

海富通安益对冲混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.42%	0.25%	0.24%	0.01%	1.18%	0.24%
过去三个月	2.39%	0.22%	0.68%	0.01%	1.71%	0.21%
自基金合同生效起至今	2.08%	0.21%	1.20%	0.01%	0.88%	0.20%

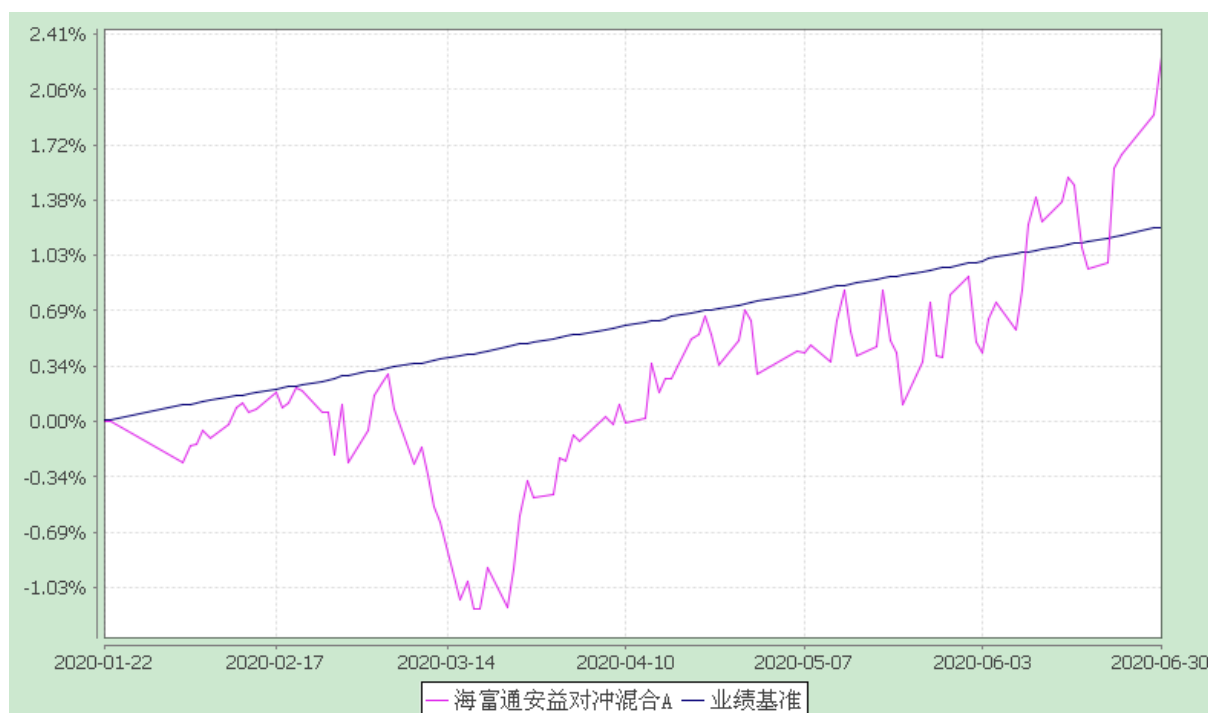
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金

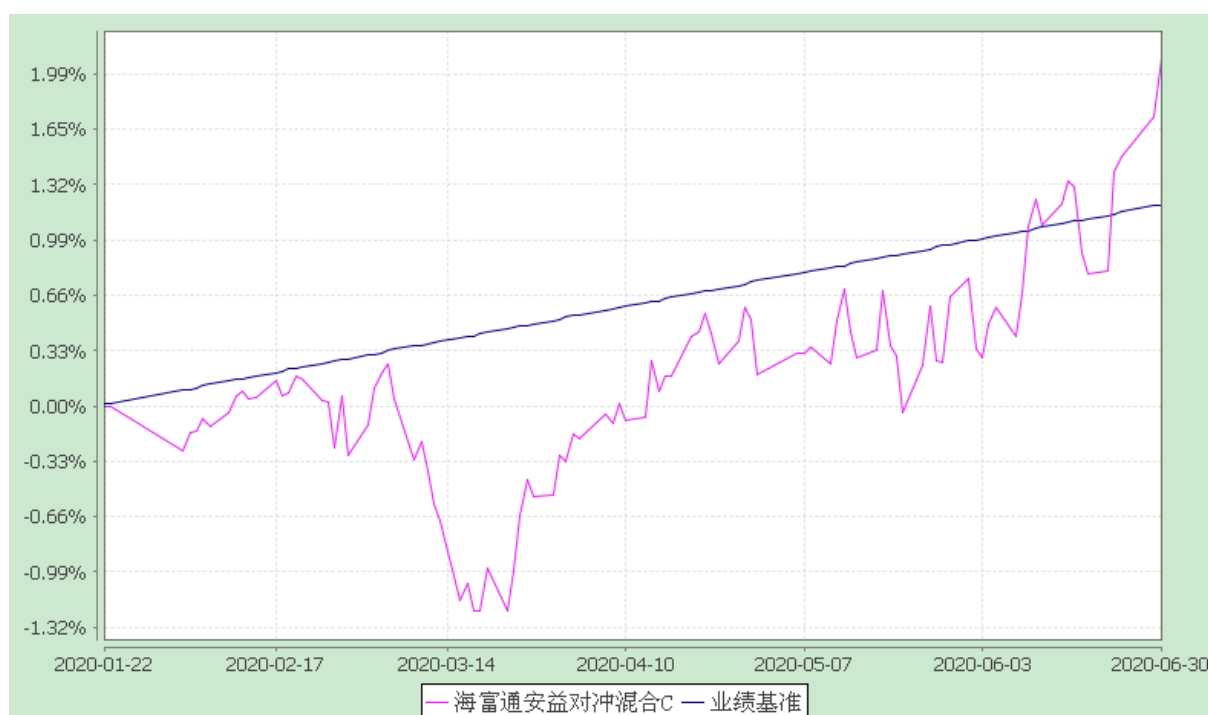
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020 年 1 月 22 日至 2020 年 6 月 30 日)

海富通安益对冲混合 A



海富通安益对冲混合 C



注：1、本基金合同于 2020 年 1 月 22 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。截止本报告期末，本基金尚处于建仓期。

§ 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

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2020 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 74 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通可转债优选债券型证券投资基金、海富通季季增利理财债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通季季通利理财债券型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债

交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
杜晓海	本基金的基金经理；海富通阿尔法对冲混合基金经理；海富通安颐收益混合基金经理；海富通创业板增强基金经理；海富通量化先锋股票基金经理；海富通稳固收益债券基金经理；海富通欣荣混合基金经理；海富通欣享混合基金经理；海富通新内需混合基金经理；海富通研究精选混合基金经理；海富通中证 500	2020-01-22	-	20 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监，现任海富通基金管理有限公司量化投资部总监。2016 年 6 月起任海富通新内需混合和海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 10 月兼任海富通沪深 300 增强（原海富通富睿混合）基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海

	增强基金经理；海富通添鑫收益债券基金经理；海富通富盈混合基金经理；海富通富泽混合基金经理；量化投资部总监。			富通创业板增强、海富通量化前锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月起兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月起兼任海富通中证 500 增强(原海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020 年 4 月起兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 5 月起兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。
--	---	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准为：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金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

2020 年上半年，全球各大经济体均显著受到新冠疫情的巨大冲击。目前看，中国采取了及时、得力的防控举措，在较短时间内抑制住了疫情发展并在二季度有效地推动复工复产。欧美等发达经济体、印度巴西等发展中国家的疫情防控相对滞后一些，经济运行的恢复时间、速度也比中国慢一些。为了应对疫情的巨大冲击，全球主要经济体的央行资产负债表明显扩张，全球呈现较显著的流动性宽松态势。目前看，整体宽松、低利率的环境还将持续一段时间。

先有疫情剧烈冲击、随后流动性显著宽松，全球资本市场基本呈现出剧烈波动、先大跌后大涨的态势，中国 A 股由于疫情防控得力、经济恢复相对较好而表现更好一些。上半年 A 股主要指数方面，上证指数下跌 2.15%，沪深 300 上涨 1.64%，中证 800 上涨 3.94%，中小板指上涨 20.85%，创业板指上涨 35.60%。分行业看，医药泛消费和科技成长行业领涨，医药、消费者服务、食品饮料、电子元器件、计算机分别上涨 41.54%、26.32%、25.41%、24.22% 和 22.92%；大金融、周期品显著落后，石油石化、煤炭、银行、非银行金融、房地产分别下跌 17.47%、15.53%、13.02%、10.67% 和 8.54%。

从上半年市场内部的结构看，业绩高确定和较高增长的资产获得了市场的追捧。内需类的医药、食品饮料、免税等板块是机构投资者看好和投资的主要方向，代表未来成长方向的新能源车产业链、消费电子、自主可控和半导体、新基建的 IDC 数据中心等也是机构投资者重要的布局领域，金融地产和部分传统行业短期受经济冲击影响较大，上半年明显跑输其他板块。

本报告期，本基金在控制回撤的基础上，力图寻找合适的股票投资机会以赚取绝对收益。同时，本基金积极参与新股申购，以增强投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通安益对冲混合 A 净值增长率为 2.27%，同期业绩比较基准收益率为 1.20%，基金净值跑赢业绩比较基准 1.07 个百分点；海富通安益对冲混合 C 净值增长率为 2.08%，同期业绩比较基准收益率为 1.20%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.88 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，虽然疫情可能有一定反复，但总体应该不会改变中国及全球经济逐步恢复的趋势。

国内社融短期仍维持宽松，但后续货币条件正常化将纳入监管层考量。本质上，我们相信疫情对国内外经济的冲击是一次外生冲击，未来半年至一年的经济及各行业不断修复、走向正常是相对确定的，节奏、结构则需要自下而上的密切跟踪和把握。

3 月下旬国内股市触底后，资本市场短期对于疫情走势、经济与各行业受到的冲击情况尚不清晰，同时国内外流动性较为充裕，因此二季度市场结构聚焦在长期看好、短期经营和业绩风险也不大的医药泛消费、科技成长的优质个股。展望下半年，随着经济及各行业继续向正常状态修复（2020 年上半年又是低基数），与宏观经济正相关的很多行业将迎来企业基本面的逐步好转，因此整体市场仍有不错的投资机会；预计下半年市场风格将相对均衡，大金融、周期品、制造业也开始涌现一些投资机会，而长期看好的医药泛消费、科技成长更需关注行业、个股的景气能否超预期。

本基金的股票现货投资将遵循长期有效的市场因子，主要投资于估值与成长性匹配，资产负债表健康的高质量个股，均衡配置，追求长期稳定的超额收益，并通过股指期货对冲将超额收益转化为绝对收益。同时，本基金依然会积极参与新股申购，努力增厚收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括主管基金运营的公司领导、投资管理负责人、合规负责人、风险管理负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会下设估值工作小组，估值工作小组对经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金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

2020 年上半年度，基金托管人在海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2020 年上半年度，海富通基金管理有限公司在海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2020 年上半年度，由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	42,918,562.57
结算备付金		431,364,891.88
存出保证金		159,869,701.57
交易性金融资产	6.4.7.2	2,229,102,073.29

其中：股票投资		1,744,897,647.42
基金投资		-
债券投资		484,204,425.87
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	50,000,000.00
应收证券清算款		32,137,912.05
应收利息	6.4.7.5	4,957,197.28
应收股利		61,997.18
应收申购款		248,197.14
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		2,950,660,532.96
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		9,978,657.44
应付赎回款		20,905,451.00
应付管理人报酬		3,579,073.12
应付托管费		596,512.20
应付销售服务费		87,692.85
应付交易费用	6.4.7.7	1,604,830.62
应交税费		11,660.42
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	146,864.70
负债合计		36,910,742.35
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	2,849,466,227.49
未分配利润	6.4.7.10	64,283,563.12
所有者权益合计		2,913,749,790.61
负债和所有者权益总计		2,950,660,532.96

注：1、报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额总额 2,849,466,227.49 份，其中 A 类基金份额总额 2,662,670,697.03 份，基金份额净值 1.0227 元；C 类基金份额总额 186,795,530.46 份，基金份额净值 1.0208 元。

2、基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.2 利润表

会计主体：海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2020 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		89,695,823.70
1.利息收入		14,882,578.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,074,632.58
债券利息收入		1,589,871.74
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,218,073.80
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,699,877.76
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,560,184.05
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	18,614.95
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-5,851,608.74
股利收益	6.4.7.16	14,972,687.50
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	63,330,210.33
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	783,157.49
减：二、费用		27,103,875.77
1. 管理人报酬		18,505,110.42
2. 托管费		3,084,185.06
3. 销售服务费		627,466.30
4. 交易费用	6.4.7.19	4,621,684.95
5. 利息支出		28,900.01
其中：卖出回购金融资产支出		28,900.01
6.税金及附加		130,458.88
7. 其他费用	6.4.7.20	106,070.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		62,591,947.93
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		62,591,947.93

注：财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 22 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日，上年

度可比期间无比较数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2020 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,758,124,517.00	-	2,758,124,517.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	62,591,947.93	62,591,947.93
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	91,341,710.49	1,691,615.19	93,033,325.68
其中：1.基金申购款	619,369,013.37	5,702,264.20	625,071,277.57
2.基金赎回款	-528,027,302.88	-4,010,649.01	-532,037,951.89
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,849,466,227.49	64,283,563.12	2,913,749,790.61

注：基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：胡光涛，会计机构负责人：胡正万

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2019] 2887 号《关于准予海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约

型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,757,795,773.42 元，已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 普华永道中天验字(2020)第 0056 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 1 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,758,124,517.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 328,743.58 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围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）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可交换债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、股指期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金可参与融资及融券业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%；投资银行存款和同业存单合计占比不超过基金资产的 20%；本基金权益类多头头寸价值减去权益类空头头寸价值，占基金资产净值比例范围 0-10%。其中，权益类多头头寸价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。权益空头头寸价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金投资于港股通标的股票的比例范围为股票资产的 0-50%。本基金不受中国证监会 2010 年 4 月 21 日发布的证监会公告【2010】13 号《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第（一）项、第（三）

项及第（五）项的限制。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。待基金投资其他品种的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并有效控制风险的前提下，经履行适当程序后，参与该类业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时，基金参与相应投资品种或业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项，将按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行。本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的同期三年期定期存款基准利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2020 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 22 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 22 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 22 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具(主要为股指期货投资)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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金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。本基金持有的其他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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具(主要为股指期货投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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在适用情况下由基金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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、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。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分

能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债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和债券，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，本基金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》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、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流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[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》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，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》及《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、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。

(2)对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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红

利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	42,918,562.57
定期存款	-
其他存款	-
合计	42,918,562.57

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,597,671,779.69	1,744,897,647.42	147,225,867.73	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	318,492,123.77	316,849,225.87	-1,642,897.90
	银行间市场	168,227,402.00	167,355,200.00	-872,202.00
	合计	486,719,525.77	484,204,425.87	-2,515,099.90
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	2,084,391,305.46	2,229,102,073.29	144,710,767.83	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-

货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-1,390,310,502.50	-	-	-
——股指期货	-1,390,310,502.50	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-1,390,310,502.50	-	-	-

注：于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货情况：持有卖出 IC2007 合约市值-96,270,040.00 元，公允价值变动-3,246,327.44 元。持有卖出 IC2009 合约市值-49,846,720.00 元，公允价值变动-5,185,746.67 元。持有卖出 IC2012 合约市值-21,986,400.00 元，公允价值变动-41,000.00 元。持有卖出 IF2007 合约市值-343,441,200.00 元，公允价值变动-22,115,103.67 元。持有卖出 IF2009 合约市值-921,311,400.00 元，公允价值变动-50,110,959.72 元。持有卖出 IF2012 合约市值-30,217,500.00 元，公允价值变动-357,780.00 元。持有卖出 IH2009 合约市值-8,617,800.00 元，公允价值变动-323,640.00 元。

衍生金融资产项下的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股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0 元。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	50,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	50,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	22,871.44
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	320,516.33
应收债券利息	4,608,563.37
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	4,999.90
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	246.24
合计	4,957,197.28

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,603,785.62
银行间市场应付交易费用	1,045.00
合计	1,604,830.62

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	44,196.61
应付证券出借违约金	-
预提费用	102,668.09
合计	146,864.70

6.4.7.9 实收基金

海富通安益对冲混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	2,359,336,836.26	2,359,336,836.26

本期申购	613,389,588.82	613,389,588.82
本期赎回（以“-”号填列）	-310,055,728.05	-310,055,728.05
本期末	2,662,670,697.03	2,662,670,697.03

海富通安益对冲混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	398,787,680.74	398,787,680.74
本期申购	5,979,424.55	5,979,424.55
本期赎回（以“-”号填列）	-217,971,574.83	-217,971,574.83
本期末	186,795,530.46	186,795,530.46

注：1、本基金自 2020 年 1 月 13 日至 2020 年 1 月 17 日期间公开发售，共募集有效净认购资金 2,757,795,773.42 元，折合为 2,757,795,773.42 份海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金基金份额，其中 A 类基金份额 2,359,044,097.42 份，C 类基金份额 398,751,676.00 份。根据《海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 328,743.58 元在本基金成立后，折算为 328,743.58 份基金份额（A 类基金份额为 292,738.84 份，C 类基金份额为 36,004.74 份），划入基金份额持有人账户。

2、根据《海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》、《海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告》相关规定，本基金于 2020 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 4 月 20 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购、赎回、转换、定投业务自 2020 年 4 月 21 日起开始办理。

3、申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

海富通安益对冲混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	-37,504.46	57,315,242.89	57,277,738.43
本期基金份额交易产生的变动数	-382,234.34	3,496,731.13	3,114,496.79
其中：基金申购款	-190,877.17	5,840,734.03	5,649,856.86

基金赎回款	-191,357.17	-2,344,002.90	-2,535,360.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-419,738.80	60,811,974.02	60,392,235.22

海富通安益对冲混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	-700,757.94	6,014,967.44	5,314,209.50
本期基金份额交易产生的变动数	332,693.39	-1,755,574.99	-1,422,881.60
其中：基金申购款	-2,413.79	54,821.13	52,407.34
基金赎回款	335,107.18	-1,810,396.12	-1,475,288.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-368,064.55	4,259,392.45	3,891,327.90

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
活期存款利息收入	988,683.07
定期存款利息收入	588,194.44
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	10,480,222.43
其他	17,532.64
合计	12,074,632.58

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
卖出股票成交总额	925,667,541.39
减：卖出股票成本总额	924,107,357.34
买卖股票差价收入	1,560,184.05

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	88,540,309.08

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	86,297,637.23
减：应收利息总额	2,224,056.90
买卖债券差价收入	18,614.95

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股指期货投资收益	-4,777,042.50
股指期货差价收入应缴纳增值税额	-1,074,566.24
合计	-5,851,608.74

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	14,972,687.50
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	14,972,687.50

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
1.交易性金融资产	144,710,767.83
——股票投资	147,225,867.73
——债券投资	-2,515,099.90
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-81,380,557.50
——权证投资	-
——股指期货	-81,380,557.50
4.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	63,330,210.33

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
基金赎回费收入	780,348.31
基金转换费收入	2,809.18
合计	783,157.49

注：本基金赎回费收入、转换费收入归入基金财产部分具体见本基金基金合同、招募说明书（更新）等法律文件规定。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
交易所市场交易费用	4,620,639.95
银行间市场交易费用	1,045.00
合计	4,621,684.95

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
审计费用	46,667.46
信息披露费	56,000.63
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,490.00
港股通证券组合费	912.06
合计	106,070.15

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金管理人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	1,701,986,846.14	49.43%

注：基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易，基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
海通证券	192,978,385.40	46.49%

注：基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
海通证券	5,601,600,000.00	79.73%

注：基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
海通证券	1,549,654.05	49.29%	505,405.51	31.51%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

3. 基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,505,110.42
其中：支付销售机构的客户维护费	8,549,543.17

注：1、支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

2、基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,084,185.06

注：1、支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为: 日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

2、基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日, 上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C	合计
交通银行	-	79,783.42	79,783.42
海通证券	-	52,614.01	52,614.01
海富通基金	-	133,001.95	133,001.95
合计	-	265,399.38	265,399.38

注：1、本基金 A 类份额不收取销售服务费, C 类份额的基金销售服务费年费率为 0.4%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.4%年费率计提, 逐日累计至每月月底,按月支付。销售服务费的计算方法如下: 日销售服务费=前一日 C 类份额的基金资产净值×0.4%/当年天数。

2、基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日, 上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金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, 基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日, 上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末未发生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, 基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日, 上年度可比期间无比较数据。

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

本基金本报告期末未发生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, 基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日, 上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	海富通安益对冲混合A	海富通安益对冲混合C
基金合同生效日（2020年1月22日）持有的基金份额	0.00	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	49,218,738.86	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	49,218,738.86	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.85%	-

注：1、本基金管理人运用固有资金总计 49,992,473.06 元转换入本基金，其中，补差手续费为 1,000 元。

2、基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金，基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	42,918,562.57	988,683.07

注：基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年6月30日

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券	300847	中船汉光	网下发行	1,421	9,861.74

注：基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项，基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002555	三七互娱	2020-05-12	2020-1-23	大宗交易	33.25	43.51	280,000	9,310,000.00	12,184,000.00	-
002624	完美世界	2020-02-27	2020-08-27	大宗交易	45.58	55.86	170,000	7,748,600.00	9,496,200.00	-
300418	昆仑万维	2020-03-03	2020-09-03	大宗交易	20.49	23.80	300,000	6,147,000.00	7,140,000.00	-
000063	中兴通讯	2020-04-02	2020-10-09	大宗交易	38.16	38.32	180,000	6,868,800.00	6,897,600.00	-
002938	鹏鼎控股	2020-05-06	2020-11-06	大宗交易	39.28	46.03	108,116	4,246,796.48	4,976,579.48	-
002127	南极电商	2020-04-24	2020-10-26	大宗交易	13.39	19.62	230,000	3,079,700.00	4,512,600.00	-
600055	万东医疗	2020-05-21	2020-11-23	大宗交易	14.65	14.60	300,000	4,395,000.00	4,380,000.00	-
603369	今世缘	2020-05-21	2020-11-23	大宗交易	35.32	37.23	100,000	3,532,000.00	3,723,000.00	-
300014	亿纬锂能	2020-06-30	2020-12-30	大宗交易	43.75	42.95	80,000	3,500,000.00	3,436,000.00	-
00260	世纪	2020-0	2020-1	大宗	13.18	14.30	230,00	3,031,	3,289,	-

2	华通	5-08	1-09	交易			0	400.00	000.00	
603690	至纯科技	2020-05-15	2020-11-16	大宗交易	34.30	37.61	80,000	2,744,000.00	3,008,800.00	-
300607	拓斯达	2020-06-09	2020-12-09	大宗交易	34.71	37.33	59,400	2,061,840.00	2,217,402.00	-
600332	白云山	2020-06-09	2020-12-09	大宗交易	30.00	30.84	70,000	2,100,000.00	2,158,800.00	-
688106	金宏气体	2020-06-09	2020-12-16	新股锁定流通受限	15.48	41.36	26,075	403.641.00	1,078,462.00	-
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	16.21	16.21	11,020	178.634.20	178.634.20	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股未上市	16.42	16.42	7,894	129.619.48	129.619.48	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102.389.40	102.389.40	-
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新股未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
12305	晨光	2020-0	2020-0	老股	100.00	100.00	1,380	138.00	138.00	-

5	转债	6-17	7-13	东配 债				0.00	0.00	
12701 7	万青 转债	2020-0 6-03	2020-0 7-02	老股 东配 债	100.00	100.00	890	89,000 .00	89,000 .00	-
12811 0	永兴 转债	2020-0 6-09	2020-0 7-08	老股 东配 债	100.00	100.00	30	3,000. 00	3,000. 00	-
12811 2	歌尔 转 2	2020-0 6-12	2020-0 7-13	老股 东配 债	100.00	100.00	2,790	279,00 0.00	279,00 0.00	-
12811 5	巨星 转债	2020-0 6-24	2020-0 7-16	老股 东配 债	100.00	100.00	3,920	392,00 0.00	392,00 0.00	-

注：1、基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行的股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

2、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

3、[300607]拓斯达于 2020-6-9 买入数量 33,000 股，成本 2,061,840.00 元；于 2020-6-29 送股，数量 26,400 股，因此总数量 59,400 股，平均认购单价：34.71 元/股。

[002555]三七互娱于 2020-05-12 买入数量 200,000 股，成本 6,714,000.00 元，限售到期日 2020-11-12，于 2020-05-22 买入数量 80,000 股，成本 2,596,000.00 元，限售到期日 2020-11-23。因此总数量 280,000 股，总成本 9,310,000.00 元，平均认购单价：33.25 元/股。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和督察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存

放在本基金的托管行交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 11.38%。基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	81,555,750.50
合计	81,555,750.50

注：1、未评级部分为国债。

2、基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	48,850,000.00
合计	48,850,000.00

注：基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末
--------	-----

	2020年6月30日
AAA	256,498,731.50
AAA 以下	26,220,860.37
未评级	71,079,083.50
合计	353,798,675.37

注：1、未评级部分为国债、政策性金融债。

2、基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金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模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 2.37%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	42,918,562.57	-	-	-	42,918,562.57
结算备付金	431,364,891.88	-	-	-	431,364,891.88
存出保证金	159,869,701.57	-	-	-	159,869,701.57
交易性金融资产	229,551,792.70	242,221,259.90	12,431,373.27	1,744,897,647.42	2,229,102,073.29
买入返售金融资产	50,000,000.00	-	-	-	50,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	32,137,912.05	32,137,912.05
应收申购款	-	-	-	248,197.14	248,197.14
应收利息	-	-	-	4,957,197.28	4,957,197.28
应收股利	-	-	-	61,997.18	61,997.18
资产总计	913,704,948.72	242,221,259.90	12,431,373.27	1,782,302,951.07	2,950,660,532.96
负债					
应付证券清算款	-	-	-	9,978,657.44	9,978,657.44
应付管理人报酬	-	-	-	3,579,073.12	3,579,073.12
应付销售服务费	-	-	-	87,692.85	87,692.85
应付托管费	-	-	-	596,512.20	596,512.20
应付交易费用	-	-	-	1,604,830.62	1,604,830.62
应付赎回款	-	-	-	20,905,451.00	20,905,451.00
应付赎回费	-	-	-	44,196.61	44,196.61
应付税费	-	-	-	11,660.42	11,660.42
其他负债	-	-	-	102,668.09	102,668.09
负债总计	-	-	-	36,910,742.35	36,910,742.35
利率敏感度缺口	913,704,948.72	242,221,259.90	12,431,373.27	1,745,392,208.72	2,913,749,790.61

注：1、表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

2、基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
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 2020年6月30日
	市场利率上升 25 个基点	-1,893,165.44
	市场利率下降 25 个基点	1,909,784.61

注：基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的 资产			
交易性金融资产	-	26,300,276.00	26,300,276.00
应收股利	-	61,997.18	61,997.18
资产合计	-	26,362,273.18	26,362,273.18
以外币计价的 负债			
应付证券清算 款	-	5.35	5.35
负债合计	-	5.35	5.35
资产负债表外	-	26,362,267.83	26,362,267.83

汇风险敞口净额			
---------	--	--	--

注：基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
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 2020 年 6 月 30 日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	1,318,113.39
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-1,318,113.39

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因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。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,744,897,647.42	59.88

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	-	-
合计	1,744,897,647.42	59.88

注：基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)外的其他市场变量保持不变	
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 2020 年 6 月 30 日
	业绩比较基准（附注 6.4.1）上升 5%	17,934,099.53
	业绩比较基准（附注 6.4.1）下降 5%	-17,934,099.53

注：基金合同成立于 2020 年 1 月 22 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.14 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，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,744,897,647.42	59.14
	其中：股票	1,744,897,647.42	59.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	484,204,425.87	16.41
	其中：债券	484,204,425.87	16.41
	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	50,000,000.00	1.69
	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	474,283,454.45	16.07
8	其他各项资产	197,275,005.22	6.69
9	合计	2,950,660,532.96	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	17,423,136.00	0.60
B	采矿业	35,666,757.20	1.22
C	制造业	937,228,298.41	32.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,122,663.32	0.24
E	建筑业	7,298,846.00	0.25
F	批发和零售业	41,758,771.00	1.43
G	交通运输、仓储和邮政业	17,702,932.66	0.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	181,278,818.05	6.22
J	金融业	340,636,019.04	11.69
K	房地产业	66,048,803.00	2.27
L	租赁和商务服务业	16,280,492.00	0.56
M	科学研究和技术服务业	23,788,716.00	0.82
N	水利、环境和公共设施管理业	3,589,354.44	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	11,783,780.10	0.40
R	文化、体育和娱乐业	10,989,984.20	0.38
S	综合	-	-
	合计	1,718,597,371.42	58.98

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
日常消费品	312,359.94	0.01
信息技术	20,725,588.22	0.71
原材料	5,262,327.84	0.18
合计	26,300,276.00	0.90

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	2,037,600	68,707,872.00	2.36
2	600519	贵州茅台	45,057	65,912,984.16	2.26
3	601318	中国平安	848,500	60,582,900.00	2.08
4	600276	恒瑞医药	496,660	45,841,718.00	1.57
5	600030	中信证券	1,670,547	40,276,888.17	1.38
6	000858	五粮液	198,300	33,933,096.00	1.16
7	002475	立讯精密	644,186	33,078,951.10	1.14
8	601398	工商银行	6,307,000	31,408,860.00	1.08
9	000333	美的集团	507,334	30,333,499.86	1.04
10	300760	迈瑞医疗	98,600	30,142,020.00	1.03
11	601166	兴业银行	1,869,400	29,499,132.00	1.01
12	601688	华泰证券	1,459,453	27,437,716.40	0.94
13	600570	恒生电子	247,990	26,708,523.00	0.92
14	603259	药明康德	246,260	23,788,716.00	0.82
15	002142	宁波银行	896,800	23,558,936.00	0.81
16	600048	保利地产	1,481,900	21,902,482.00	0.75
17	600031	三一重工	1,137,800	21,345,128.00	0.73
18	000338	潍柴动力	1,428,848	19,603,794.56	0.67
19	000568	泸州老窖	210,300	19,162,536.00	0.66
20	002001	新和成	658,500	19,162,350.00	0.66
21	600887	伊利股份	555,700	17,298,941.00	0.59
22	300014	亿纬锂能	357,147	16,697,483.95	0.57
23	002241	歌尔股份	559,631	16,430,766.16	0.56
24	00700	腾讯控股	36,000	16,395,882.62	0.56
25	000651	格力电器	263,800	14,923,166.00	0.51
26	000656	金科股份	1,814,400	14,805,504.00	0.51
27	002555	三七互娱	331,700	14,603,560.00	0.50
28	603939	益丰药房	160,040	14,563,640.00	0.50

29	300454	深信服	68,700	14,149,452.00	0.49
30	600585	海螺水泥	258,400	13,671,944.00	0.47
31	000001	平安银行	1,065,500	13,638,400.00	0.47
32	300059	东方财富	668,300	13,499,660.00	0.46
33	603444	吉比特	24,500	13,450,745.00	0.46
34	000002	万科A	508,700	13,297,418.00	0.46
35	000661	长春高新	30,400	13,233,120.00	0.45
36	300226	上海钢联	163,080	12,818,088.00	0.44
37	002624	完美世界	224,700	12,649,108.00	0.43
38	600309	万华化学	250,531	12,524,044.69	0.43
39	002415	海康威视	393,600	11,945,760.00	0.41
40	601888	中国中免	76,400	11,767,892.00	0.40
41	000961	中南建设	1,294,600	11,521,940.00	0.40
42	300750	宁德时代	65,700	11,455,452.00	0.39
43	601012	隆基股份	280,700	11,432,911.00	0.39
44	603369	今世缘	293,000	11,402,470.00	0.39
45	000625	长安汽车	1,026,400	11,290,400.00	0.39
46	002557	洽洽食品	204,100	11,060,179.00	0.38
47	002938	鹏鼎控股	227,716	10,963,755.48	0.38
48	600486	扬农化工	131,000	10,807,500.00	0.37
49	601933	永辉超市	1,141,600	10,708,208.00	0.37
50	600741	华域汽车	500,400	10,403,316.00	0.36
51	601899	紫金矿业	2,355,600	10,364,640.00	0.36
52	000975	银泰黄金	658,140	10,319,635.20	0.35
53	603986	兆易创新	42,320	9,983,711.20	0.34
54	002242	九阳股份	267,500	9,969,725.00	0.34
55	603538	美诺华	181,140	9,234,517.20	0.32
56	600547	山东黄金	250,900	9,187,958.00	0.32
57	600926	杭州银行	1,025,760	9,149,779.20	0.31
58	300316	晶盛机电	359,400	8,891,556.00	0.31
59	600521	华海药业	252,920	8,581,575.60	0.29
60	002410	广联达	122,800	8,559,160.00	0.29
61	600406	国电南瑞	407,000	8,241,750.00	0.28
62	300433	蓝思科技	293,561	8,231,450.44	0.28
63	000895	双汇发展	178,101	8,208,675.09	0.28
64	603501	韦尔股份	39,933	8,064,469.35	0.28
65	002714	牧原股份	96,250	7,892,500.00	0.27
66	002179	中航光电	189,425	7,768,319.25	0.27
67	300003	乐普医疗	200,500	7,322,260.00	0.25
68	300418	昆仑万维	300,000	7,140,000.00	0.25
69	300253	卫宁健康	301,080	6,906,775.20	0.24
70	000063	中兴通讯	180,000	6,897,600.00	0.24
71	002508	老板电器	218,700	6,803,757.00	0.23
72	300347	泰格医药	66,600	6,785,208.00	0.23

73	300601	康泰生物	41,700	6,762,072.00	0.23
74	002271	东方雨虹	164,400	6,679,572.00	0.23
75	002602	世纪华通	441,962	6,534,138.22	0.22
76	601799	星宇股份	50,300	6,388,100.00	0.22
77	000513	丽珠集团	131,300	6,303,713.00	0.22
78	002050	三花智控	285,180	6,245,442.00	0.21
79	600900	长江电力	327,200	6,197,168.00	0.21
80	300628	亿联网络	86,200	5,884,012.00	0.20
81	600588	用友网络	131,330	5,791,653.00	0.20
82	002332	仙琚制药	343,668	5,787,369.12	0.20
83	601088	中国神华	400,000	5,744,000.00	0.20
84	600438	通威股份	329,500	5,726,710.00	0.20
85	300607	拓斯达	145,260	5,711,045.40	0.20
86	002223	鱼跃医疗	156,200	5,685,680.00	0.20
87	000776	广发证券	396,000	5,591,520.00	0.19
88	300136	信维通信	104,500	5,540,590.00	0.19
89	688111	金山办公	16,180	5,526,764.40	0.19
90	002727	一心堂	148,200	5,499,702.00	0.19
91	600009	上海机场	76,100	5,484,527.00	0.19
92	300124	汇川技术	143,500	5,451,565.00	0.19
93	600745	闻泰科技	43,200	5,441,040.00	0.19
94	603737	三棵树	58,100	5,357,982.00	0.18
95	300144	宋城演艺	308,560	5,338,088.00	0.18
96	01787	山东黄金	350,000	5,262,327.84	0.18
97	002008	大族激光	144,400	5,191,180.00	0.18
98	002444	巨星科技	430,700	5,116,716.00	0.18
99	300036	超图软件	203,000	5,111,540.00	0.18
100	300498	温氏股份	233,520	5,090,736.00	0.17
101	600779	水井坊	81,239	5,070,938.38	0.17
102	601601	中国太保	185,700	5,060,325.00	0.17
103	300122	智飞生物	50,400	5,047,560.00	0.17
104	300015	爱尔眼科	114,218	4,962,772.10	0.17
105	601966	玲珑轮胎	242,100	4,890,420.00	0.17
106	601939	建设银行	748,467	4,722,826.77	0.16
107	603833	欧派家居	40,300	4,670,770.00	0.16
108	002396	星网锐捷	131,000	4,628,230.00	0.16
109	002697	红旗连锁	423,700	4,626,804.00	0.16
110	300308	中际旭创	72,100	4,542,300.00	0.16
111	002127	南极电商	230,000	4,512,600.00	0.15
112	600383	金地集团	328,500	4,500,450.00	0.15
113	002299	圣农发展	153,100	4,439,900.00	0.15
114	600055	万东医疗	302,500	4,420,025.00	0.15
115	002456	欧菲光	238,400	4,384,176.00	0.15
116	300747	锐科激光	40,200	4,374,966.00	0.15

117	600183	生益科技	148,900	4,358,303.00	0.15
118	300529	健帆生物	62,500	4,343,750.00	0.15
119	00763	中兴通讯	200,000	4,329,705.60	0.15
120	300413	芒果超媒	65,136	4,246,867.20	0.15
121	002352	顺丰控股	77,100	4,217,370.00	0.14
122	300525	博思软件	109,873	4,040,030.21	0.14
123	603583	捷昌驱动	58,000	3,966,040.00	0.14
124	002572	索菲亚	163,600	3,954,212.00	0.14
125	300482	万孚生物	38,000	3,952,000.00	0.14
126	603236	移远通信	18,840	3,918,720.00	0.13
127	603589	口子窖	76,100	3,873,490.00	0.13
128	000951	中国重汽	121,824	3,808,218.24	0.13
129	002028	思源电气	186,000	3,805,560.00	0.13
130	300033	同花顺	27,500	3,659,700.00	0.13
131	002632	道明光学	426,100	3,609,067.00	0.12
132	600029	南方航空	689,800	3,566,266.00	0.12
133	600201	生物股份	128,000	3,563,520.00	0.12
134	600216	浙江医药	183,400	3,532,284.00	0.12
135	600845	宝信软件	59,300	3,503,444.00	0.12
136	603288	海天味业	27,820	3,460,808.00	0.12
137	000725	京东方 A	735,700	3,435,719.00	0.12
138	002230	科大讯飞	91,700	3,432,331.00	0.12
139	600998	九州通	183,100	3,409,322.00	0.12
140	000860	顺鑫农业	59,800	3,407,404.00	0.12
141	603195	公牛集团	21,000	3,373,650.00	0.12
142	002032	苏泊尔	46,113	3,274,023.00	0.11
143	601108	财通证券	318,650	3,266,162.50	0.11
144	601117	中国化学	588,100	3,222,788.00	0.11
145	002690	美亚光电	60,600	3,187,560.00	0.11
146	600703	三安光电	127,200	3,180,000.00	0.11
147	601668	中国建筑	665,000	3,172,050.00	0.11
148	601877	正泰电器	120,100	3,164,635.00	0.11
149	000089	深圳机场	411,401	3,151,331.66	0.11
150	002080	中材科技	202,058	3,131,899.00	0.11
151	600019	宝钢股份	673,900	3,072,984.00	0.11
152	300559	佳发教育	142,800	3,030,216.00	0.10
153	603690	至纯科技	80,208	3,017,407.04	0.10
154	000938	紫光股份	65,700	2,823,786.00	0.10
155	002821	凯莱英	11,100	2,697,300.00	0.09
156	603228	景旺电子	75,840	2,668,809.60	0.09
157	601100	恒立液压	32,200	2,582,440.00	0.09
158	300702	天宇股份	22,900	2,434,728.00	0.08
159	600038	中直股份	58,000	2,382,060.00	0.08
160	000708	中信特钢	136,350	2,330,221.50	0.08

161	002371	北方华创	13,600	2,324,376.00	0.08
162	002643	万润股份	135,200	2,321,384.00	0.08
163	600176	中国巨石	247,600	2,265,540.00	0.08
164	300383	光环新网	86,800	2,262,876.00	0.08
165	000936	华西股份	175,400	2,192,500.00	0.08
166	002812	恩捷股份	32,900	2,164,820.00	0.07
167	300785	值得买	17,188	2,160,703.48	0.07
168	600332	白云山	70,000	2,158,800.00	0.07
169	300699	光威复材	33,600	2,107,728.00	0.07
170	002236	大华股份	109,300	2,099,653.00	0.07
171	603568	伟明环保	84,110	1,951,352.00	0.07
172	300119	瑞普生物	86,800	1,939,980.00	0.07
173	300474	景嘉微	27,100	1,823,830.00	0.06
174	002373	千方科技	76,000	1,823,240.00	0.06
175	600346	恒力石化	130,100	1,821,400.00	0.06
176	002605	姚记科技	45,900	1,744,200.00	0.06
177	600803	新奥股份	165,600	1,712,304.00	0.06
178	300659	中孚信息	28,400	1,704,568.00	0.06
179	300271	华宇软件	59,300	1,672,853.00	0.06
180	300832	新产业	9,682	1,667,143.58	0.06
181	000157	中联重科	254,853	1,638,704.79	0.06
182	600323	瀚蓝环境	74,863	1,638,002.44	0.06
183	300146	汤臣倍健	82,500	1,624,425.00	0.06
184	600380	健康元	100,000	1,624,000.00	0.06
185	002912	中新赛克	9,700	1,586,823.00	0.05
186	000100	TCL 科技	251,100	1,556,820.00	0.05
187	603368	柳药股份	67,200	1,542,240.00	0.05
188	002233	塔牌集团	124,100	1,492,923.00	0.05
189	300685	艾德生物	19,139	1,472,937.44	0.05
190	002439	启明星辰	33,461	1,407,704.27	0.05
191	600522	中天科技	121,500	1,391,175.00	0.05
192	600720	祁连山	83,467	1,356,338.75	0.05
193	002867	周大生	59,900	1,327,983.00	0.05
194	002916	深南电路	7,900	1,323,408.00	0.05
195	603658	安图生物	8,100	1,315,764.00	0.05
196	300138	晨光生物	104,535	1,269,054.90	0.04
197	300751	迈为股份	4,200	1,247,232.00	0.04
198	600612	老凤祥	25,000	1,204,750.00	0.04
199	601872	招商轮船	203,000	1,183,490.00	0.04
200	000768	中航飞机	65,600	1,163,744.00	0.04
201	002311	海大集团	24,100	1,146,919.00	0.04
202	002007	华兰生物	22,100	1,107,431.00	0.04
203	688106	金宏气体	26,075	1,078,462.00	0.04
204	000596	古井贡酒	7,039	1,057,539.36	0.04

205	300496	中科创达	13,400	1,041,180.00	0.04
206	300770	新媒股份	4,600	1,028,836.00	0.04
207	002511	中顺洁柔	45,942	1,024,506.60	0.04
208	000425	徐工机械	166,400	983,424.00	0.03
209	603659	璞泰来	9,500	978,690.00	0.03
210	000739	普洛药业	41,600	968,864.00	0.03
211	300602	飞荣达	29,192	958,081.44	0.03
212	002831	裕同科技	34,600	951,846.00	0.03
213	601336	新华保险	21,200	938,736.00	0.03
214	002601	龙蟠佰利	49,900	923,150.00	0.03
215	300572	安车检测	14,500	921,475.00	0.03
216	601818	光大银行	254,800	912,184.00	0.03
217	600109	国金证券	79,200	903,672.00	0.03
218	002695	煌上煌	35,600	897,832.00	0.03
219	002859	洁美科技	29,280	877,814.40	0.03
220	600373	中文传媒	74,100	872,898.00	0.03
221	300476	胜宏科技	35,600	856,180.00	0.03
222	600893	航发动力	36,100	847,628.00	0.03
223	300769	德方纳米	8,600	837,468.00	0.03
224	002841	视源股份	8,400	835,968.00	0.03
225	002664	长鹰信质	62,400	824,928.00	0.03
226	603899	晨光文具	14,800	808,080.00	0.03
227	601009	南京银行	109,800	804,834.00	0.03
228	600104	上汽集团	46,700	793,433.00	0.03
229	600461	洪城水业	122,500	780,325.00	0.03
230	000977	浪潮信息	19,900	779,682.00	0.03
231	002757	南兴股份	43,800	746,790.00	0.03
232	300327	中颖电子	22,640	733,536.00	0.03
233	002463	沪电股份	25,800	644,484.00	0.02
234	600285	羚锐制药	67,800	633,930.00	0.02
235	600872	中炬高新	10,600	620,418.00	0.02
236	603596	伯特利	15,500	545,600.00	0.02
237	000876	新希望	17,600	524,480.00	0.02
238	600761	安徽合力	52,668	507,719.52	0.02
239	600919	江苏银行	88,400	501,228.00	0.02
240	300451	创业慧康	26,050	481,664.50	0.02
241	300251	光线传媒	44,100	481,131.00	0.02
242	603160	汇顶科技	2,000	445,800.00	0.02
243	603517	绝味食品	6,100	431,514.00	0.01
244	002595	豪迈科技	20,700	402,822.00	0.01
245	603298	杭叉集团	31,373	345,730.46	0.01
246	002081	金螳螂	40,500	318,330.00	0.01
247	600170	上海建工	103,600	318,052.00	0.01
248	00288	万洲国际	51,500	312,359.94	0.01

249	603556	海兴电力	18,500	267,140.00	0.01
250	002013	中航机电	33,400	263,860.00	0.01
251	601390	中国中铁	41,300	207,326.00	0.01
252	002594	比亚迪	2,600	186,680.00	0.01
253	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.01
254	601211	国泰君安	8,400	144,984.00	0.00
255	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
256	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00
257	000538	云南白药	1,100	103,191.00	0.00
258	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
259	002677	浙江美大	8,900	100,392.00	0.00
260	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.00
261	600566	济川药业	3,700	94,202.00	0.00
262	601607	上海医药	4,400	80,872.00	0.00
263	600496	精工钢构	18,000	60,300.00	0.00
264	600933	爱柯迪	4,300	59,856.00	0.00
265	600236	桂冠电力	13,900	58,936.00	0.00
266	600597	光明乳业	3,900	57,954.00	0.00
267	002258	利尔化学	3,200	57,056.00	0.00
268	600967	内蒙一机	5,100	52,989.00	0.00
269	601021	春秋航空	1,500	52,860.00	0.00
270	002304	洋河股份	500	52,570.00	0.00
271	601222	林洋能源	9,600	52,416.00	0.00
272	601928	凤凰传媒	7,500	51,000.00	0.00
273	601225	陕西煤业	6,900	49,749.00	0.00
274	600377	宁沪高速	4,800	47,088.00	0.00
275	000789	万年青	3,300	42,471.00	0.00
276	002138	顺络电子	1,600	39,920.00	0.00
277	002626	金达威	1,400	36,344.00	0.00
278	603882	金域医学	400	35,800.00	0.00
279	600835	上海机电	2,100	35,553.00	0.00
280	603919	金徽酒	2,000	34,780.00	0.00
281	300773	拉卡拉	1,000	34,770.00	0.00
282	300207	欣旺达	1,800	34,020.00	0.00
283	601636	旗滨集团	5,500	32,560.00	0.00
284	601369	陕鼓动力	4,900	30,821.00	0.00
285	300088	长信科技	2,700	30,240.00	0.00
286	300274	阳光电源	2,100	30,219.00	0.00
287	603711	香飘飘	1,000	30,110.00	0.00
288	600219	南山铝业	14,200	28,826.00	0.00
289	600073	上海梅林	3,000	28,470.00	0.00
290	000598	兴蓉环境	6,100	28,060.00	0.00
291	601997	贵阳银行	3,800	27,208.00	0.00
292	002688	金河生物	4,000	27,120.00	0.00

293	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
294	600131	国网信通	1,400	26,558.00	0.00
295	300674	宇信科技	600	25,890.00	0.00
296	000877	天山股份	1,500	22,650.00	0.00
297	300741	华宝股份	600	22,128.00	0.00
298	300037	新宙邦	400	22,024.00	0.00
299	600195	中牧股份	1,300	21,099.00	0.00
300	600823	世茂股份	4,700	21,009.00	0.00
301	300259	新天科技	3,600	20,808.00	0.00
302	002726	龙大肉食	2,400	20,256.00	0.00
303	603365	水星家纺	1,400	20,202.00	0.00
304	002833	弘亚数控	800	19,624.00	0.00
305	603515	欧普照明	700	19,159.00	0.00
306	601139	深圳燃气	2,900	18,850.00	0.00
307	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
308	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
309	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
310	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
311	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
312	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
313	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
314	002869	金溢科技	100	6,608.00	0.00
315	600885	宏发股份	100	4,012.00	0.00
316	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
317	002353	杰瑞股份	110	3,410.00	0.00
318	600999	招商证券	100	2,195.00	0.00
319	600426	华鲁恒升	100	1,768.00	0.00
320	603609	禾丰牧业	100	1,490.00	0.00
321	300118	东方日升	91	1,365.00	0.00
322	600299	安迪苏	100	1,222.00	0.00
323	002128	露天煤业	100	775.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	78,868,514.14	2.71
2	600036	招商银行	72,643,573.18	2.49
3	600519	贵州茅台	55,047,958.10	1.89
4	600030	中信证券	51,065,254.43	1.75

5	002415	海康威视	42,133,561.35	1.45
6	600276	恒瑞医药	41,306,104.15	1.42
7	00700	腾讯控股	40,019,030.00	1.37
8	601688	华泰证券	37,011,816.88	1.27
9	000338	潍柴动力	36,082,385.60	1.24
10	601398	工商银行	35,490,259.00	1.22
11	601166	兴业银行	32,991,003.22	1.13
12	000002	万 科 A	32,303,244.08	1.11
13	000333	美的集团	28,597,250.23	0.98
14	000858	五 粮 液	28,045,563.16	0.96
15	002142	宁波银行	27,004,556.64	0.93
16	600048	保利地产	26,329,102.50	0.90
17	002007	华兰生物	26,100,433.50	0.90
18	000651	格力电器	25,762,169.30	0.88
19	300760	迈瑞医疗	23,275,423.63	0.80
20	002475	立讯精密	23,146,891.69	0.79

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002007	华兰生物	30,008,840.95	1.03
2	002415	海康威视	24,846,318.04	0.85
3	00700	腾讯控股	24,247,166.68	0.83
4	000338	潍柴动力	16,338,498.79	0.56
5	000002	万 科 A	15,138,621.13	0.52
6	601318	中国平安	12,485,697.54	0.43
7	002594	比亚迪	12,175,324.46	0.42
8	000661	长春高新	11,272,138.78	0.39
9	600030	中信证券	10,961,306.37	0.38
10	600028	中国石化	10,863,519.00	0.37
11	000961	中南建设	10,550,677.80	0.36
12	000063	中兴通讯	10,424,065.00	0.36
13	601628	中国人寿	10,278,268.00	0.35
14	002624	完美世界	9,428,132.21	0.32
15	601688	华泰证券	9,292,987.82	0.32
16	300525	博思软件	9,126,006.00	0.31
17	600183	生益科技	8,985,571.19	0.31
18	002353	杰瑞股份	8,920,119.16	0.31
19	300639	凯普生物	8,701,972.40	0.30

20	600779	水井坊	8,617,830.20	0.30
----	--------	-----	--------------	------

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,521,779,137.03
卖出股票的收入（成交）总额	925,667,541.39

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	91,591,750.50	3.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	61,043,083.50	2.10
	其中：政策性金融债	61,043,083.50	2.10
4	企业债券	122,597,000.00	4.21
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	160,122,591.87	5.50
8	同业存单	48,850,000.00	1.68
9	其他	-	-
10	合计	484,204,425.87	16.62

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	200001	20 付息国债 01	700,000	70,049,000.00	2.40

2	112012045	20 北京银行 CD045	500,000	48,850,000.00	1.68
3	132009	17 中油 EB	368,340	36,948,185.40	1.27
4	132013	17 宝武 EB	254,690	26,036,958.70	0.89
5	132008	17 山高 EB	250,000	25,710,000.00	0.88

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2007	IC2007	-83.00	-96,270,040.00	-3,246,327.44	-
IC2009	IC2009	-44.00	-49,846,720.00	-5,185,746.67	-
IC2012	IC2012	-20.00	-21,986,400.00	-41,000.00	-
IF2007	IF2007	-278.00	-343,441,200.00	-22,115,103.67	-
IF2009	IF2009	-755.00	-921,311,400.00	-50,110,959.72	-
IF2012	IF2012	-25.00	-30,217,500.00	-357,780.00	-
IH2009	IH2009	-10.00	-8,617,800.00	-323,640.00	-
公允价值变动总额合计					-81,380,557.50
股指期货投资本期收益					-5,851,608.74
股指期货投资本期公允价值变动					-81,380,557.50

注：股指期货投资本期收益中已扣除本期股指期货差价收入应缴纳增值税额。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 1,744,897,647.42 元，占基金资产净值的比例为 59.88%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-1,471,691,060.00 元，占基金资产净值的比例为-50.51%，空头合约市值占股票资产的比例为-84.34%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 10,681,262.81 元，公允价值变动损益为 65,845,310.23 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 报告期内本基金投资的 20 北京银行 CD045（112012045）的发行人，因个人消费贷款被挪用于支付购房首付款或投资股权、个别个人商办用房贷款违反房地产调控政策、同业投资通过信托通道违规发放土地储备贷款，于 2019 年 9 月 3 日被北京银保监局责令改正，并给予合计 110 万元罚款的行政处罚。因员工大额消费贷款违规行为长期未有效整改、同业业务专营部门制改革不到位、同业投资违规接受第三方金融机构信用担保，于 2019 年 9 月 25 日被北京银保监局责令改正，并给予合计 100 万元罚款的行政处罚。

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为地区中大型银行，综合实力强，信用风险可控。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.13.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.13.3 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	159,869,701.57
2	应收证券清算款	32,137,912.05
3	应收股利	61,997.18
4	应收利息	4,957,197.28
5	应收申购款	248,197.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	197,275,005.22

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	132009	17 中油 EB	36,948,185.40	1.27
2	132013	17 宝武 EB	26,036,958.70	0.89
3	132008	17 山高 EB	25,710,000.00	0.88
4	132015	18 中油 EB	24,500,000.00	0.84
5	132007	16 凤凰 EB	12,226,740.00	0.42
6	110045	海澜转债	2,031,960.00	0.07
7	132012	17 巨化 EB	2,030,000.00	0.07
8	113014	林洋转债	2,026,246.20	0.07
9	110034	九州转债	1,150,800.00	0.04
10	110033	国贸转债	972,990.00	0.03
11	110048	福能转债	967,950.00	0.03
12	127012	招路转债	906,570.00	0.03
13	113519	长久转债	746,340.00	0.03
14	113009	广汽转债	725,130.00	0.02
15	128044	岭南转债	695,240.00	0.02
16	113525	台华转债	691,210.00	0.02
17	128037	岩土转债	680,120.00	0.02
18	127011	中鼎转 2	615,120.00	0.02
19	128064	司尔转债	605,100.00	0.02
20	128085	鸿达转债	583,204.70	0.02
21	128071	合兴转债	573,426.90	0.02
22	113012	骆驼转债	514,550.00	0.02
23	113505	杭电转债	505,400.00	0.02

24	128058	拓邦转债	470,040.00	0.02
25	128010	顺昌转债	467,640.00	0.02
26	128046	利尔转债	456,440.00	0.02
27	113558	日月转债	452,302.40	0.02
28	128087	孚日转债	449,055.00	0.02
29	113017	吉视转债	396,520.00	0.01
30	113534	鼎胜转债	327,270.00	0.01
31	113030	东风转债	326,940.00	0.01
32	110041	蒙电转债	319,740.00	0.01
33	110059	浦发转债	297,402.00	0.01
34	110051	中天转债	297,288.00	0.01
35	110053	苏银转债	296,576.00	0.01
36	113019	玲珑转债	247,440.00	0.01
37	113537	文灿转债	242,756.50	0.01
38	113545	金能转债	229,960.00	0.01
39	128021	兄弟转债	228,960.00	0.01
40	113029	明阳转债	228,940.00	0.01
41	113547	索发转债	218,172.90	0.01
42	128083	新北转债	215,520.00	0.01
43	128022	众信转债	211,280.00	0.01
44	113021	中信转债	209,380.00	0.01
45	128081	海亮转债	207,740.00	0.01
46	113025	明泰转债	205,140.00	0.01
47	113532	海环转债	202,980.00	0.01
48	113530	大丰转债	202,840.00	0.01
49	113026	核能转债	199,880.00	0.01
50	123004	铁汉转债	193,740.00	0.01
51	110064	建工转债	152,580.00	0.01
52	110042	航电转债	113,100.00	0.00
53	113022	浙商转债	97,583.20	0.00
54	132004	15 国盛 EB	12,009.60	0.00

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
海富通安益对冲混合 A	8,546	311,569.24	1,139,380,802.44	42.79%	1,523,289,894.59	57.21%
海富通安益对冲混合 C	1,149	162,572.26	46,061,700.00	24.66%	140,733,830.46	75.34%
合计	9,695	293,910.91	1,185,442,502.44	41.60%	1,664,023,725.05	58.40%

注：本表基金机构/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,比例的分母采用基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	海富通安益对冲混合 A	2,702,621.00	0.1015%
	海富通安益对冲混合 C	924,434.11	0.4949%
	合计	3,627,055.11	0.1273%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	海富通安益对冲混合 A	>100
	海富通安益对冲混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通安益对冲混合 A	10~50
	海富通安益对冲混合 C	0
	合计	10~50

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C
基金合同生效日(2020年1月22日)基金份额总额	2,359,336,836.26	398,787,680.74
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	613,389,588.82	5,979,424.55

减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	310,055,728.05	217,971,574.83
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	2,662,670,697.03	186,795,530.46

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2020年5月26日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第三次会议审议通过，陶网雄先生由公司副总经理转任首席信息官。

2、2020年6月24日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第三次会议审议通过，聘请王智慧先生担任公司副总经理职务。

3、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	1,701,986,846.14	49.43%	1,549,654.05	49.29%	-

长江证券	1	714,469,101.48	20.75%	665,572.24	21.17%	-
国元证券	2	464,932,987.06	13.50%	428,861.63	13.64%	-
光大证券	1	324,516,419.32	9.42%	295,945.68	9.41%	-
华创证券	1	122,036,833.75	3.54%	111,350.63	3.54%	-
太平洋证券	2	68,718,610.05	2.00%	48,933.61	1.56%	-
申万宏源（原申万）	1	42,954,509.19	1.25%	40,003.20	1.27%	-
国泰君安	2	3,561,195.23	0.10%	3,316.13	0.11%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

2、(1)交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分,进行主观性评议,独立的评分,形成证券公司排名及交易单元租用意见。

(2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择:

<1> 推荐。投资部业务人员推荐,经投资部部门会议讨论,形成重点评估的证券公司备选池,从中进行甄选。原则上,备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的 200%。

<2> 甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定,进行主观性评议,独立的评分,形成证券公司排名及交易单元租用意见,并报公司总经理办公会核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后,由基金管理人的总经理办公会议核准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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	192,978,385.	46.49%	5,601,600,	79.73%	-	-

	40		000.00			
长江证券	177,819,404.40	42.84%	1,373,800,000.00	19.55%	-	-
国元证券	29,845,242.63	7.19%	-	-	-	-
光大证券	138,493.68	0.03%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	4,177,711.48	1.01%	-	-	-	-
申万宏源（原申万）	9,153,630.00	2.21%	-	-	-	-
国泰君安	956,500.60	0.23%	50,000,000.00	0.71%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-06
2	海富通基金管理有限公司关于海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额参加部分销售机构认购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-09
3	海富通基金管理有限公司关于海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金新增销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-11
4	海富通基金管理有限公司关于海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金新增销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-14
5	海富通基金管理有限公司关于海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额参加华泰证券股份有限公司认购费率优惠	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-15

	活动的公告		
6	海富通基金管理有限公司关于海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金新增销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-15
7	海富通基金管理有限公司关于海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金新增销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-16
8	海富通基金管理有限公司关于海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金提前结束募集的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-17
9	海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-23
10	海富通基金管理有限公司关于网上直销平台通联支付渠道新增部分银行卡并开展申购费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-02
11	海富通基金管理有限公司关于参加部分销售机构申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-04
12	海富通基金管理有限公司关于海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金规模控制的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-18
13	海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-18
14	海富通基金管理有限公司关于海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额实行网上直销费率优惠的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-20
15	海富通基金管理有限公司关于国泰君安证券股份有限公司开通海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-21
16	海富通基金管理有限公司关于海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额参加国泰君安证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-21
17	海富通基金管理有限公司关于海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金 A 类份额参加部分销售机构申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-21
18	海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-24
19	海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资	证券时报、基金管理人网	2020-05-11

	资基金恢复申购、转换转入、定期定额投资业务公告	站及中国证监会基金电子披露网站	
20	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信建投期货有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-20
21	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-22
22	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
23	海富通基金管理有限公司关于延迟和耕传承基金销售有限公司代销旗下基金的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
24	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宜信普泽（北京）基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
25	海富通基金管理有限公司关于变更直销中心交易传真号码的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-06
26	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大连网金基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-17
27	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-24
28	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 83 只公募基金。截至 2020 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1338 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事

会选聘为境内委托投资管理人。2011 年 12 月，海富通全资子公司——海富通资产管理（香港）有限公司获得证监会核准批复 RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2019 年 3 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威媒体《证券时报》授予第十四届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金和 2018 年度绝对收益明星基金。2019 年 4 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威财经媒体《中国证券报》和《上海证券报》分别评选为第十六届中国基金业金牛奖——三年期开放式混合型持续优胜金牛基金和第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·灵活配置型基金奖（三年期）。同时，海富通基金管理有限公司荣获《上海证券报》第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·成长基金管理公司奖。2020 年 3 月，由《中国证券报》主办的第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金牛进取奖”，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖项。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准设立海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金的文件
- （二）海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- （三）海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- （五）中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- （六）法律法规及中国证监会规定的其它文件

12.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36—37 层本基金管理人办公地址。

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇二〇年八月三十一日