

海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金
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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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 1 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.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
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.....	18
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 市场中性策略执行情况.....	55
7.13 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息	58

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	59
9 开放式基金份额变动	59
§10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息	66
§12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金	
基金简称	海富通阿尔法对冲混合	
基金主代码	519062	
交易代码	519062	
基金运作方式	契约型、发起式、开放式	
基金合同生效日	2014 年 11 月 20 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	11,099,691,952.63 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C
下属分级基金的交易代码	519062	008795
报告期末下属分级基金的份额总额	10,545,282,981.30 份	554,408,971.33 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活的投资策略，捕捉市场中的绝对收益机会，并且采用有效的风险管理措施，降低波动风险的同时，获取稳定的收益。
投资策略	本基金将主要通过阿尔法对冲等绝对收益策略，实现组合的稳定收益。同时本基金也根据市场环境的变化，灵活运用其他绝对收益策略，提高资金利用效率。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。 本基金通过多种绝对收益策略剥离市场系统风险，因此与一般的混合型基金相比，本基金的预期风险更小。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	许俊
	联系电话	021-38650788	010-66594319
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942

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	北京西城区复兴门内大街1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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	杨仓兵	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020年1月1日至2020年6月30日）	
	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C
本期已实现收益	17,189,977.05	-2,195,994.37
本期利润	328,319,904.95	11,031,262.02
加权平均基金份额本期利润	0.0503	0.0434
本期加权平均净值利润率	4.42%	3.81%
本期基金份额净值增长率	4.41%	3.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C
期末可供分配利润	768,961,989.58	39,411,232.57
期末可供分配基金份额利润	0.0729	0.0711
期末基金资产净值	12,238,703,577.07	642,380,072.46
期末基金份额净值	1.161	1.159
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	

	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C
基金份额累计净值增长率	60.71%	3.48%

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、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金于 2020 年 1 月 21 日发布公告,自 2020 年 1 月 22 日起增加一种新的收费模式份额-C 类基金份额。

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

海富通阿尔法对冲混合 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	1.49%	0.23%	0.24%	0.01%	1.25%	0.22%
过去三个月	2.56%	0.23%	0.68%	0.01%	1.88%	0.22%
过去六个月	4.41%	0.28%	1.36%	0.01%	3.05%	0.27%
过去一年	8.54%	0.23%	2.76%	0.01%	5.78%	0.22%
过去三年	31.95%	0.31%	8.49%	0.01%	23.46%	0.30%
自基金合同生效起至今	60.71%	0.32%	17.32%	0.01%	43.39%	0.31%

海富通阿尔法对冲混合 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	1.40%	0.22%	0.24%	0.01%	1.16%	0.21%
过去三个月	2.48%	0.23%	0.68%	0.01%	1.80%	0.22%
自基金合同生效起至今	3.48%	0.27%	1.20%	0.01%	2.28%	0.26%

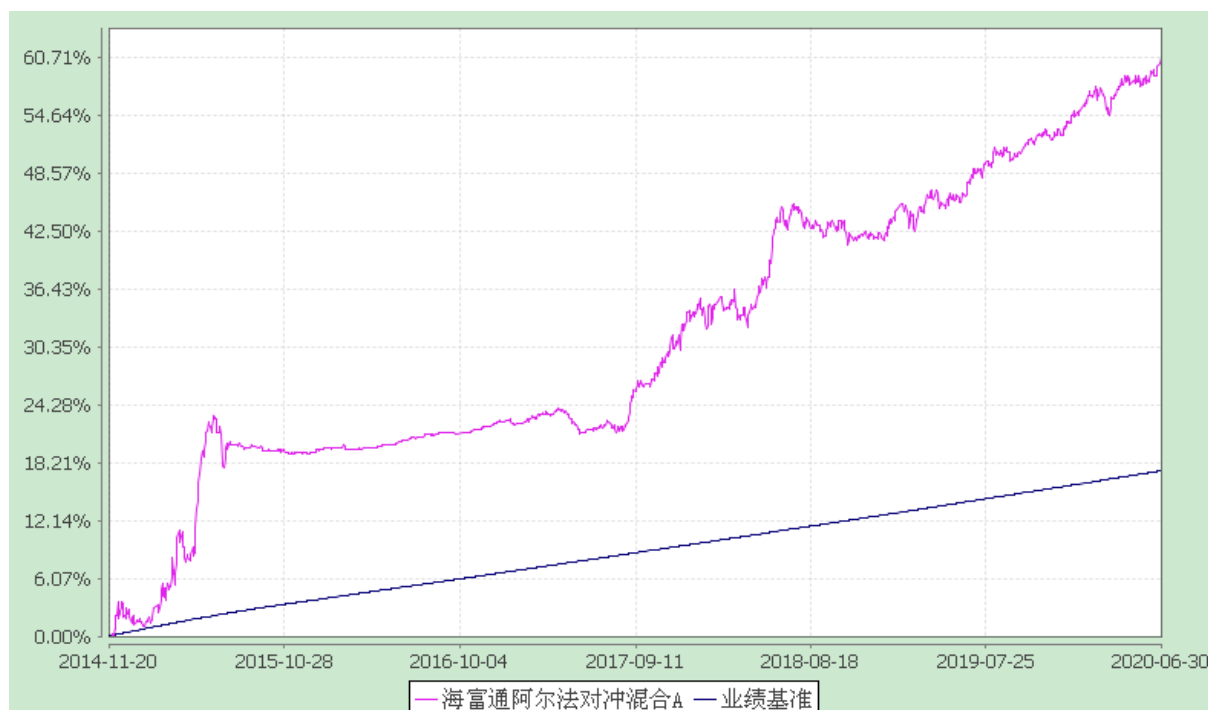
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金

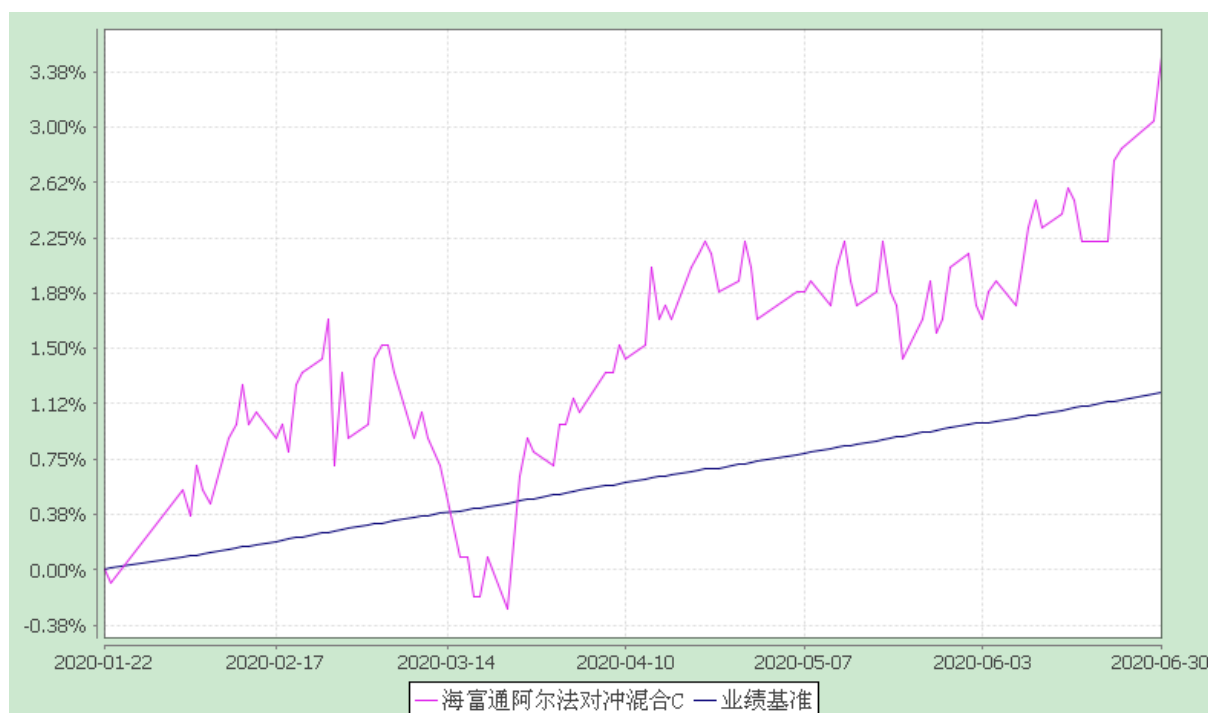
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014 年 11 月 20 日至 2020 年 6 月 30 日)

海富通阿尔法对冲混合 A



海富通阿尔法对冲混合 C



注：本基金合同于 2014 年 11 月 20 日生效，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。本基金于 2020 年 1 月 21 日发布公告，自 2020 年 1 月 22 日起增加一种新的收费模式份额-C 类基金份额。

§ 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；海富通安益对冲混合基	2018-04-09	-	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

	金经理；海富通中证 500 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。				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、海富通创业板增强、海富通量化前鋒股票、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。
朱斌全	本基金的基金经理；海富通富祥混合基金经理；海富通沪深 300 增强基金经理；海富通量化多因子混合基金经理；海富通欣益混合基金经理。	2018-11-30	-	13 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2006 年 8 月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交易员。2007 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，历任交易员、高级交易员、量化分析师、投资经理、基金经理助理。2018 年 11 月起任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通富祥混合、海富通沪深 300 增强（原海富通富睿混合）、海富通量化多因子混合及海富通欣益混合的基金经理。
陈林海	本基金的基金经理助理。	2020-05-11	-	8 年	经济学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任上海从容投资管理有限公司研究员，华泰柏瑞基金管理有限公司研究员、高级研究员。2015 年 9 月加入海富通基金管理有限公司，历任股票分析师、高级股票分析师。2020 年 5 月起担任海富通阿尔法对冲混合的基金经理助理。

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：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，海富通阿尔法对冲 A 净值增长率为 4.41%，同期业绩比较基准收益率为 1.36%，基金净值跑赢业绩比较基准 3.05 个百分点；海富通阿尔法对冲 C 净值增长率为 3.48%，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 2.28 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

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日该次可供分配利润的 30%。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金

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	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	246,453,132.88	179,548,914.16
结算备付金		1,643,735,948.24	314,966,327.32
存出保证金		626,399,999.95	195,407,203.01
交易性金融资产	6.4.7.2	9,633,826,500.89	2,731,036,196.46
其中：股票投资		7,107,130,138.45	2,281,792,181.20
基金投资		-	-
债券投资		2,526,696,362.44	449,244,015.26
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	550,000,000.00	-
应收证券清算款		124,549,620.63	21,578,404.99
应收利息	6.4.7.5	30,124,298.40	6,928,764.69
应收股利		-	-
应收申购款		134,749,892.30	29,500,552.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		12,989,839,393.29	3,478,966,363.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		49,908,323.24	10,556,699.16
应付赎回款		35,856,913.46	161,589,819.69

应付管理人报酬		15,253,514.27	4,478,430.03
应付托管费		2,542,252.38	746,405.01
应付销售服务费		209,783.32	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,720,517.59	1,165,758.57
应交税费		90,639.63	5,869.78
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	173,799.87	789,677.45
负债合计		108,755,743.76	179,332,659.69
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	11,099,691,952.63	2,968,495,020.59
未分配利润	6.4.7.10	1,781,391,696.90	331,138,683.09
所有者权益合计		12,881,083,649.53	3,299,633,703.68
负债和所有者权益总计		12,989,839,393.29	3,478,966,363.37

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.160 元，基金份额总额 11,099,691,952.63 份。其中 A 类基金份额总额 10,545,282,981.30 份，基金份额净值 1.161 元；C 类基金份额总额 554,408,971.33 份，基金份额净值 1.159 元。

6.2 利润表

会计主体：海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 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 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		420,244,363.03	75,975,036.22
1.利息收入		32,735,746.81	5,108,998.99
其中：存款利息收入	6.4.7.11	20,542,923.92	1,494,584.20
债券利息收入		10,326,865.70	2,694,158.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,865,957.19	920,256.39
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		55,484,445.55	14,685.86
其中：股票投资收益	6.4.7.12	156,131,177.17	72,056,871.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	10,023,243.46	2,657,309.55
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	-168,365,766.83	-86,357,127.09
股利收益	6.4.7.16	57,695,791.75	11,657,631.67
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	324,357,184.29	68,356,923.27
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	7,666,986.38	2,494,428.10
减：二、费用		80,893,196.06	15,527,232.55
1. 管理人报酬		56,971,223.84	10,346,607.21
2. 托管费		9,495,204.09	1,724,434.52
3. 销售服务费		496,153.62	-
4. 交易费用	6.4.7.19	13,459,600.73	3,297,562.68
5. 利息支出		2,623.21	2,848.72
其中：卖出回购金融资产支出		2,623.21	2,848.72
6.税金及附加		297,302.28	4,376.20
7. 其他费用	6.4.7.20	171,088.29	151,403.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		339,351,166.97	60,447,803.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		339,351,166.97	60,447,803.67

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 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）	2,968,495,020.59	331,138,683.09	3,299,633,703.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	339,351,166.97	339,351,166.97
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）	8,131,196,932.04	1,110,901,846.84	9,242,098,778.88
其中：1.基金申购款	10,223,030,967.04	1,382,111,626.10	11,605,142,593.14
2.基金赎回款	-2,091,834,035.00	-271,209,779.26	-2,363,043,814.26
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	11,099,691,952.63	1,781,391,696.90	12,881,083,649.53

项目	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	1,024,993,285.55	213,284,202.19	1,238,277,487.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	60,447,803.67	60,447,803.67
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）	279,818,856.03	63,507,054.43	343,325,910.46
其中：1.基金申购款	917,654,139.34	210,157,816.38	1,127,811,955.72
2.基金赎回款	-637,835,283.31	-146,650,761.95	-784,486,045.26
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）	1,304,812,141.58	337,239,060.29	1,642,051,201.87

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

海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金(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[2014]895 号《关于核准海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金募集申请的批复》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《海富通阿尔法对冲混合型发起式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 719,531,193.38 元，业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(2014)第 680 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2014 年 11 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 719,877,758.17 份基金份额，其中认购资金利息折合 346,564.79 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，基金募集份额总额不少于 5,000 万份，基金募集金额不少于 5,000 万元，其中基金管理人作为发起资金的提供方认购的金额为 1,000 万元且承诺持有期限不少于三年。

根据本基金管理人海富通基金管理有限公司 2020 年 1 月 21 日《关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2020 年 1 月 22 日起对本基金增加 C 类份额并相应修改基金合同。本基金原有的基金份额类别更名为 A 类基金份额，新增的基金份额类别命名为 C 类基金份额，并对 C 级份额收取销售服务费。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、股指期货、权证、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以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)。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%~120%之间。在每个交易日日终持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，在扣除股指期货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。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率(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》、《海富通阿尔法对冲混合型发起式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 上半年度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 上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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	246,453,132.88
定期存款	-
其他存款	-
合计	246,453,132.88

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	6,297,058,342.98	7,107,130,138.45	810,071,795.47
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,971,077,156.70	1,952,729,562.44
	银行间市场	576,769,938.00	573,966,800.00
	合计	2,547,847,094.70	2,526,696,362.44
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	8,844,905,437.68	9,633,826,500.89	788,921,063.21

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			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-5,712,044,134.70	-	-	-
——股指期货	-5,712,044,134.70	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-5,712,044,134.70	-	-	-

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-354,923,280.00 元，公允价值变动-13,854,640.00 元；卖出 IC2009 合约市值-274,156,960.00 元，公允价值变动-24,029,634.53 元；卖出 IC2012 合约市值-43,972,800.00 元，公允价值变动-16,080.00 元；卖出 IF2007 合约市值-1,248,989,400.00 元，公允价值变动-78,976,530.77 元；卖出 IF2009 合约市值-3,720,633,720.00 元，公允价值变动-181,190,580.00 元；卖出 IF2012 合约市值-369,862,200.00 元，公允价值变动-2,426,760.00 元；公允价值变动合计-300,494,225.30 元。

衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。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。

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	550,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	550,000,000.00	-

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	74,574.05
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	4,257,673.65
应收债券利息	25,746,231.08
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	39,452.04
应收申购款利息	5,421.86
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	945.72
合计	30,124,298.40

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	4,718,937.59
银行间市场应付交易费用	1,580.00
合计	4,720,517.59

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	64,401.49
应付证券出借违约金	-
预提费用	109,398.38
合计	173,799.87

6.4.7.9 实收基金

海富通阿尔法对冲混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日

	基金份额	账面金额
上年度末	2,968,495,020.59	2,968,495,020.59
本期申购	9,580,896,094.89	9,580,896,094.89
本期赎回（以“-”号填列）	-2,004,108,134.18	-2,004,108,134.18
本期末	10,545,282,981.30	10,545,282,981.30

海富通阿尔法对冲混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月22日至2020年6月30日	
	基金份额	账面金额
本期申购	642,134,872.15	642,134,872.15
本期赎回（以“-”号填列）	-87,725,900.82	-87,725,900.82
本期末	554,408,971.33	554,408,971.33

注： 1、申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金于 2020 年 1 月 21 日发布公告，自 2020 年 1 月 22 日起增加一种新的收费模式份额-C 类基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

海富通阿尔法对冲混合 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
上年度末	204,682,486.17	126,456,196.92	331,138,683.09
本期利润	17,189,977.05	311,129,927.90	328,319,904.95
本期基金份额交易产生的变动数	547,089,526.36	486,872,481.37	1,033,962,007.73
其中：基金申购款	670,171,863.12	622,458,755.46	1,292,630,618.58
基金赎回款	-123,082,336.76	-135,586,274.09	-258,668,610.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	768,961,989.58	924,458,606.19	1,693,420,595.77

海富通阿尔法对冲混合 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	-2,195,994.37	13,227,256.39	11,031,262.02
本期基金份额交易产生的	41,607,226.94	35,332,612.17	76,939,839.11

变动数			
其中：基金申购款	48,254,597.08	41,226,410.44	89,481,007.52
基金赎回款	-6,647,370.14	-5,893,798.27	-12,541,168.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	39,411,232.57	48,559,868.56	87,971,101.13

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	1,044,087.39
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	19,216,206.26
其他	282,630.27
合计	20,542,923.92

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	4,160,665,662.74
减：卖出股票成本总额	4,004,534,485.57
买卖股票差价收入	156,131,177.17

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1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	326,117,735.72
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	311,321,692.42
减：应收利息总额	4,772,799.84
买卖债券差价收入	10,023,243.46

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1日至2020年6月30日
股指期货投资收益（税前）	-166,027,043.79
股指期货差价收入应缴纳增值税额	-2,338,723.04
合计	-168,365,766.83

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	57,695,791.75
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	57,695,791.75

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1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	536,407,560.50
——股票投资	566,817,442.25
——债券投资	-30,409,881.75
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-212,050,376.21
——权证投资	-
——股指期货	-212,050,376.21
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	324,357,184.29

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	7,341,672.33
基金转换费收入	325,314.05

合计	7,666,986.38
----	--------------

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1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	13,456,220.73
银行间市场交易费用	3,380.00
合计	13,459,600.73

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	600.00
银行划款手续费	43,089.91
合计	171,088.29

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

截至本财务报表报出日，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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、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1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
海通证券	3,658,083,038.89	29.48%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1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	2,641,270.02	35.49%	2,431,800.66	51.53%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	-	-	-	-

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。

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1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	56,971,223.84	10,346,607.21
其中：支付销售机构的客户维护费	7,346,963.32	2,344,580.08

注：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 1.50% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,495,204.09	1,724,434.52

注：支付基金托管人中国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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% \div \text{当年天数}。$$

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1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C	合计
中国银行	-	4,082.89	4,082.89
海通证券	-	2,208.22	2,208.22
海富通基金	-	173,747.76	173,747.76
合计	-	180,038.87	180,038.87
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C	合计

合计	-	-	-
----	---	---	---

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类份额对应的基金资产净值的年费率 0.40% 计提，逐日累计至每月月底，按月支付给海富通，再由海富通计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日 C 类份额对应的基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

2、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金于 2020 年 1 月 21 日发布公告，自 2020 年 1 月 22 日起增加一种新的收费模式份额-C 类基金份额，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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	246,453,132.88	1,044,087.39	29,038,963.71	274,087.03

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 1 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
上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	-	-	-	-	-

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

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未实施利润分配。

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
000063	中兴通讯	2020-04-02	2020-10-09	大宗交易	38.16	38.32	1,400,000	53,424,000.00	53,648,000.00	-
002127	南极电商	2020-04-24	2020-10-26	大宗交易	13.39	19.62	730,000	9,774,700.00	14,322,600.00	-
002456	欧菲光	2020-06-11	2020-12-11	大宗交易	15.54	16.61	1,430,000	22,222,200.00	23,752,300.00	-
002555	三七互娱	2020-05-12	2020-11-23	大宗交易	33.25	43.51	890,000	29,541,300.00	38,720,400.00	-
002602	世纪华通	2020-06-15	2020-12-15	大宗交易	13.02	14.10	1,000,000	13,020,000.00	14,100,000.00	-

002624	完美世界	2020-02-27	2020-08-27	大宗交易	45.58	55.86	400,000	18,232,000.00	22,344,000.00	-
002938	鹏鼎控股	2020-05-06	2020-01-06	大宗交易	39.28	46.03	500,000	19,640,000.00	23,015,000.00	-
300014	亿纬锂能	2020-06-30	2020-02-30	大宗交易	43.75	42.95	330,000	14,437,500.00	14,173,500.00	-
300418	昆仑万维	2020-03-03	2020-09-03	大宗交易	20.49	23.80	700,000	14,343,000.00	16,660,000.00	-
300607	拓斯达	2020-06-09	2020-02-09	大宗交易	34.71	37.33	178,200	6,185,520.00	6,652,206.00	-
300659	中孚信息	2020-06-24	2020-02-24	大宗交易	55.45	54.54	90,000	4,990,500.00	4,908,600.00	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
600332	白云山	2020-06-09	2020-02-09	大宗交易	30.00	30.84	280,000	8,400,000.00	8,635,200.00	-
603369	今世缘	2020-05-21	2020-01-21	大宗交易	35.32	37.23	400,000	14,128,000.00	14,892,000.00	-
603690	至纯科技	2020-05-15	2020-01-15	大宗交易	34.30	37.61	400,000	13,720,000.00	15,044,000.00	-
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	-
688222	成都先导	2020-04-16	2020-00-16	新股锁定	20.52	43.70	9,201	188,804.52	402,083.70	-

				流通受限						
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	-
688516	奥特维	2020-05-21	2020-11-23	新股锁定流通受限	23.28	43.10	3,440	80,083.20	148,264.00	-
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	-
688555	泽达易盛	2020-06-23	2020-12-23	新股锁定流通受限	19.49	56.80	3,004	58,547.96	170,627.20	-
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	-
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
123055	晨光转债	2020-06-17	2020-07-13	老股东配债	100.00	100.00	8,700	870,000.00	870,000.00	-
127017	万青转债	2020-06-03	2020-07-02	老股东配债	100.00	100.00	3,400	340,000.00	340,000.00	-
128112	歌尔转2	2020-06-12	2020-07-13	老股东配债	100.00	100.00	7,740	774,000.00	774,000.00	-
128115	巨星转债	2020-06-24	2020-07-16	老股东配债	100.00	100.00	9,160	916,000.00	916,000.00	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限证券。

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

本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及股指期货等。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中国银行，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。

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占基金资产净值的比例为 14.76%(2019 年 12 月 31 日，持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 8.71%)。

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	上年末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	334,798,962.20	96,251,721.80
合计	334,798,962.20	96,251,721.80

注：未评级部分为国债和政策性金融债。

6.4.13.2.2 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	上年末 2019年12月31日
AAA	1,623,701,696.00	244,861,449.32
AAA 以下	277,022,718.74	42,546,241.64
未评级	291,172,985.50	65,584,602.50

合计	2,191,897,400.24	352,992,293.46
----	------------------	----------------

注：未评级部分为政策性金融债和国债。

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 2.11%。

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、债券投资和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	246,453,132.88	-	-	-	246,453,132.88
结算备付金	1,643,735,948.24	-	-	-	1,643,735,948.24
存出保证金	626,399,999.95	-	-	-	626,399,999.95
交易性金融资产	946,781,610.32	1,404,838,715.32	175,076,036.80	7,107,130,138.45	9,633,826,500.89
应收申购款	-	-	-	134,749,892.30	134,749,892.30
买入返售金融资产	550,000,000.00	-	-	-	550,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	124,549,620.63	124,549,620.63
应收利息	-	-	-	30,124,298.40	30,124,298.40
资产总计	4,013,370,691.39	1,404,838,715.32	175,076,036.80	7,396,553,949.78	12,989,839,393.29
负债					
应付证券清算款	-	-	-	49,908,323.24	49,908,323.24
应付管理人报酬	-	-	-	15,253,514.27	15,253,514.27
应付托管费	-	-	-	2,542,252.38	2,542,252.38
应付销售服务费	-	-	-	209,783.32	209,783.32
应付交易费用	-	-	-	4,720,517.59	4,720,517.59
应交税金	-	-	-	90,639.63	90,639.63
应付赎回款	-	-	-	35,856,913.46	35,856,913.46
其他负债	-	-	-	173,799.87	173,799.87
负债总计	-	-	-	108,755,743.76	108,755,743.76
利率敏感度缺口	4,013,370,691.39	1,404,838,715.32	175,076,036.80	7,287,798,206.02	12,881,083,649.53
上年度末					
2019 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	179,548,914.16	-	-	-	179,548,914.16
结算备付金	314,966,327.32	-	-	-	314,966,327.32

					2
存出保证金	195,407,203.01	-	-	-	195,407,203.01
交易性金融资产	231,594,459.90	70,393,340.03	147,256,215.33	2,281,792,181.20	2,731,036,196.46
应收申购款	-	-	-	29,500,552.74	29,500,552.74
应收证券清算款	-	-	-	21,578,404.99	21,578,404.99
应收利息	-	-	-	6,928,764.69	6,928,764.69
资产总计	921,516,904.39	70,393,340.03	147,256,215.33	2,339,799,903.62	3,478,966,363.37
负债					
应付证券清算款	-	-	-	10,556,699.16	10,556,699.16
应付管理人报酬	-	-	-	4,478,430.03	4,478,430.03
应付托管费	-	-	-	746,405.01	746,405.01
应付交易费用	-	-	-	1,165,758.57	1,165,758.57
应交税金	-	-	-	5,869.78	5,869.78
应付赎回款	-	-	-	161,589,819.69	161,589,819.69
其他负债	-	-	-	789,677.45	789,677.45
负债总计	-	-	-	179,332,659.69	179,332,659.69
利率敏感度缺口	921,516,904.39	70,393,340.03	147,256,215.33	2,160,467,243.93	3,299,633,703.68

注：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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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	上年度末 2019年12月31日
		市场利率上升 25 个基点	-19,431,682.46
市场利率下降 25 个基点	19,550,536.60	2,923,029.26	

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

的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

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交易的股票,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,基于定量与定性相结合的宏观及市场分析,形成对不同市场周期的预测和判断,通过灵活主动且有纪律的资产配置,确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例,追求较高的收益,同时规避市场的系统性风险。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。本基金投资组合中权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%~120%之间。其中:权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值;权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。在每个交易日日终持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 95%,在扣除股指期货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%。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		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	7,107,130,13 8.45	55.17	2,281,792,181 .20	69.15

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,107,130,13	55.17	2,281,792,181	69.15
	8.45		.20	

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(6.4.1)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	上年度末 2019年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	78,506,034.60	20,909,554.80
	2. 业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	-78,506,034.60	-20,909,554.80

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	7,107,130,138.45	54.71
	其中：股票	7,107,130,138.45	54.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,526,696,362.44	19.45
	其中：债券	2,526,696,362.44	19.45
	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	550,000,000.00	4.23
	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	1,890,189,081.12	14.55
8	其他各项资产	915,823,811.28	7.05
9	合计	12,989,839,393.29	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	90,771,862.00	0.70
B	采矿业	150,550,323.91	1.17
C	制造业	3,949,202,582.65	30.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,358,151.80	0.38
E	建筑业	38,234,597.17	0.30
F	批发和零售业	179,619,375.13	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	77,054,969.72	0.60
H	住宿和餐饮业	793,650.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	777,201,446.66	6.03
J	金融业	1,273,973,526.08	9.89
K	房地产业	233,445,535.20	1.81
L	租赁和商务服务业	63,103,746.97	0.49
M	科学研究和技术服务业	100,818,000.30	0.78
N	水利、环境和公共设施管理业	16,333,715.76	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	56,267,039.00	0.44
R	文化、体育和娱乐业	51,401,616.10	0.40
S	综合	-	-
	合计	7,107,130,138.45	55.17

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	192,452	281,534,181.76	2.19
2	601318	中国平安	3,499,574	249,869,583.60	1.94
3	600036	招商银行	6,583,198	221,985,436.56	1.72
4	600276	恒瑞医药	1,877,210	173,266,483.00	1.35
5	600030	中信证券	6,458,700	155,719,257.00	1.21
6	002475	立讯精密	2,868,653	147,305,331.55	1.14
7	000858	五粮液	770,900	131,916,408.00	1.02
8	000333	美的集团	2,200,700	131,579,853.00	1.02
9	600570	恒生电子	1,096,177	118,058,262.90	0.92
10	300760	迈瑞医疗	369,284	112,890,118.80	0.88
11	002142	宁波银行	3,843,422	100,966,695.94	0.78
12	601688	华泰证券	5,319,300	100,002,840.00	0.78
13	603259	药明康德	1,028,946	99,396,183.60	0.77
14	600031	三一重工	5,202,758	97,603,740.08	0.76
15	601166	兴业银行	6,143,000	96,936,540.00	0.75
16	600585	海螺水泥	1,720,929	91,054,353.39	0.71
17	002241	歌尔股份	2,540,100	74,577,336.00	0.58
18	000338	潍柴动力	5,080,081	69,698,711.32	0.54
19	300014	亿纬锂能	1,444,652	67,509,598.20	0.52
20	000656	金科股份	8,187,771	66,812,211.36	0.52
21	601398	工商银行	13,351,900	66,492,462.00	0.52
22	600887	伊利股份	2,048,400	63,766,692.00	0.50
23	000568	泸州老窖	693,963	63,233,908.56	0.49
24	000651	格力电器	1,101,500	62,311,855.00	0.48
25	000661	长春高新	138,761	60,402,663.30	0.47
26	603444	吉比特	109,600	60,171,496.00	0.47
27	300454	深信服	287,567	59,227,299.32	0.46
28	600048	保利地产	3,989,783	58,968,992.74	0.46
29	603939	益丰药房	641,140	58,343,740.00	0.45
30	300059	东方财富	2,755,980	55,670,796.00	0.43
31	000001	平安银行	4,328,520	55,405,056.00	0.43
32	002001	新和成	1,890,400	55,010,640.00	0.43
33	000063	中兴通讯	1,400,000	53,648,000.00	0.42
34	002415	海康威视	1,693,488	51,397,360.80	0.40

35	002624	完美世界	896,500	50,962,260.00	0.40
36	300226	上海钢联	646,907	50,846,890.20	0.39
37	002555	三七互娱	1,144,200	50,616,960.00	0.39
38	600741	华域汽车	2,408,511	50,072,943.69	0.39
39	300750	宁德时代	283,099	49,361,141.64	0.38
40	000002	万科A	1,881,500	49,182,410.00	0.38
41	601888	中国中免	316,699	48,781,146.97	0.38
42	603369	今世缘	1,248,700	48,661,773.00	0.38
43	002714	牧原股份	581,053	47,646,346.00	0.37
44	000625	长安汽车	4,287,749	47,165,239.00	0.37
45	601012	隆基股份	1,143,000	46,554,390.00	0.36
46	601899	紫金矿业	10,449,600	45,978,240.00	0.36
47	300433	蓝思科技	1,618,800	45,391,152.00	0.35
48	002242	九阳股份	1,174,620	43,778,087.40	0.34
49	600521	华海药业	1,287,930	43,699,464.90	0.34
50	000961	中南建设	4,901,529	43,623,608.10	0.34
51	600900	长江电力	2,299,992	43,561,848.48	0.34
52	600486	扬农化工	509,429	42,027,892.50	0.33
53	000975	银泰黄金	2,679,160	42,009,228.80	0.33
54	601933	永辉超市	4,462,200	41,855,436.00	0.32
55	603986	兆易创新	174,600	41,189,886.00	0.32
56	002557	洽洽食品	749,063	40,591,723.97	0.32
57	002938	鹏鼎控股	850,300	40,551,018.00	0.31
58	002410	广联达	561,871	39,162,408.70	0.30
59	600406	国电南瑞	1,932,340	39,129,885.00	0.30
60	000895	双汇发展	814,700	37,549,523.00	0.29
61	600926	杭州银行	4,187,492	37,352,428.64	0.29
62	300347	泰格医药	355,500	36,218,340.00	0.28
63	600547	山东黄金	985,297	36,081,576.14	0.28
64	300316	晶盛机电	1,433,400	35,462,316.00	0.28
65	601601	中国太保	1,277,435	34,810,103.75	0.27
66	603501	韦尔股份	168,300	33,988,185.00	0.26
67	002179	中航光电	811,138	33,264,769.38	0.26
68	603538	美诺华	613,300	31,266,034.00	0.24
69	600309	万华化学	606,379	30,312,886.21	0.24
70	601939	建设银行	4,796,887	30,268,356.97	0.23
71	300136	信维通信	559,700	29,675,294.00	0.23
72	300253	卫宁健康	1,292,204	29,643,159.76	0.23
73	300003	乐普医疗	789,500	28,832,540.00	0.22
74	002271	东方雨虹	703,572	28,586,130.36	0.22
75	600745	闻泰科技	222,500	28,023,875.00	0.22
76	300628	亿联网络	396,578	27,070,414.28	0.21
77	002050	三花智控	1,232,759	26,997,422.10	0.21
78	002508	老板电器	864,431	26,892,448.41	0.21

79	002439	启明星辰	634,321	26,685,884.47	0.21
80	300122	智飞生物	255,200	25,558,280.00	0.20
81	601799	星宇股份	199,797	25,374,219.00	0.20
82	688111	金山办公	73,924	25,250,959.92	0.20
83	600588	用友网络	550,690	24,285,429.00	0.19
84	300124	汇川技术	636,400	24,176,836.00	0.19
85	600009	上海机场	329,629	23,756,362.03	0.18
86	002456	欧菲光	1,430,000	23,752,300.00	0.18
87	601668	中国建筑	4,872,213	23,240,456.01	0.18
88	002727	一心堂	625,800	23,223,438.00	0.18
89	002080	中材科技	1,431,450	22,187,475.00	0.17
90	002299	圣农发展	758,200	21,987,800.00	0.17
91	300308	中际旭创	343,400	21,634,200.00	0.17
92	300607	拓斯达	539,437	21,350,939.53	0.17
93	000938	紫光股份	492,400	21,163,352.00	0.16
94	300498	温氏股份	969,620	21,137,716.00	0.16
95	600998	九州通	1,124,800	20,943,776.00	0.16
96	300601	康泰生物	128,300	20,805,128.00	0.16
97	603833	欧派家居	178,400	20,676,560.00	0.16
98	601128	常熟银行	2,746,196	20,623,931.96	0.16
99	300408	三环集团	729,400	20,204,380.00	0.16
100	600845	宝信软件	341,712	20,188,344.96	0.16
101	300015	爱尔眼科	461,420	20,048,699.00	0.16
102	603583	捷昌驱动	291,700	19,946,446.00	0.15
103	300144	宋城演艺	1,133,877	19,616,072.10	0.15
104	300529	健帆生物	277,521	19,287,709.50	0.15
105	600893	航发动力	820,000	19,253,600.00	0.15
106	002697	红旗连锁	1,740,913	19,010,769.96	0.15
107	300036	超图软件	753,915	18,983,579.70	0.15
108	601088	中国神华	1,300,000	18,668,000.00	0.14
109	002008	大族激光	509,600	18,320,120.00	0.14
110	002602	世纪华通	1,274,300	18,299,533.00	0.14
111	601966	玲珑轮胎	892,200	18,022,440.00	0.14
112	300747	锐科激光	165,090	17,966,744.70	0.14
113	300418	昆仑万维	750,400	17,917,984.00	0.14
114	000951	中国重汽	572,800	17,905,728.00	0.14
115	300413	芒果超媒	273,600	17,838,720.00	0.14
116	002352	顺丰控股	324,900	17,772,030.00	0.14
117	600183	生益科技	595,900	17,441,993.00	0.14
118	601100	恒立液压	215,400	17,275,080.00	0.13
119	300482	万孚生物	160,991	16,743,064.00	0.13
120	300525	博思软件	440,684	16,203,950.68	0.13
121	300033	同花顺	119,800	15,942,984.00	0.12
122	002690	美亚光电	301,934	15,881,728.40	0.12

123	600201	生物股份	569,200	15,846,528.00	0.12
124	600029	南方航空	3,033,397	15,682,662.49	0.12
125	603236	移远通信	74,640	15,525,120.00	0.12
126	002223	鱼跃医疗	424,500	15,451,800.00	0.12
127	600779	水井坊	244,145	15,239,530.90	0.12
128	000725	京东方 A	3,252,300	15,188,241.00	0.12
129	002332	仙琚制药	899,825	15,153,053.00	0.12
130	603690	至纯科技	400,000	15,044,000.00	0.12
131	002632	道明光学	1,762,900	14,931,763.00	0.12
132	603195	公牛集团	92,500	14,860,125.00	0.12
133	600438	通威股份	854,900	14,858,162.00	0.12
134	600216	浙江医药	770,600	14,841,756.00	0.12
135	002396	星网锐捷	418,927	14,800,690.91	0.11
136	000513	丽珠集团	306,100	14,695,861.00	0.11
137	603288	海天味业	118,086	14,689,898.40	0.11
138	600176	中国巨石	1,600,400	14,643,660.00	0.11
139	002230	科大讯飞	389,300	14,571,499.00	0.11
140	000157	中联重科	2,265,900	14,569,737.00	0.11
141	601108	财通证券	1,418,600	14,540,650.00	0.11
142	002127	南极电商	730,000	14,322,600.00	0.11
143	000860	顺鑫农业	249,690	14,227,336.20	0.11
144	002032	苏泊尔	195,802	13,901,942.00	0.11
145	601009	南京银行	1,870,000	13,707,100.00	0.11
146	002572	索菲亚	562,162	13,587,455.54	0.11
147	600703	三安光电	538,800	13,470,000.00	0.10
148	600885	宏发股份	331,327	13,292,839.24	0.10
149	600383	金地集团	958,900	13,136,930.00	0.10
150	600019	宝钢股份	2,852,600	13,007,856.00	0.10
151	300659	中孚信息	224,900	13,005,298.00	0.10
152	600801	华新水泥	513,803	12,182,269.13	0.09
153	603589	口子窖	239,000	12,165,100.00	0.09
154	002444	巨星科技	1,003,600	11,922,768.00	0.09
155	002311	海大集团	242,240	11,528,201.60	0.09
156	002371	北方华创	63,900	10,921,149.00	0.08
157	300383	光环新网	408,900	10,660,023.00	0.08
158	300496	中科创达	136,600	10,613,820.00	0.08
159	000089	深圳机场	1,310,648	10,039,563.68	0.08
160	300702	天宇股份	92,700	9,855,864.00	0.08
161	300785	值得买	76,672	9,638,437.12	0.07
162	000708	中信特钢	544,660	9,308,239.40	0.07
163	600038	中直股份	225,000	9,240,750.00	0.07
164	002812	恩捷股份	139,800	9,198,840.00	0.07
165	603568	伟明环保	392,470	9,105,304.00	0.07
166	300119	瑞普生物	402,000	8,984,700.00	0.07

167	300559	佳发教育	422,468	8,964,770.96	0.07
168	002867	周大生	396,006	8,779,453.02	0.07
169	603737	三棵树	94,640	8,727,700.80	0.07
170	601117	中国化学	1,581,717	8,667,809.16	0.07
171	600332	白云山	280,000	8,635,200.00	0.07
172	000596	古井贡酒	57,284	8,606,348.16	0.07
173	600720	祁连山	524,600	8,524,750.00	0.07
174	000936	华西股份	680,800	8,510,000.00	0.07
175	002459	晶澳科技	446,900	8,392,782.00	0.07
176	300251	光线传媒	762,400	8,317,784.00	0.06
177	000768	中航飞机	457,900	8,123,146.00	0.06
178	300138	晨光生物	665,108	8,074,411.12	0.06
179	002643	万润股份	468,874	8,050,566.58	0.06
180	002236	大华股份	416,400	7,999,044.00	0.06
181	002373	千方科技	326,600	7,835,134.00	0.06
182	300474	景嘉微	116,000	7,806,800.00	0.06
183	002511	中顺洁柔	343,601	7,662,302.30	0.06
184	002605	姚记科技	195,000	7,410,000.00	0.06
185	300146	汤臣倍健	372,400	7,332,556.00	0.06
186	300271	华宇软件	257,200	7,255,612.00	0.06
187	002463	沪电股份	282,100	7,046,858.00	0.05
188	601225	陕西煤业	967,857	6,978,248.97	0.05
189	000100	TCL 科技	1,113,800	6,905,560.00	0.05
190	600104	上汽集团	405,519	6,889,767.81	0.05
191	600323	瀚蓝环境	305,802	6,690,947.76	0.05
192	300832	新产业	38,582	6,643,434.58	0.05
193	603228	景旺电子	188,280	6,625,573.20	0.05
194	000538	云南白药	68,223	6,399,999.63	0.05
195	600507	方大特钢	1,224,315	6,354,194.85	0.05
196	601186	中国铁建	737,500	6,180,250.00	0.05
197	300699	光威复材	98,400	6,172,632.00	0.05
198	300685	艾德生物	79,100	6,087,536.00	0.05
199	002028	思源电气	296,900	6,074,574.00	0.05
200	002233	塔牌集团	498,300	5,994,549.00	0.05
201	600872	中炬高新	100,000	5,853,000.00	0.05
202	601336	新华保险	130,300	5,769,684.00	0.04
203	300327	中颖电子	176,860	5,730,264.00	0.04
204	600522	中天科技	482,400	5,523,480.00	0.04
205	601872	招商轮船	939,000	5,474,370.00	0.04
206	603596	伯特利	139,500	4,910,400.00	0.04
207	600803	新奥股份	465,000	4,808,100.00	0.04
208	600346	恒力石化	343,300	4,806,200.00	0.04
209	000739	普洛药业	191,664	4,463,854.56	0.03
210	600372	中航电子	332,800	4,432,896.00	0.03

211	002841	视源股份	43,700	4,349,024.00	0.03
212	002601	龙蟠佰利	232,992	4,310,352.00	0.03
213	603658	安图生物	26,300	4,272,172.00	0.03
214	300451	创业慧康	223,900	4,139,911.00	0.03
215	603659	璞泰来	39,500	4,069,290.00	0.03
216	600109	国金证券	346,000	3,947,860.00	0.03
217	300602	飞荣达	120,228	3,945,882.96	0.03
218	002912	中新赛克	23,700	3,877,083.00	0.03
219	002916	深南电路	23,026	3,857,315.52	0.03
220	601877	正泰电器	145,000	3,820,750.00	0.03
221	002859	洁美科技	127,440	3,820,651.20	0.03
222	603899	晨光文具	69,900	3,816,540.00	0.03
223	600373	中文传媒	323,000	3,804,940.00	0.03
224	300751	迈为股份	12,700	3,771,392.00	0.03
225	000977	浪潮信息	96,000	3,761,280.00	0.03
226	002695	煌上煌	148,700	3,750,214.00	0.03
227	002821	凯莱英	15,400	3,742,200.00	0.03
228	300572	安车检测	57,500	3,654,125.00	0.03
229	601658	邮储银行	796,578	3,640,361.46	0.03
230	603368	柳药股份	157,609	3,617,126.55	0.03
231	300769	德方纳米	36,500	3,554,370.00	0.03
232	600027	华电国际	1,033,900	3,535,938.00	0.03
233	000425	徐工机械	562,500	3,324,375.00	0.03
234	002831	裕同科技	114,900	3,160,899.00	0.02
235	600299	安迪苏	247,910	3,029,460.20	0.02
236	600026	中远海能	451,900	2,919,274.00	0.02
237	600919	江苏银行	506,800	2,873,556.00	0.02
238	603218	日月股份	136,080	2,490,264.00	0.02
239	300782	卓胜微	6,120	2,483,312.40	0.02
240	002600	领益智造	208,900	2,220,607.00	0.02
241	002777	久远银海	72,900	2,216,889.00	0.02
242	600380	健康元	113,100	1,836,744.00	0.01
243	300133	华策影视	251,600	1,824,100.00	0.01
244	603160	汇顶科技	7,700	1,716,330.00	0.01
245	603985	恒润股份	100,240	1,644,938.40	0.01
246	603866	桃李面包	31,100	1,582,679.00	0.01
247	300661	圣邦股份	5,150	1,571,007.50	0.01
248	002212	南洋股份	49,500	1,315,710.00	0.01
249	600549	厦门钨业	111,100	1,315,424.00	0.01
250	600999	招商证券	54,200	1,189,690.00	0.01
251	002414	高德红外	37,900	1,109,712.00	0.01
252	600584	长电科技	35,400	1,106,958.00	0.01
253	002007	华兰生物	21,654	1,085,081.94	0.01
254	603806	福斯特	21,140	1,055,097.40	0.01

255	603707	健友股份	16,300	1,052,491.00	0.01
256	002465	海格通信	79,900	1,033,906.00	0.01
257	603520	司太立	12,100	1,017,126.00	0.01
258	603345	安井食品	8,400	991,200.00	0.01
259	000932	华菱钢铁	259,300	977,561.00	0.01
260	600612	老凤祥	19,900	958,981.00	0.01
261	601288	农业银行	280,000	946,400.00	0.01
262	002640	跨境通	144,800	939,752.00	0.01
263	002390	信邦制药	203,500	927,960.00	0.01
264	002594	比亚迪	12,100	868,780.00	0.01
265	600694	大商股份	36,100	866,039.00	0.01
266	300115	长盈精密	37,200	850,020.00	0.01
267	600298	安琪酵母	17,100	846,108.00	0.01
268	000933	神火股份	203,600	844,940.00	0.01
269	002421	达实智能	217,200	842,736.00	0.01
270	002756	永兴材料	44,100	841,869.00	0.01
271	002920	德赛西威	13,700	840,221.00	0.01
272	300558	贝达药业	6,000	839,880.00	0.01
273	601615	明阳智能	67,400	839,130.00	0.01
274	001914	招商积余	27,300	838,929.00	0.01
275	000887	中鼎股份	106,700	837,595.00	0.01
276	002126	银轮股份	68,400	837,216.00	0.01
277	002484	江海股份	90,300	837,081.00	0.01
278	000937	冀中能源	276,500	835,030.00	0.01
279	002500	山西证券	126,230	825,544.20	0.01
280	002251	步步高	58,700	820,626.00	0.01
281	600587	新华医疗	51,300	798,228.00	0.01
282	002583	海能达	104,700	794,673.00	0.01
283	600754	锦江酒店	28,600	793,650.00	0.01
284	000543	皖能电力	196,800	791,136.00	0.01
285	002568	百润股份	17,400	788,568.00	0.01
286	603606	东方电缆	53,600	779,344.00	0.01
287	600180	瑞茂通	121,312	773,970.56	0.01
288	000898	鞍钢股份	308,300	755,335.00	0.01
289	000902	新洋丰	85,300	754,052.00	0.01
290	000099	中信海直	108,000	746,280.00	0.01
291	300504	天邑股份	27,100	739,830.00	0.01
292	300257	开山股份	54,000	705,780.00	0.01
293	600459	贵研铂业	23,100	688,611.00	0.01
294	600566	济川药业	25,500	649,230.00	0.01
295	002174	游族网络	24,400	636,352.00	0.00
296	000876	新希望	21,000	625,800.00	0.00
297	002851	麦格米特	23,700	614,304.00	0.00
298	603626	科森科技	48,400	588,060.00	0.00

299	002216	三全食品	22,600	540,140.00	0.00
300	300197	铁汉生态	211,600	537,464.00	0.00
301	600761	安徽合力	55,400	534,056.00	0.00
302	002538	司尔特	107,600	517,556.00	0.00
303	688123	聚辰股份	6,660	512,820.00	0.00
304	600622	光大嘉宝	126,600	497,538.00	0.00
305	000738	航发控制	35,300	481,845.00	0.00
306	002597	金禾实业	20,900	480,073.00	0.00
307	603517	绝味食品	6,700	473,958.00	0.00
308	603018	中设集团	47,300	460,229.00	0.00
309	603233	大参林	5,482	445,248.04	0.00
310	600125	铁龙物流	78,300	436,914.00	0.00
311	600597	光明乳业	28,000	416,080.00	0.00
312	603605	珀莱雅	2,300	414,046.00	0.00
313	300759	康龙化成	4,200	413,280.00	0.00
314	688222	成都先导	9,201	402,083.70	0.00
315	300188	美亚柏科	20,200	400,566.00	0.00
316	002267	陕天然气	64,200	392,262.00	0.00
317	002434	万里扬	44,600	387,128.00	0.00
318	002595	豪迈科技	19,700	383,362.00	0.00
319	603801	志邦家居	14,300	381,667.00	0.00
320	600060	海信视像	31,100	377,865.00	0.00
321	603338	浙江鼎力	4,860	368,242.20	0.00
322	002013	中航机电	44,400	350,760.00	0.00
323	603881	数据港	3,100	335,017.00	0.00
324	688298	东方生物	2,000	306,600.00	0.00
325	600862	中航高科	17,000	287,640.00	0.00
326	300497	富祥药业	13,000	254,410.00	0.00
327	601066	中信建投	6,100	240,218.00	0.00
328	603556	海兴电力	16,200	233,928.00	0.00
329	600377	宁沪高速	23,192	227,513.52	0.00
330	600639	浦东金桥	12,000	191,760.00	0.00
331	002968	新大正	3,000	190,500.00	0.00
332	600143	金发科技	14,000	184,380.00	0.00
333	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.00
334	688555	泽达易盛	3,004	170,627.20	0.00
335	002273	水晶光电	9,500	162,830.00	0.00
336	688516	奥特维	3,440	148,264.00	0.00
337	300012	华测检测	7,400	146,224.00	0.00
338	601390	中国中铁	29,100	146,082.00	0.00
339	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
340	600990	四创电子	3,200	127,040.00	0.00
341	300294	博雅生物	3,000	112,470.00	0.00
342	603686	龙马环卫	4,600	112,102.00	0.00

343	688268	华特气体	1,200	111,060.00	0.00
344	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00
345	002736	国信证券	9,500	107,350.00	0.00
346	002677	浙江美大	9,100	102,648.00	0.00
347	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
348	688088	虹软科技	1,100	98,098.00	0.00
349	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.00
350	688023	安恒信息	300	92,370.00	0.00
351	688008	澜起科技	865	87,953.20	0.00
352	688012	中微公司	400	87,724.00	0.00
353	603019	中科曙光	2,240	86,016.00	0.00
354	601997	贵阳银行	11,400	81,624.00	0.00
355	600536	中国软件	1,000	79,200.00	0.00
356	002185	华天科技	5,700	77,121.00	0.00
357	000930	中粮科技	10,900	74,447.00	0.00
358	000722	湖南发展	10,900	64,201.00	0.00
359	688166	博瑞医药	850	52,606.50	0.00
360	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
361	600760	中航沈飞	800	26,256.00	0.00
362	300394	天孚通信	400	23,820.00	0.00
363	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
364	600529	山东药玻	300	17,400.00	0.00
365	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
366	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
367	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
368	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
369	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
370	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
371	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
372	002798	帝欧家居	100	3,247.00	0.00
373	000786	北新建材	143	3,050.19	0.00
374	000402	金融街	400	2,656.00	0.00
375	002048	宁波华翔	15	231.60	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	148,023,255.15	4.49
2	600030	中信证券	146,206,905.50	4.43

3	601688	华泰证券	120,155,804.00	3.64
4	600036	招商银行	119,338,759.54	3.62
5	000002	万 科 A	115,170,639.87	3.49
6	600519	贵州茅台	111,410,471.55	3.38
7	000063	中兴通讯	108,936,858.12	3.30
8	002142	宁波银行	100,207,690.60	3.04
9	000333	美的集团	98,151,400.87	2.97
10	600547	山东黄金	97,640,448.63	2.96
11	600887	伊利股份	90,961,755.16	2.76
12	601899	紫金矿业	88,585,295.70	2.68
13	600570	恒生电子	88,184,324.09	2.67
14	600276	恒瑞医药	81,718,509.47	2.48
15	002241	歌尔股份	80,921,007.73	2.45
16	000975	银泰黄金	77,415,581.32	2.35
17	002415	海康威视	73,414,872.62	2.22
18	600031	三一重工	73,175,706.87	2.22
19	000656	金科股份	72,032,932.88	2.18
20	000858	五 粮 液	69,905,596.53	2.12
21	002624	完美世界	66,670,572.56	2.02

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000002	万 科 A	123,782,282.52	3.75
2	000063	中兴通讯	80,572,435.30	2.44
3	600547	山东黄金	73,121,281.91	2.22
4	002007	华兰生物	70,572,366.95	2.14
5	601899	紫金矿业	66,566,638.00	2.02
6	000661	长春高新	55,911,656.02	1.69
7	600887	伊利股份	55,875,034.52	1.69
8	600016	民生银行	53,347,606.42	1.62
9	601318	中国平安	49,675,841.12	1.51
10	002594	比亚迪	48,966,976.61	1.48
11	002415	海康威视	47,039,910.27	1.43
12	600030	中信证券	45,469,487.41	1.38
13	000975	银泰黄金	43,045,111.58	1.30
14	600183	生益科技	42,888,859.86	1.30
15	300059	东方财富	38,611,882.88	1.17
16	600028	中国石化	37,401,194.14	1.13

17	300639	凯普生物	34,663,490.80	1.05
18	002463	沪电股份	34,010,454.01	1.03
19	002127	南极电商	33,847,721.26	1.03
20	600196	复星医药	33,363,922.55	1.01

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	8,263,055,000.57
卖出股票的收入（成交）总额	4,160,665,662.74

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	161,033,087.00	1.25
2	央行票据	-	-
3	金融债券	485,248,860.70	3.77
	其中：政策性金融债	464,938,860.70	3.61
4	企业债券	716,048,000.00	5.56
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,164,366,414.74	9.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,526,696,362.44	19.62

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	132013	17 宝武 EB	1,845,550	188,670,576.50	1.46
2	132009	17 中油 EB	1,509,660	151,433,994.60	1.18
3	160206	16 国开 06	1,500,000	150,735,000.00	1.17
4	200001	20 付息国 债 01	1,500,000	150,105,000.00	1.17
5	132015	18 中油 EB	1,461,530	146,153,000.00	1.13

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	-306.00	-354,923,280.00	-13,854,640.00	-
IC2009	IC2009	-242.00	-274,156,960.00	-24,029,634.53	-
IC2012	IC2012	-40.00	-43,972,800.00	-16,080.00	-
IF2007	IF2007	-1,011.00	-1,248,989,400.00	-78,976,530.77	-
IF2009	IF2009	-3,049.00	-3,720,633,720.00	-181,190,580.00	-
IF2012	IF2012	-306.00	-369,862,200.00	-2,426,760.00	-
公允价值变动总额合计					-300,494,225.30
股指期货投资本期收益					-168,365,766.83
股指期货投资本期公允价值变动					-212,050,376.21

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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金利用股指期货与股票现货组合之间进行对冲，并通过量化模型，构建市场中性阿尔法股票组合，同时采用安全有效的风险监控，在降低套利风险的同时，力争为投资者获取超额稳定的收益。

本基金投资于股指期货，通过对冲功能剥离股票现货部分的系统性风险，符合既定投资政策及投资目标。

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，本基金暂不投资国债期货。

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合约。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

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 7,107,130,138.45 元，占基金资产净值的比例为 55.17%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-6,012,538,360.00 元，占基金资产净值的比例为-46.68%，空头合约市值占股票资产的比例为-84.60%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 45,461,202.09 元，公允价值变动损益为 354,767,066.04 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

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	626,399,999.95
2	应收证券清算款	124,549,620.63
3	应收股利	-

4	应收利息	30,124,298.40
5	应收申购款	134,749,892.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	915,823,811.28

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	132013	17 宝武 EB	188,670,576.50	1.46
2	132009	17 中油 EB	151,433,994.60	1.18
3	132015	18 中油 EB	146,153,000.00	1.13
4	110059	浦发转债	105,950,481.00	0.82
5	132008	17 山高 EB	98,269,790.40	0.76
6	132007	16 凤凰 EB	64,343,640.00	0.50
7	132004	15 国盛 EB	62,818,214.40	0.49
8	132012	17 巨化 EB	60,718,315.00	0.47
9	132006	16 皖新 EB	24,307,366.00	0.19
10	113014	林洋转债	15,792,093.90	0.12
11	110045	海澜转债	12,841,019.60	0.10
12	127012	招路转债	10,019,210.18	0.08
13	132011	17 浙报 EB	7,658,700.00	0.06
14	128085	鸿达转债	7,643,215.80	0.06
15	110034	九州转债	7,282,262.40	0.06
16	110033	国贸转债	7,064,988.50	0.05
17	127011	中鼎转 2	7,011,445.32	0.05
18	128088	深南转债	6,854,105.12	0.05
19	113012	骆驼转债	6,788,972.70	0.05
20	113519	长久转债	6,516,614.40	0.05
21	110048	福能转债	6,454,075.50	0.05
22	113525	台华转债	5,911,440.60	0.05
23	128064	司尔转债	5,603,931.95	0.04
24	128044	岭南转债	5,601,250.72	0.04
25	113545	金能转债	5,600,675.80	0.04
26	113021	中信转债	5,159,123.20	0.04
27	113009	广汽转债	5,116,310.10	0.04

28	113017	吉视转债	5,074,464.70	0.04
29	128046	利尔转债	3,995,333.43	0.03
30	128037	岩土转债	3,626,497.00	0.03
31	128087	孚日转债	3,623,374.90	0.03
32	113505	杭电转债	3,603,502.00	0.03
33	128071	合兴转债	3,589,695.59	0.03
34	110041	蒙电转债	3,586,417.00	0.03
35	128058	拓邦转债	3,526,240.08	0.03
36	127005	长证转债	3,499,200.00	0.03
37	113534	鼎胜转债	3,381,790.00	0.03
38	113530	大丰转债	3,349,902.60	0.03
39	113026	核能转债	3,098,140.00	0.02
40	128010	顺昌转债	3,013,680.00	0.02
41	110053	苏银转债	2,753,920.00	0.02
42	113030	东风转债	2,635,136.40	0.02
43	113508	新风转债	2,428,917.90	0.02
44	110064	建工转债	2,237,840.00	0.02
45	113025	明泰转债	2,152,944.30	0.02
46	113558	日月转债	2,102,344.00	0.02
47	113532	海环转债	1,969,920.90	0.02
48	123004	铁汉转债	1,912,407.54	0.01
49	128018	时达转债	1,522,500.80	0.01
50	113537	文灿转债	1,418,149.60	0.01
51	128022	众信转债	1,397,194.64	0.01
52	110038	济川转债	1,384,773.30	0.01
53	128021	兄弟转债	1,087,560.00	0.01
54	110047	山鹰转债	1,029,585.50	0.01
55	110042	航电转债	904,800.00	0.01
56	113547	索发转债	903,025.80	0.01
57	128075	远东转债	835,510.80	0.01
58	128032	双环转债	771,920.00	0.01
59	110051	中天转债	743,220.00	0.01
60	123023	迪森转债	681,940.00	0.01
61	128081	海亮转债	623,220.00	0.00
62	128084	木森转债	602,233.17	0.00
63	113008	电气转债	544,400.00	0.00
64	110065	淮矿转债	527,350.00	0.00
65	110043	无锡转债	513,650.00	0.00
66	113024	核建转债	500,250.00	0.00
67	113019	玲珑转债	494,880.00	0.00
68	128033	迪龙转债	485,446.50	0.00
69	113029	明阳转债	457,880.00	0.00
70	128017	金禾转债	324,441.60	0.00
71	128045	机电转债	286,336.72	0.00

72	128083	新北转债	215,520.00	0.00
73	110061	川投转债	128,136.00	0.00
74	128067	一心转债	1,965.74	0.00
75	123036	先导转债	534.28	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未存在流通受限情况。

§ 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
海富通阿尔法对冲混合 A	218,061	48,359.33	8,740,136,242.49	82.88%	1,805,146,738.81	17.12%
海富通阿尔法对冲混合 C	2,295	241,572.54	303,838,839.73	54.80%	250,570,131.60	45.20%
合计	220,356	50,371.63	9,043,975,082.22	81.48%	2,055,716,870.41	18.52%

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	海富通阿尔法对冲混合 A	2,885,426.03	0.0274%
	海富通阿尔法对冲混合 C	31,068.42	0.0056%
	合计	2,916,494.45	0.0263%

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	海富通阿尔法对冲混合 A	>100

持有本开放式基金	海富通阿尔法对冲混合 C	-
	合计	>100
本基金基金经理持有本开 放式基金	海富通阿尔法对冲混合 A	10~50
	海富通阿尔法对冲混合 C	-
	合计	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金募集期间，本基金管理人运用自有资金总计 1000.10 万元认购了本基金，其中，发起资金总计人民币 1000 万元，认购费用为人民币 1000 元，符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有不少于 3 年。截至 2017 年 11 月 20 日，发起份额承诺持有期限已经届满。2017 年 12 月公司赎回所有份额。截止报告期末，公司未持有本基金份额。

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C
基金合同生效日（2014 年 11 月 20 日）基金份额总额	719,877,758.17	-
本报告期期初基金份额总额	2,968,495,020.59	-
本报告期基金总申购份额	9,580,896,094.89	642,134,872.15
减：本报告期基金总赎回份额	2,004,108,134.18	87,725,900.82
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,545,282,981.30	554,408,971.33

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

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	3,658,083,038.89	29.48%	2,641,270.02	35.49%	-
申万宏源	2	2,261,064,797.11	18.22%	955,172.38	12.84%	-
国盛证券	2	1,836,946,887.92	14.80%	1,331,254.37	17.89%	-
华创证券	1	1,772,236,044.58	14.28%	730,319.29	9.81%	-
国金证券	1	822,762,890.79	6.63%	437,254.54	5.88%	-
天风证券	2	591,618,444.02	4.77%	422,383.98	5.68%	-
银河证券	1	471,344,634.04	3.80%	241,374.96	3.24%	-
长江证券	1	357,994,943.59	2.88%	219,139.35	2.94%	-
华西证券	1	325,544,839.08	2.62%	238,068.60	3.20%	-
招商证券	2	202,127,255.91	1.63%	144,136.50	1.94%	-
太平洋证券	2	110,913,082.11	0.89%	81,106.46	1.09%	-
中信证券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期新增海通证券 2 个交易单元、国泰君安证券 2 个交易单元、招商证券 2 个交易单元、太平洋证券 2 个交易单元、开源证券 2 个交易单元。

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议核准。

<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	532,312,039.64	26.28%	3,976,600,000.00	23.38%	-	-
申万宏源	752,336,702.03	37.14%	2,179,100,000.00	12.81%	-	-
国盛证券	213,074,059.42	10.52%	3,962,200,000.00	23.30%	-	-
华创证券	120,767,095.80	5.96%	-	-	-	-
国金证券	309,950,646.33	15.30%	4,936,800,000.00	29.03%	-	-
天风证券	14,289,022.95	0.71%	-	-	-	-
银河证券	5,701,187.44	0.28%	-	-	-	-
长江证券	2,858,181.78	0.14%	-	-	-	-
华西证券	32,191,436.99	1.59%	1,690,400,000.00	9.94%	-	-
招商证券	3,658,661.94	0.18%	-	-	-	-

太平洋证券	28,592,519.43	1.41%	260,000,000.00	1.53%	-	-
中信证券	10,000,000.00	0.49%	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-02
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同、托管协议的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-07
3	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金参加中国民生银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-09
4	海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金暂停大额申购和转换转入业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-10
5	海富通基金管理有限公司关于开展海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金直销中心赎回费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-10
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加西藏东方财富证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-14
7	海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金恢复大额申购和转换转入业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-18
8	关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-01-21
9	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金 A 类份额参	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2020-01-23

	加信达证券股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	电子披露网站	
10	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金 C 类份额新增海通证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-02-12
11	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金 C 类份额新增销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-02-13
12	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金 C 类份额新增珠海盈米基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-02-18
13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增泛华普益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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-02-25
14	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金 C 类份额新增中国民生银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-02-27
15	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金 C 类份额新增上海浦东发展银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-02-27
16	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金 C 类份额新增中国银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-02-27
17	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金 C 类份额新增招商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-02-27
18	海富通基金管理有限公司关于开通海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金 C 类基金份额与旗下部分基金之间转换业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-02-27
19	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金 C 类份额新增交通银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-02-28
20	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-02
21	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金 C 类份额新增部分销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-04
22	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金 A 类份额参加山西证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-04

23	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-04
24	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金 C 类份额新增部分销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-07
25	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金新增中信证券华南股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-09
26	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金新增广发证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-13
27	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金新增宁波银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-16
28	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金新增江海证券有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-16
29	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金新增东兴证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-18
30	海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金暂停大额申购和转换转入业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-21
31	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金新增中银国际证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-24
32	海富通基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-03-27
33	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金新增方正证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-02
34	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金 C 类份额新增平安银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-03
35	海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金恢复大额申购和转换转入业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-07
36	海富通基金管理有限公司关于开展海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金 A 类份	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2020-04-21

	额直销柜台申购费率优惠活动的公告	电子披露网站	
37	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金 C 类份额新增兴业银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-23
38	海富通基金管理有限公司关于暂停泰诚财富基金销售(大连)有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-24
39	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金 C 类份额新增天风证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-04-29
40	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金新增中国中金财富证券有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-07
41	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增蚂蚁(杭州)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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-08
42	海富通基金管理有限公司关于增聘基金经理助理的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-11
43	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-20
44	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-22
45	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
46	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-05-26
47	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华安证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-02
48	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-06
49	海富通基金管理有限公司关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金新增国元证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-12
50	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-17

51	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-24
52	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020-06-29
53	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	中国证券报、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阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金的文件
- (二) 海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金基金合同
- (三) 海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通阿尔法对冲混合型发起式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) 报告期内海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

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