

海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金
2020 年第 3 季度报告
2020 年 9 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：二〇二〇年十月二十八日

§1 重要提示

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

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 10 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	12,900,115,903.59 份
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。

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	
下属两级基金的基金简称	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C
下属两级基金的交易代码	519062	008795
报告期末下属两级基金的份额总额	12,488,019,875.00 份	412,096,028.59 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 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
1.本期已实现收益	-320,717,756.48	-9,775,676.97
2.本期利润	8,672,145.29	423,007.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.0008	0.0009
4.期末基金资产净值	14,513,586,327.81	477,701,151.88
5.期末基金份额净值	1.162	1.159

注：（1）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。

（2）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。

（3）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 本报告期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

1、海富通阿尔法对冲混合 A：

阶段	净值增长率①	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	①—③	②—④
----	--------	-----------	------------	--------------	-----	-----

				④		
过去三个月	0.09%	0.39%	0.69%	0.01%	-0.60%	0.38%
过去六个月	2.65%	0.32%	1.37%	0.01%	1.28%	0.31%
过去一年	6.85%	0.29%	2.76%	0.01%	4.09%	0.28%
过去三年	27.16%	0.32%	8.49%	0.01%	18.67%	0.31%
过去五年	34.72%	0.26%	14.56%	0.01%	20.16%	0.25%
自基金合同生效起至今	60.85%	0.33%	18.13%	0.01%	42.72%	0.32%

2、海富通阿尔法对冲混合 C:

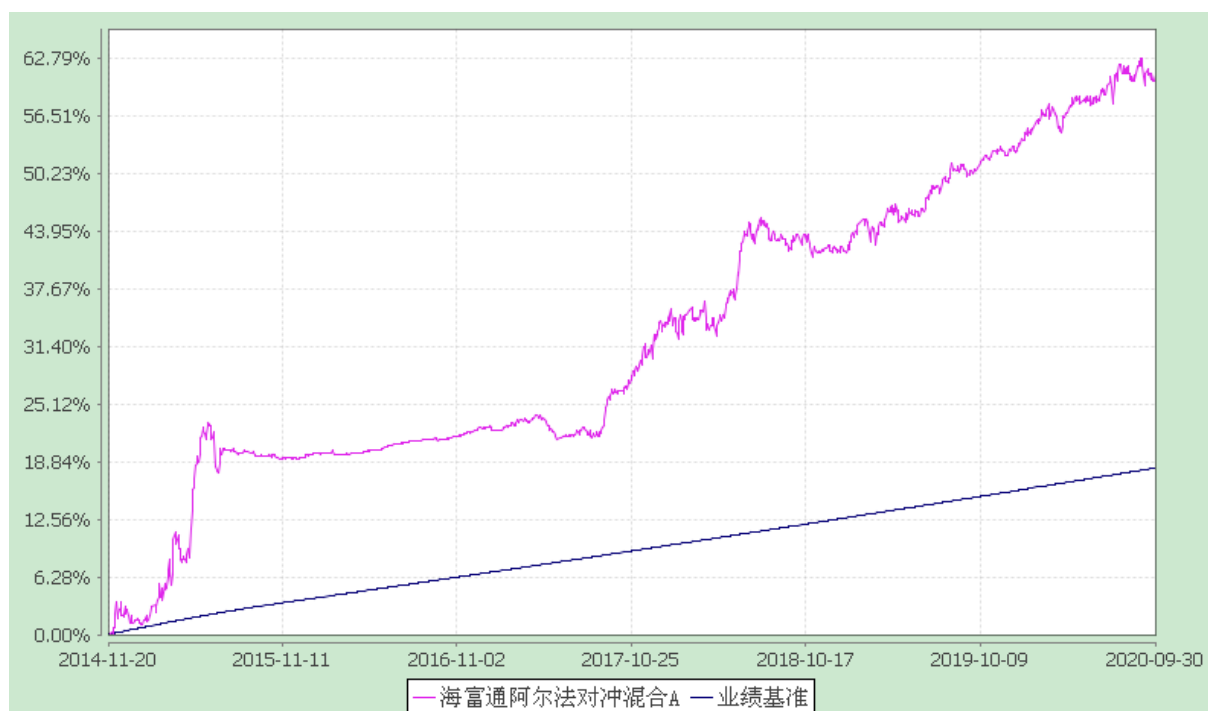
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.00%	0.39%	0.69%	0.01%	-0.69%	0.38%
过去六个月	2.48%	0.32%	1.37%	0.01%	1.11%	0.31%
自基金合同生效起至今	3.48%	0.32%	1.89%	0.01%	1.59%	0.31%

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的历史走势对比图

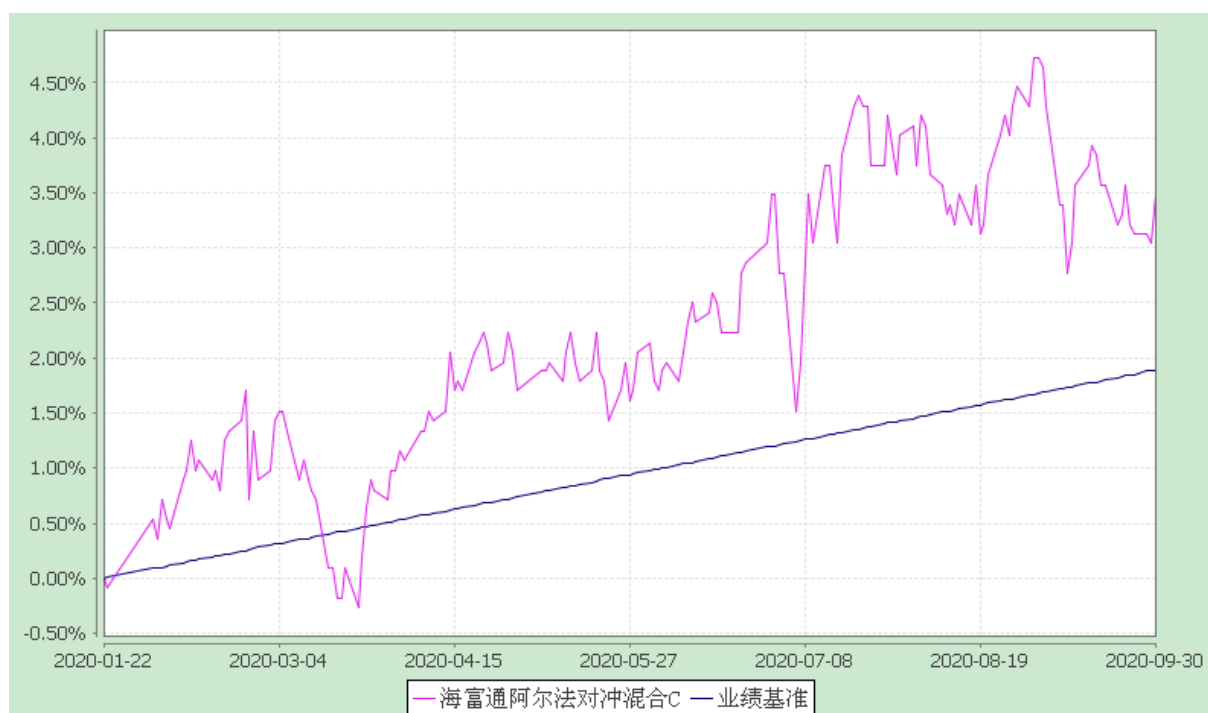
1. 海富通阿尔法对冲混合 A

(2014 年 11 月 20 日至 2020 年 9 月 30 日)



2. 海富通阿尔法对冲混合 C

(2020 年 1 月 22 日至 2020 年 9 月 30 日)



注：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，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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 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	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、海富通量化先锋股票、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

	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				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。
--	---	--	--	--	---

	富通富泽混合基金经理；量化投资部总监。				
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。

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年三季度，全球开始逐步从疫情影响中恢复过来。分主要区域看，中国的恢复情况较好，基本只有外部零星的输入病例；欧洲、美国也基本控制住了疫情快速蔓延的趋势，虽然还有一定反复；一些发展中国家的防疫形势仍较为严峻，但对全球经济的整体影响相对较小。全球均开始推动生活、消费、生产的正常化运行，中国由于疫情控制得力而经济修复显著，除了需要人员聚集的一些社交性消费仍有制约外，国内其它日常生活、商品交易、工业生产、交通运输等均基本恢复。中国三季度各项经济数据也逐步接近正常水平，因此监管层也开始考虑和推动货币、财政等各项托底政策转向正常化。

在国内各项经济指标逐步接近正常水平的推动下，三季度国内权益市场的表现也较为优异。A 股主要指数方面，上证指数上涨 7.82%，沪深 300 上涨 10.17%，中证 800 上涨 9.03%，中小板指上涨 8.19%，创业板指上涨 5.60%。分行业看，中信一级行业中绝大部分上涨，其中国防军工、消费者服务、电力设备、汽车、食品饮料涨幅居前，涨幅分别达到 32.02%、26.56%、23.69%、20.42%和 19.38%，而通信、商贸零售、综合金融、计算机、传媒、农林牧渔是仅有的六个下跌行业，下跌幅度分别为-8.03%、-3.05%、-2.37%、-2.06%、-1.70%和-0.13%。从三季度 A 股内部的结构看，受益于经济逐步恢复的顺周期行业取得了不错的表现，包括餐饮旅游、汽车、食品饮料、建材、非银行金融、机械、基础化工、轻工制造等；以国防军工、电力设备为代表的部分高端装备制造行业

自身行业景气好、之前估值不贵，因此也有显著表现；上半年涨幅较大、估值也较高的通信、计算机、传媒、医药等高估值板块，在货币政策逐步转向正常化的背景下出现了阶段性的落后。

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。

展望下季度，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，基金依然会积极参与新股申购，努力增厚收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通阿尔法对冲混合 A 净值增长率为 0.09%，同期业绩比较基准收益率为 0.69%，基金净值跑输业绩比较基准 0.60 个百分点；海富通阿尔法对冲混合 C 净值增长率为 0.00%，同期业绩比较基准收益率为 0.69%，基金净值跑输业绩比较基准 0.69 个百分点。报告期内股票市场波动较大，导致基金跑输基准。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	7,804,626,911.93	51.88
	其中：股票	7,804,626,911.93	51.88
2	固定收益投资	2,136,750,932.48	14.20
	其中：债券	2,136,750,932.48	14.20
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	2,072,572,699.21	13.78
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	银行存款和结算备付金合计	1,967,196,451.27	13.08
7	其他资产	1,061,565,625.91	7.06
8	合计	15,042,712,620.80	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	29,700,209.00	0.20
B	采矿业	156,993,493.15	1.05
C	制造业	4,443,087,742.30	29.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	97,410,710.96	0.65
E	建筑业	60,016,052.62	0.40
F	批发和零售业	65,594,237.56	0.44
G	交通运输、仓储和邮政业	128,890,010.28	0.86
H	住宿和餐饮业	20,022,024.69	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	462,043,970.64	3.08
J	金融业	1,589,797,950.44	10.60
K	房地产业	360,417,336.32	2.40
L	租赁和商务服务业	164,946,794.62	1.10
M	科学研究和技术服务业	126,163,174.69	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	8,624,827.34	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	55,976,258.02	0.37
R	文化、体育和娱乐业	34,942,119.30	0.23
S	综合	-	-
	合计	7,804,626,911.93	52.06

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	4,980,567	379,818,039.42	2.53
2	600519	贵州茅台	207,791	346,699,283.50	2.31
3	600030	中信证券	8,875,100	266,519,253.00	1.78
4	600036	招商银行	6,508,210	234,295,560.00	1.56
5	600887	伊利股份	4,912,597	189,134,984.50	1.26
6	000333	美的集团	2,575,641	183,372,536.60	1.22
7	002475	立讯精密	3,153,393	180,153,342.09	1.20
8	600276	恒瑞医药	1,975,051	177,399,080.82	1.18
9	000858	五 粮 液	626,900	138,544,900.00	0.92
10	600031	三一重工	5,198,958	129,402,064.62	0.86

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	322,677,252.00	2.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	462,058,600.00	3.08
	其中：政策性金融债	392,215,600.00	2.62
4	企业债券	512,744,200.00	3.42
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	839,270,880.48	5.60
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,136,750,932.48	14.25

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比
----	------	------	-------	---------	----------

					例（%）
1	110059	浦发转债	2,773,630	283,770,085.30	1.89
2	160206	16 国开 06	1,500,000	150,105,000.00	1.00
3	200001	20 附息国债 01	1,500,000	149,865,000.00	1.00
4	132009	17 中油 EB	1,151,740	115,680,765.60	0.77
5	200201	20 国开 01	1,100,000	109,934,000.00	0.73

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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 (元)	公允价值变 动(元)	风险说明
IC2010	IC2010	-205.00	-252,338,600.00	6,578,840.00	-
IC2012	IC2012	-59.00	-70,804,720.00	-352,401.78	-
IF2010	IF2010	-432.00	-591,131,520.00	4,230,924.47	-
IF2012	IF2012	-4,405.00	-5,953,093,200.00	106,225,604.22	-
IH2012	IH2012	-30.00	-28,661,400.00	163,620.00	-
公允价值变动总额合计(元)					116,846,586.91
股指期货投资本期收益(元)					-1,134,940,032.21

股指期货投资本期公允价值变动(元)	417,340,812 .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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 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 7,804,626,911.93 元，占基金资产净值的比例为 52.06%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-6,896,029,440.00 元，占基金资产净值的比例为-46.00%，空头合约市值占股票资产的比例为-88.36%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为-290,219,630.54 元，公允价值变动损益为 341,113,050.44 元。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 报告期内本基金投资的中信证券（600030）作为债务融资工具主承销商，在部分债务融资工具选聘主承销商的投标过程中，中标承销费率远低于市场正常水平，预估承销费收入远低于其业务开展平均成本。交易商协会依据相关自律规定，于2020年5月15日对中信证券予以警告，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。对该证券的投资决策程序的说明：公司是中国领先的综合性证券集团，凭借前瞻的发展战略和市场化机制，各项业务排名基本稳居行业第一梯队。在财富管理+机构业务双轮驱

动的战略布局下，有望持续保持行业优势地位，考虑到资本市场改革持续推进，公司作为行业龙头将充分受益。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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	905,811,066.33
2	应收证券清算款	125,076,872.44
3	应收股利	-
4	应收利息	23,468,435.57
5	应收申购款	7,209,251.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,061,565,625.91

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	283,770,085.30	1.89
2	132009	17 中油 EB	115,680,765.60	0.77
3	132015	18 中油 EB	91,833,447.30	0.61
4	132007	16 凤凰 EB	64,532,886.00	0.43
5	128102	海大转债	29,043,655.74	0.19
6	132006	16 皖新 EB	20,496,617.00	0.14
7	113014	林洋转债	17,466,454.20	0.12
8	110045	海澜转债	13,393,674.60	0.09

9	127015	希望转债	11,209,365.60	0.07
10	127012	招路转债	10,944,902.82	0.07
11	132011	17 浙报 EB	7,682,145.00	0.05
12	113017	吉视转债	7,076,997.90	0.05
13	128085	鸿达转债	6,838,491.60	0.05
14	113519	长久转债	6,699,273.00	0.04
15	128044	岭南转债	6,371,298.00	0.04
16	110068	龙净转债	5,552,250.40	0.04
17	128010	顺昌转债	5,464,861.64	0.04
18	113012	骆驼转债	5,456,848.20	0.04
19	110064	建工转债	5,229,000.00	0.03
20	113505	杭电转债	5,158,021.20	0.03
21	128037	岩土转债	5,105,350.25	0.03
22	132004	15 国盛 EB	5,018,500.00	0.03
23	110048	福能转债	4,761,671.10	0.03
24	113026	核能转债	4,678,200.00	0.03
25	128064	司尔转债	4,360,678.56	0.03
26	128087	孚日转债	4,354,087.50	0.03
27	113530	大丰转债	4,131,864.00	0.03
28	113508	新风转债	3,920,893.00	0.03
29	110041	蒙电转债	3,777,885.50	0.03
30	113532	海环转债	3,653,286.40	0.02
31	113525	台华转债	3,552,416.70	0.02
32	127011	中鼎转 2	3,527,787.28	0.02
33	113025	明泰转债	3,447,637.50	0.02
34	110034	九州转债	3,446,265.60	0.02
35	128081	海亮转债	3,433,980.00	0.02
36	113534	鼎胜转债	3,383,030.00	0.02
37	110033	国贸转债	3,307,543.00	0.02
38	113024	核建转债	3,094,800.00	0.02
39	113021	中信转债	3,045,759.90	0.02

40	110053	苏银转债	2,882,360.00	0.02
41	113030	东风转债	2,729,922.00	0.02
42	128058	拓邦转债	2,547,218.48	0.02
43	132008	17 山高 EB	2,060,000.00	0.01
44	128071	合兴转债	1,971,660.45	0.01
45	123004	铁汉转债	1,676,050.74	0.01
46	110047	山鹰转债	1,621,452.00	0.01
47	128018	时达转债	1,579,084.40	0.01
48	128075	远东转债	1,376,478.70	0.01
49	128096	奥瑞转债	1,283,276.64	0.01
50	113545	金能转债	1,261,638.00	0.01
51	113537	文灿转债	758,805.20	0.01
52	110051	中天转债	705,758.00	0.00
53	127005	长证转债	646,800.00	0.00
54	128046	利尔转债	613,290.42	0.00
55	128033	迪龙转债	500,445.00	0.00
56	128032	双环转债	419,560.00	0.00
57	128083	新北转债	221,020.00	0.00
58	128101	联创转债	218,740.00	0.00
59	110061	川投转债	137,814.60	0.00
60	132014	18 中化 EB	1,030.00	0.00

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000333	美的集团	76,241,000.00	0.51	大宗交易

§6 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
----	-------------	-------------

本报告期期初基金份额总额	10,545,282,981.30	554,408,971.33
本报告期基金总申购份额	3,983,630,878.72	199,511,864.65
减：本报告期基金总赎回份额	2,040,893,985.02	341,824,807.39
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	12,488,019,875.00	412,096,028.59

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金募集期间，本基金管理人运用固有资金总计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 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 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 90 只公募基金。截至 2020 年 9 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1283 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再度被权威媒体《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。2020 年 7 月，由《上海证券报》主办的第十七届金基金奖名单揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金基金·股票投资回报基金管理公司奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。

§10 备查文件目录

10.1 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

10.2 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。

10.3 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
二〇二〇年十月二十八日