

海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金
2020 年年度报告
2020 年 12 月 31 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：二〇二一年三月三十一日

§ 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。本年度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 2021 年 3 月 29 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。

本报告期自 2020 年 1 月 22 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	19
§6 审计报告	19
6.1 审计意见	19
6.2 形成审计意见的基础	19
6.3 其他信息	19
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	20
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	20
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	68
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	69
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	69
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	69
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 市场中性策略执行情况	70
8.13 投资组合报告附注	70
§9 基金份额持有人信息	73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	74
§10 开放式基金份额变动	74
§11 重大事件揭示	75
11.1 基金份额持有人大会决议	75
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
11.4 基金投资策略的改变	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
11.8 其他重大事件	78
12 影响投资者决策的其他重要信息	83
§13 备查文件目录	85
13.1 备查文件目录	85
13.2 存放地点	85
13.3 查阅方式	85

§ 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	2,305,238,977.46 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	2,223,607,232.45 份	81,631,745.01 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 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	-29,292,960.50	-10,844,116.54
本期利润	89,145,668.82	2,835,729.47
加权平均基金份额本期利润	0.0365	0.0104
本期加权平均净值利润率	3.58%	1.03%
本期基金份额净值增长率	3.51%	3.10%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	
	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	-17,527,990.07	-971,085.11
期末可供分配基金份额利润	-0.0079	-0.0119
期末基金资产净值	2,301,734,408.86	84,166,019.34
期末基金份额净值	1.0351	1.0310
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	
	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	3.51%	3.10%

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

1. 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
过去三个月	-0.32%	0.24%	0.69%	0.01%	-1.01%	0.23%
过去六个月	1.21%	0.35%	1.38%	0.01%	-0.17%	0.34%
自基金合同生效起至今	3.51%	0.29%	2.60%	0.01%	0.91%	0.28%

2. 海富通安益对冲混合 C:

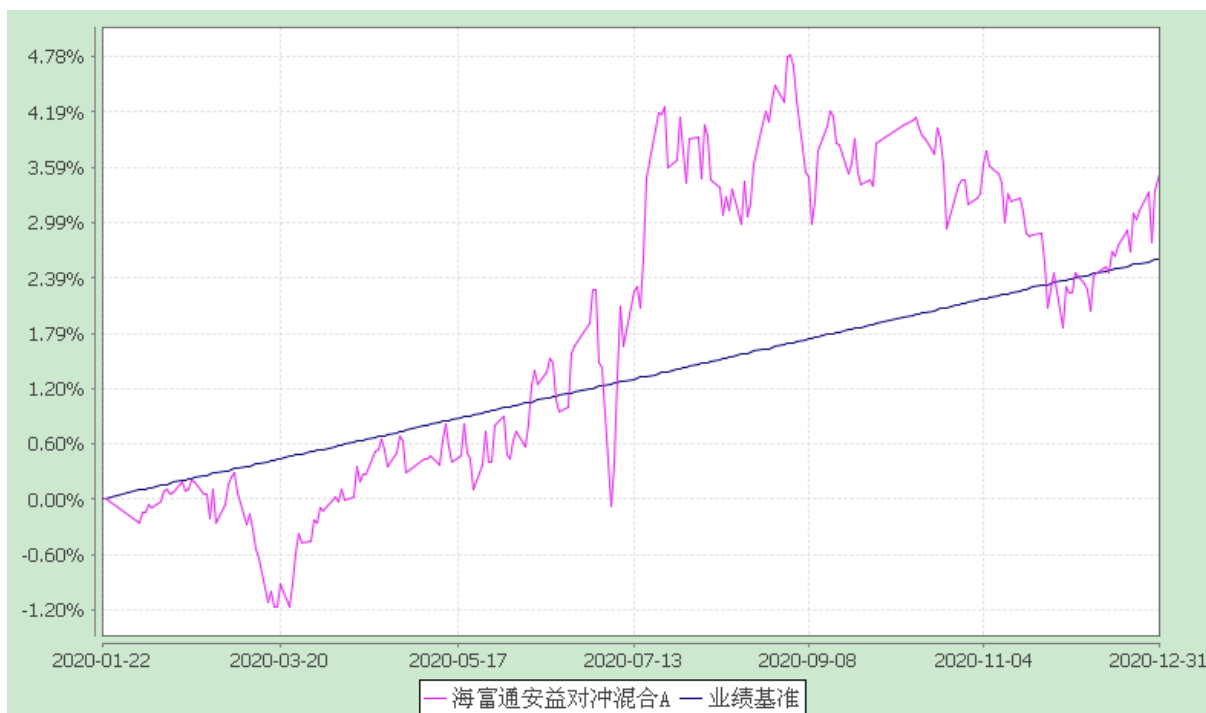
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.43%	0.25%	0.69%	0.01%	-1.12%	0.24%
过去六个月	1.00%	0.35%	1.38%	0.01%	-0.38%	0.34%
自基金合同生效起至今	3.10%	0.29%	2.60%	0.01%	0.50%	0.28%

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的历史走势对比图

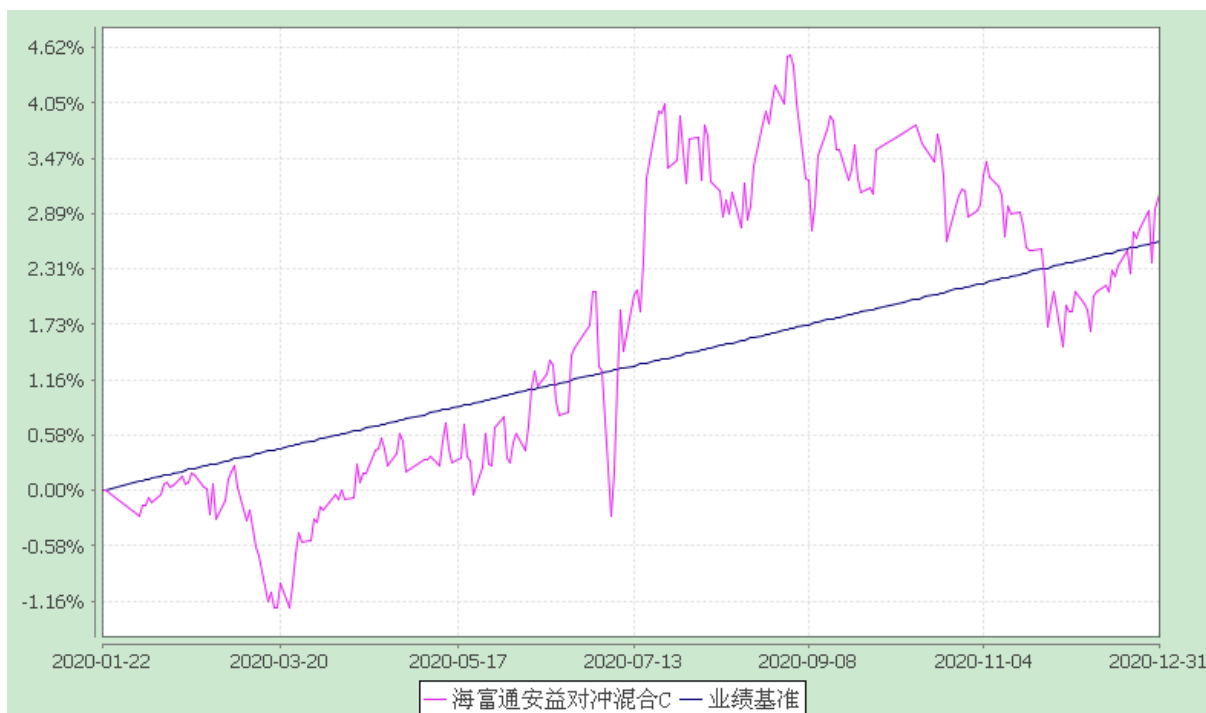
1. 海富通安益对冲混合 A

(2020 年 1 月 22 日至 2020 年 12 月 31 日)



2. 海富通安益对冲混合 C

(2020 年 1 月 22 日至 2020 年 12 月 31 日)



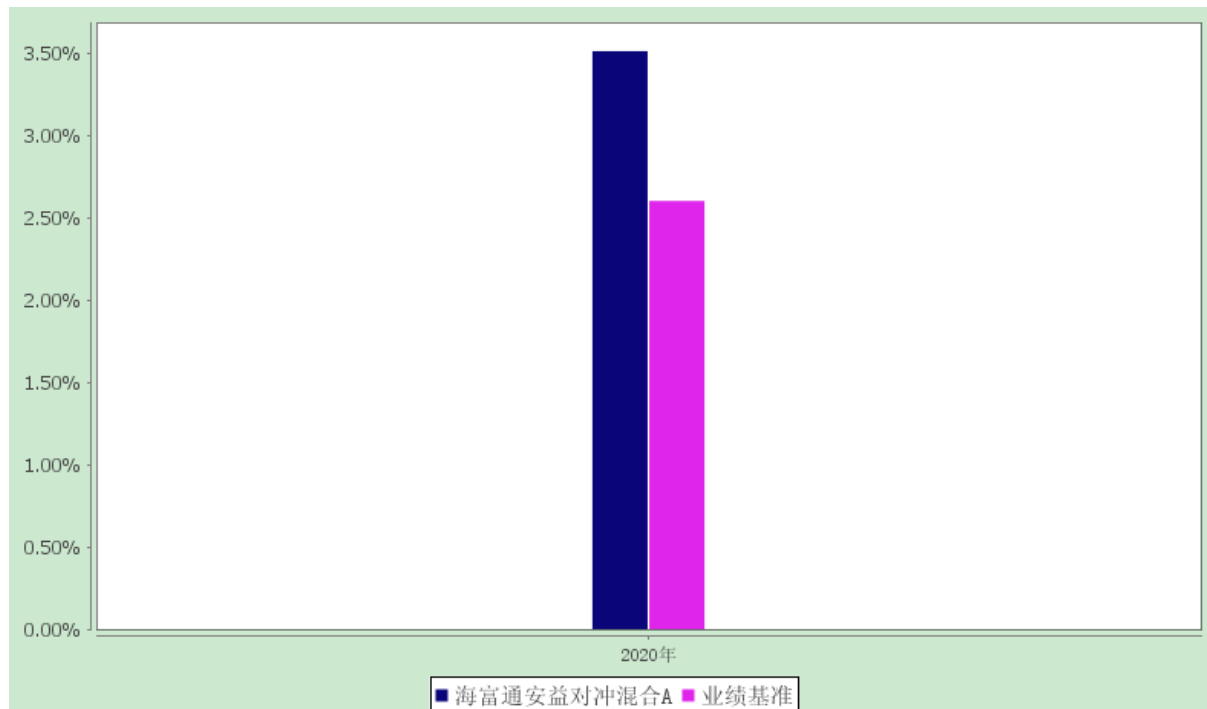
注：1、本基金合同于 2020 年 1 月 22 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

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

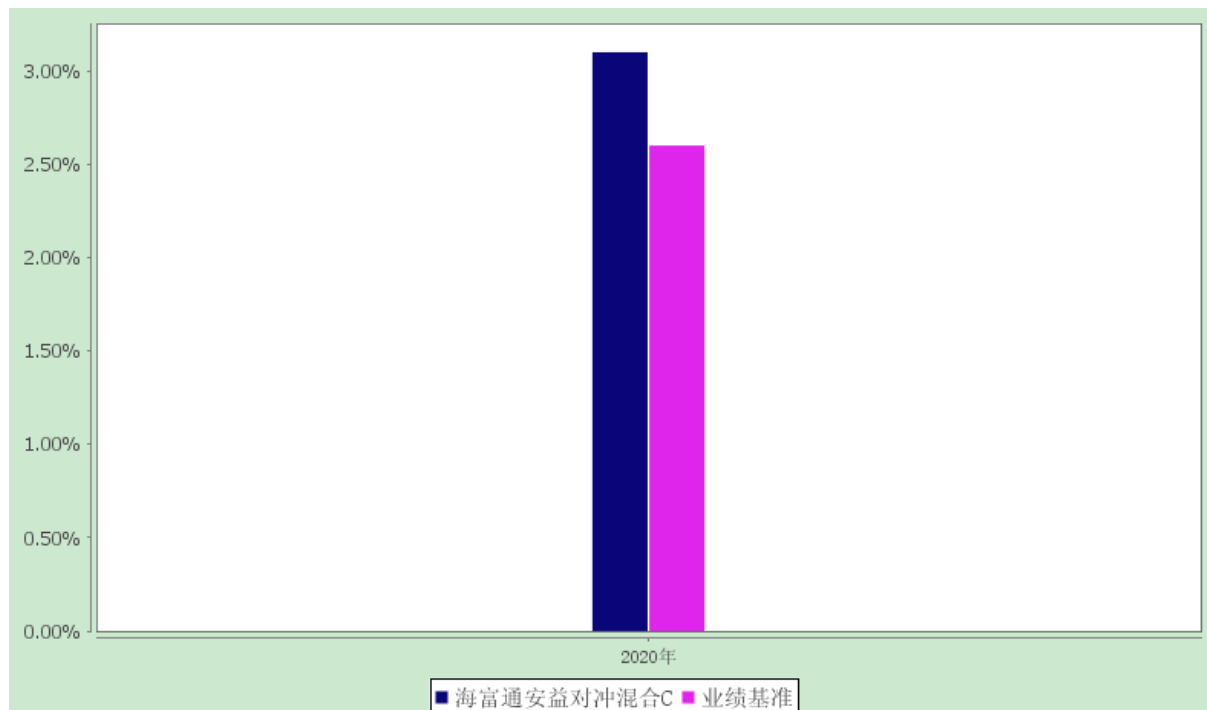
海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

1. 海富通安益对冲混合 A



2. 海富通安益对冲混合 C



注：图中列示的 2020 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 1 月 22 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、海富通安益对冲混合 A:

单位：人民币元

年度	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发放 总额	年度利润分配 合计	备注
2020	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

2、海富通安益对冲混合 C:

单位：人民币元

年度	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发放 总额	年度利润分配 合计	备注
2020	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金合同于 2020 年 1 月 22 日生效，未实施利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 81 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、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、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值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；海富通富盈混合基金经理；海富通富泽混合基金经理；海富通添鑫收益债券基金经理；海富通欣荣混合基金经理；海富通中证 500 增强基金经理；量化投资部总监。	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 月起任海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通新内需混合基金经理。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 月兼任海富通富睿混合（现海富通沪深 300 增强）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、海富通创业板增强的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 10 月兼任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 月至 2020 年 10 月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：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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了一级市场和二级市场的所有投资交易管理活动以及公司内部的证券分配，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 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 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的样本，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。

4.3.3 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

回顾 2020 年，A 股市场不但经受住了突发疫情的冲击，而且经受住了特朗普政府对华摩擦带来的外部冲击。二季度之后，在经济基本面率先回升与政策面呵护之下，成为全球主要股市中表现最亮眼的市场之一。具体来看，沪深 300 指数、科创 50 指数、中小板指、创业板指等主要指数当年涨幅分别达到 27.21%、39.30%、43.91%、64.96%。

就行业表现而言，28 个申万一级行业表现两极分化显著。全年涨幅居于前五位的行业分别是休闲服务、电气设备、食品饮料、国防军工和医药生物，全年涨幅均超过 50%。与之相比，房地产、通信、建筑装饰、纺织服装、银行等五个表现最差的行业全年跌幅 3%-10% 不等。全年行情的主线集中于消费和成长两个方向，既包括了以白酒、免税服务为代表的消费升级板块，也包括了新能源车、光伏、CXO 与创新药、半导体与 5G 等中国经济转型升级的板块。而传统经济集中的相关行业除大炼化等少数细分领域之外，虽然也有过脉冲式的上涨，但是总体表现低迷。与结构性牛市相伴的是 A 股 4000 多支股票在 2020 年超过一半是下跌或者持平的。

从业绩的角度来看，跌幅居于前五位的行业当中，除通信和纺织服装之外的其余三个行业万得一致预期的行业利润增速都是下滑的。而行业盈利增速预期前五位的行业除电气设备之外，不论是传统经济的有色金属、农林牧渔、机械设备，还是偏成长的计算机，均未进入年度涨幅前五位。

与二级市场不断走高相应的则是热络的一级市场。在推行股票发行注册制的环境下，从万得统计数据来看，全年 A 股市场的权益融资规模，包括 IPO、再融资、优先股、可转债等合计超过 1.6 万亿元，仅次于 2016 年和 2015 年。截至 2020 年年底，沪深两市的股票数量突破了 4000 支。沪深两市总市值接近 80 万亿元，与当年 GDP 的比值接近 0.8。

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 3.51%，同期业绩比较基准收益率为 2.60%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.91 个百分点；海富通安益对冲混合 C 净值增长率为 3.10%，同期业绩比较基准收益率为 2.60%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.50 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 2021 年，随着全球主要经济体财政与货币刺激政策的落地，疫苗接种率的不断提升，疫情的外部冲击的边际钝化，经济回升的方向是比较确定的。而 2020 年以来，从农产品到石油以外的矿产品出现的广泛价格上升将抬升全球的 PPI 和 CPI。若不再出现加深全球结构对立与冲突的因素，那么 2021 年的宏观环境将会是偏暖的。

映射到 A 股市场，实体经济的回升和外部环境的缓和可能对于全市场的盈利增速和估值中枢带来正好相反的影响。对于盈利增速，存量部分的传统经济由负转正是大概率，这就决定了全年的利润增速同比上行的趋势。而对于估值部分则可能正好相反，边际流动性持续宽松的概率非常小，那么由其带来的估值扩张也基本到头。由此带来的结构性行情将更多地是由企业季度经营业绩的逐季连续变化来决定，即哪些细分行业的龙头公司能够保持经营业绩的逐季提升与扩张，哪些公司的股价表现则会更坚挺。那些需要把 2025 年乃至 2030 年的市场空间与市占率预期折现到当前的公司，股价可能存在着估值消化的压力。

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。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020 年，基金管理人监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，通过业务审核、现场检查、系统监控、人员访谈、重点抽查等一系列方式开展工作，强化基金运作和公司运营的合规性，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、持续完善公司的规章制度，健全内部控制体系，落实内控责任。

根据法律法规和监管政策的发展和变化以及股东方针对公司内部风险管理的要求，自上而下地推动了内部控制机制的梳理和完善工作，组织各部门对多项内部制度和流程进行了更新，健全了公司内部控制制度体系，强化了各项内控职责，提升了公司内部控制环境建设，为公司各项业务合规开展提供有效的制度保障，为基金持有人利益最大化提供有力的保障。

二、加强对公司和基金日常运作的合规管理。

本报告期内，坚持以法律法规和公司管理制度为依据，对公司和基金日常运作的各

项业务实施事前、事中、事后的合规性审核，对新产品和新业务进行合规性审核，确保了基金运作的诚信和合法合规性。此外，督察稽核部根据法规、监管要求并结合公司内部控制的需要，对公司各部门的业务有重点的开展了多项专项检查和内部审计，对检查中发现的问题向公司经营管理层汇报，并跟踪落实各项问题的整改情况，严格控制了各部门的主要风险，加强并完善公司的内部控制状况。同时，根据法规、股东方等要求，公司聘请会计师事务所、律师事务所等对公司内部控制管理、合规有效性、反洗钱风险等开展了专项评估。通过事前、事中、事后的全方位合规审核及内部审计，公司对治理结构、投资交易、销售及客户服务体系、信息安全控制、基金运营控制、分支机构管理及人力资源管理等方面的内部规章制度和各项业务流程予以了完善，强化了现有规章制度的执行力度。

三、有效推进反洗钱工作。

本报告期内，结合反洗钱法规及公司业务特点，完善了反洗钱制度及流程，组织多场反洗钱专项培训和考试；重点开展全面的直销客户信息核查清理工作，对于直销投资者身份信息资料不完整、不准确、未在合理期限内补充完善的客户予以限制交易；梳理高风险业务清单并更新业务流程，针对机构洗钱风险评估发现的问题进行整改和优化；稳步推进代销模式洗钱风险管理工作，督促代销机构签署反洗钱补充协议；牵头持续对反洗钱系统进行升级改造，强化对大额交易和可疑交易方面的监控，并按时向中国反洗钱监测分析中心报送相关数据。报告期内，公司根据监管要求完成了 2019 年度的反洗钱分类评级自评估工作。

四、加强投资者教育，培养投资者风险意识和投资理念。

本报告期内，公司为鼓励投资者进行长期投资，持续不断的和投资者进行沟通，并利用网络互动平台、主流媒体专栏及举办投资者交流会等多种渠道、多种媒介积极推进投资者教育工作，努力倡导“长期持有、理性投资”的投资理念，培养广大投资者的风险意识、切实加强保护了广大基金持有人的合法权益。

五、强化法规学习，组织开展内外部培训，提升员工的合规及风险意识。

本报告期内，为提高公司全员的合规意识，进一步加强组织各类合规培训频率，及时将新颁布的各项法律法规进行解读和落实，并组织全体员工开展各类内外部培训，剖析风险案例，培训内容包括新法规政策落实、监管精神传达、投资交易、市场销售业务、信息技术管理、廉洁从业管理、宣传推介合规管理、员工行为管理、反洗钱、子公司资管业务合规风险等方面，并通过结合内部考试系统多次组织了线上培训及在线考试。通过培训，增强了员工的合规意识和风险防范意识，提升了员工的主动识别和控制业务风险的积极性和能力。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，进一步提高督察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金财产安全、合规、诚信运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本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，组成人员包括分管基金运营业务的高级管理人员、分管投资业务的高级管理人员、督察稽核部负责人、风险管理部负责人、研究部负责人及基金运营部负责人等，以上人员具有丰富的合规、风控、证券研究、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。估值委员会对经济环境发生重大变化或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，提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金运营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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本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，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

本报告期内，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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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年度报告中财务指标、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 审计报告

毕马威华振审字第 2100153 号

海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了后附的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“海富通安益对冲混合基金”）财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2020 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了海富通安益对冲混合基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2020 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于海富通安益对冲混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

海富通安益对冲混合基金管理人海富通基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括海富通安益对冲混合基金 2020 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形

式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估海富通安益对冲混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非海富通安益对冲混合基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督海富通安益对冲混合基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对海富通安益对冲混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致海富通安益对冲混合基金不能持续经营。

(5)评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师
 王国蓓 倪益
 北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
 2021年3月29日

§7 年度财务报表

7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日
资产：		-
银行存款	7.4.7.1	27,880,858.37
结算备付金	7.4.10.6	241,189,334.29
存出保证金		175,480,400.60
交易性金融资产	7.4.7.2	1,915,120,053.26
其中：股票投资		1,595,276,211.58

基金投资		-
债券投资		319,843,841.68
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		15,381,647.96
应收利息	7.4.7.5	3,654,615.27
应收股利		-
应收申购款		30,100,730.36
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		2,408,807,640.11
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
负 债:		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		7,993,078.85
应付赎回款		9,214,191.94
应付管理人报酬		3,160,026.83
应付托管费		526,671.12
应付销售服务费		42,207.00
应付交易费用	7.4.7.7	1,781,998.42
应交税费		3,722.86
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	185,314.89
负债合计		22,907,211.91
所有者权益:		-
实收基金	7.4.7.9	2,305,238,977.46

未分配利润	7.4.7.10	80,661,450.74
所有者权益合计		2,385,900,428.20
负债和所有者权益总计		2,408,807,640.11

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,305,238,977.46 份。其中海富通安益对冲混合 A 基金份额总额 2,223,607,232.45 份，基金份额净值 1.0351 元，海富通安益对冲混合 C 基金份额总额 81,631,745.01 份，基金份额净值 1.0310 元。

7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日
一、收入		150,766,465.50
1.利息收入		23,222,286.63
其中：存款利息收入	7.4.7.11	15,425,380.40
债券利息收入		4,497,373.75
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		3,299,532.48
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-6,171,896.03
其中：股票投资收益	7.4.7.12	339,273,840.81
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	10,531.23
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-371,392,377.12
股利收益	7.4.7.16	25,936,109.05
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	132,118,475.33
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,597,599.57
减：二、费用		58,785,067.21

1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	39,098,059.05
2. 托管费	7.4.10.2. 2	6,516,343.19
3. 销售服务费		1,070,335.10
4. 交易费用	7.4.7.19	11,720,465.71
5. 利息支出		42,386.85
其中：卖出回购金融资产支出		42,386.85
6. 税金及附加		133,820.00
7. 其他费用	7.4.7.20	203,657.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		91,981,398.29
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		91,981,398.29

注：本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 12 月 31 日，上年度可比期间无比较数据。

7.3 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 12 月 31 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 12 月 31 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）	-	91,981,398.29	91,981,398.29
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）	-452,885,539.54	-11,319,947.55	-464,205,487.09
其中：1.基金申购款	2,177,171,424.88	58,933,078.82	2,236,104,503.70
2.基金赎回款	-2,630,056,964.42	-70,253,026.37	-2,700,309,990.79

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）	2,305,238,977.46	80,661,450.74	2,385,900,428.20

注：本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 12 月 31 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 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 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，其中海富通安益对冲混合 A 为人民币 2,359,044,097.42 元，海富通安益对冲混合 C 为人民币 398,751,676.00 元。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，海富通安益对冲混合 A 基金份额总额为 2,359,336,836.26 份基金份额，其中认购资金利息折合 292,738.84 份基金份额，海富通安益对冲混合 C 基金份额总额为 398,787,680.74 份基金份额，其中认购资金利息折合 36,004.74 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、存托凭证、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：股票资产及存托凭证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 2021 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况、自 2020 年 1 月 22 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 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自 2020 年 1 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现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。

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具 (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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

-除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-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；

-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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产的账面价值

-因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如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，参考类似投

资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益（主要为股指期货投资）按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业或兑付机构代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在证券实际

持有期内逐日计提。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 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。

本基金的交易费用于进行股票、债券、资产支持证券、衍生工具（主要为股指期货投资）等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金各类份额默认的收益分配方式是现金分红；本基金不同份额类别基金份额，其分红方式相互独立、互不影响；投资者不同基金交易账户设置的基金分红方式相互独立、互不影响；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。法律法规或监管机构另有规定的或在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

7.4.4.12 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.4.14 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、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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。

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。

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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 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 [2014] 81 号文《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税 [2016] 127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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：

(a) 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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 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。

(c) 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。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有

限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(d) 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。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	活期存款	27,880,858.37
定期存款	-	
其中：存款期限 1 个月以内	-	
存款期限 1-3 个月	-	
存款期限 3 个月以上	-	
其他存款	-	
合计	27,880,858.37	

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,347,240,511.88	1,595,276,211.58	248,035,699.70	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	204,602,724.93	201,717,041.68	-2,885,683.25
	银行间市场	119,087,352.00	118,126,800.00	-960,552.00

	合计	323,690,076.93	319,843,841.68	-3,846,235.25
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	1,670,930,588.81	1,915,120,053.26	244,189,464.45

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-1,270,983,490.88	-	-	-
——股指期货	-1,270,983,490.88	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-1,270,983,490.88	-	-	-

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货情况：持有买入 IC2103 合约市值 6,251,400.00 元，公允价值变动-21,840.00 元。持有卖出 IF2103 合约市值-1,314,886,680.00 元，公允价值变动-102,847,137.69 元。持有卖出 IF2106 合约市值-74,419,200.00 元，公允价值变动-9,202,011.43 元；公允价值变动合计-112,070,989.12 元。

按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	20,446.68
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	392,633.08
应收债券利息	3,241,198.31
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	337.20
合计	3,654,615.27

7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,781,998.42
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,781,998.42

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	314.89
预提费用	185,000.00
合计	185,314.89

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	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	1,834,629,599.06	1,834,629,599.06
本期赎回（以“-”号填列）	-1,970,359,202.87	-1,970,359,202.87
本期末	2,223,607,232.45	2,223,607,232.45

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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	398,787,680.74	398,787,680.74
本期申购	342,541,825.82	342,541,825.82
本期赎回（以“-”号填列）	-659,697,761.55	-659,697,761.55
本期末	81,631,745.01	81,631,745.01

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.此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	-29,292,960.50	118,438,629.32	89,145,668.82
本期基金份额交易产生的变动数	11,764,970.43	-22,783,462.84	-11,018,492.41
其中：基金申购款	4,117,884.07	42,264,005.88	46,381,889.95
基金赎回款	7,647,086.36	-65,047,468.72	-57,400,382.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-17,527,990.07	95,655,166.48	78,127,176.41

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	-10,844,116.54	13,679,846.01	2,835,729.47
本期基金份额交易产生的变动数	9,873,031.43	-10,174,486.57	-301,455.14
其中：基金申购款	2,367,914.28	10,183,274.59	12,551,188.87
基金赎回款	7,505,117.15	-20,357,761.16	-12,852,644.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-971,085.11	3,505,359.44	2,534,274.33

7.4.7.11 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12月31日
活期存款利息收入	1,688,122.59
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	13,073,482.39
其他	75,580.98
合计	15,425,380.40

7.4.7.12 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12月31日
卖出股票成交总额	3,694,522,845.81
减：卖出股票成本总额	3,355,249,005.00
买卖股票差价收入	339,273,840.81

7.4.7.13 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12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	438,535,997.05
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	432,982,033.35
减：应收利息总额	5,543,432.47
买卖债券差价收入	10,531.23

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 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12月31日
股指期货投资收益（税前）	-370,317,810.88
股指期货差价收入应缴纳增值税额	-1,074,566.24
合计	-371,392,377.12

7.4.7.16 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12月31日
股票投资产生的股利收益	25,936,109.05
基金投资产生的股利收益	-
合计	25,936,109.05

7.4.7.17 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12月31日
1.交易性金融资产	244,189,464.45
——股票投资	248,035,699.70
——债券投资	-3,846,235.25
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
2.衍生工具	-112,070,989.12
——权证投资	-
——股指期货	-112,070,989.12
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	132,118,475.33

7.4.7.18 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12月31日
基金赎回费收入	1,587,457.63
其他	471.77
基金转换费收入	9,670.17
合计	1,597,599.57

7.4.7.19 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12月31日
交易所市场交易费用	11,719,145.71
银行间市场交易费用	1,320.00
合计	11,720,465.71

7.4.7.20 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12月31日
审计费用	65,000.00
信息披露费	120,000.00
债券托管账户维护费	12,000.00
其他	200.00
银行划款手续费	4,847.26
港股通证券组合费	1,610.05
合计	203,657.31

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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
法国巴黎资产管理 BE 控股公司(BNP Paribas Asset Management BE Holding)	基金管理人的股东
上海富诚海富通资产管理有限公司	基金管理人的子公司

海富通资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
海富通基金管理有限公司("海富通")	基金管理人、登记机构（自 TA）、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，本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	2,215,898,162.37	26.59%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	1,927,245.89	28.88%	6,699.97	0.38%

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、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用海通证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从海通证券获得研究综合服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	39,098,059.05
其中：支付销售机构的客户维护费	12,949,092.29

注：支付基金管理人海富通基金管理有限公司的基金管理费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。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,516,343.19

注：支付基金托管人交通银行的基金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。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日		
获得销售服务费的各关联方名称	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	-	120,672.31	120,672.31
海通证券	-	81,023.62	81,023.62
海富通	-	326,442.61	326,442.61
合计	-	528,138.54	528,138.54

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：海富通安益对冲混合 C 类基金日基金销售服务费=前一日 C 类份额对应的基金资产净值 ×0.40%/ 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	49,218,738.86	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	49,218,738.86	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.21%	-

注：1.此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2.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，符合招募说明书中规定的申购费率。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月22日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	27,880,858.37	1,688,122.59

注：本基金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2020 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 12,185,890.79 元。

7.4.10.7 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12月31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
海通证券	300879	大叶股份	网下发行	4,660	49,302.80
海通证券	688180	君实生物	网下发行	29,617	1,643,743.50
海通证券	688301	奕瑞科技	网下发行	2,427	290,269.20
海通证券	688521	芯原股份	网下发行	13,200	508,596.00
海通证券	688536	思瑞浦	网下发行	3,566	412,621.86
海通证券	688550	瑞联新材	网下发行	2,539	288,735.08
海通证券	688981	中芯国际	网下发行	462,175	12,691,325.50

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
000333	美的集团	2020-09-03	2021-03-03	大宗交易	67.53	95.26	200,000	13,506,000.00	19,052,000.00	-
002332	仙琚制药	2020-11-27	2021-05-27	非公开发行流通受限	13.70	12.69	145,985	1,999,994.50	1,852,549.65	-
002352	顺丰控股	2020-07-21	2021-01-21	大宗交易	61.38	86.75	160,000	9,820,800.00	13,880,000.00	-
002532	天山铝业	2020-12-23	2021-06-24	非公开发行流通受限	6.55	6.95	305,343	1,999,996.65	2,122,133.85	-
002705	新宝股份	2020-10-29	2021-04-29	大宗交易	43.57	39.52	70,000	3,049,900.00	2,766,400.00	-
002726	龙大肉食	2020-08-26	2021-02-26	大宗交易	11.03	12.38	185,000	2,040,550.00	2,290,300.00	-
002938	鹏鼎控股	2020-07-30	2021-02-01	大宗交易	45.80	48.82	75,000	3,435,000.00	3,661,500.00	-
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300454	深信服	2020-08-05	2021-02-05	大宗交易	201.96	240.22	20,000	4,039,200.00	4,804,400.00	-
300639	凯普生物	2020-08-18	2021-02-18	大宗交易	50.50	36.33	40,000	2,020,000.00	1,453,200.00	-

								0	0	
300860	锋尚文化	2020-08-06	2021-02-24	新股锁定	138.02	126.67	381	52,585.62	48,261.27	-
300861	美畅股份	2020-08-06	2021-02-24	新股锁定	43.76	51.10	895	39,165.20	45,734.50	-
300864	南大环境	2020-08-13	2021-02-25	新股锁定	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300866	安克创新	2020-08-11	2021-02-24	新股锁定	66.32	156.18	9,451	626,790.32	1,476,057.18	-
300867	圣元环保	2020-08-12	2021-03-03	新股锁定	19.34	31.97	1,498	28,971.32	47,891.06	-
300868	杰美特	2020-08-12	2021-02-24	新股锁定	41.26	43.28	593	24,467.18	25,665.04	-
300872	天阳科技	2020-08-14	2021-02-25	新股锁定	21.34	37.84	871	18,587.14	32,958.64	-
300873	海晨股份	2020-08-14	2021-03-02	新股锁定	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300876	蒙泰高新	2020-08-14	2021-02-25	新股锁定	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-
300877	金春股份	2020-08-17	2021-03-03	新股锁定	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	-
300878	维康药业	2020-08-17	2021-03-03	新股锁定	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-
300879	大叶股份	2020-08-25	2021-03-01	新股锁定	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300881	盛德鑫泰	2020-08-25	2021-03-05	新股锁定	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300882	万胜智能	2020-08-27	2021-03-10	新股锁定	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300884	狄耐克	2020-11-05	2021-05-12	新股锁定	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-
300886	华业香料	2020-09-08	2021-03-16	新股锁定	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
300887	谱尼测试	2020-09-09	2021-03-16	新股锁定	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300889	爱克股份	2020-09-09	2021-03-16	新股锁定	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020-09-10	2021-03-18	新股锁定	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020-09-10	2021-03-17	新股锁定	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300892	品渥食品	2020-09-11	2021-03-30	新股锁定	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-

300893	松原股份	2020-09-17	2021-03-24	新股锁定	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300894	火星	2020-12-24	2021-07-01	新股锁定	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-
300895	铜牛信息	2020-09-17	2021-03-24	新股锁定	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300896	爱美客	2020-09-21	2021-03-29	新股锁定	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	-
300898	熊猫乳品	2020-10-09	2021-04-16	新股锁定	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300908	仲景食品	2020-11-13	2021-05-24	新股锁定	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300909	汇创达	2020-11-11	2021-05-18	新股锁定	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300917	特发服务	2020-12-14	2021-06-21	新股锁定	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-06-23	新股锁定	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-
300920	润阳科技	2020-12-17	2021-06-25	新股锁定	26.93	34.13	2,503	67,405.79	85,427.39	-
300922	天秦装备	2020-12-18	2021-06-25	新股锁定	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股未上市并锁定	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300999	金龙鱼	2020-09-29	2021-04-15	新股锁定	25.70	88.29	12,114	311,329.80	1,069,545.06	-
600563	法拉电子	2020-12-30	2021-06-30	大宗交易	94.70	99.41	32,000	3,030,400.00	3,181,120.00	-
600745	闻泰科技	2020-07-31	2021-01-29	大宗交易	135.16	96.82	40,000	5,406,400.00	3,872,800.00	-
600989	宝丰能源	2020-11-11	2021-05-11	大宗交易	9.83	11.09	410,000	4,030,300.00	4,546,900.00	-
601100	恒立液压	2020-12-17	2021-06-17	大宗交易	91.60	106.14	33,000	3,022,800.00	3,502,620.00	-

601360	三六零	2020-07-09	2021-01-11	大宗交易	18.49	15.54	135,000	2,496,150.00	2,097,900.00	-
603218	日月股份	2020-08-04	2021-02-03	大宗交易	17.68	28.78	169,700	3,000,296.00	4,883,966.00	-
603218	日月股份	2020-12-01	2021-05-27	非公开发行流通受限	20.37	27.91	196,367	3,999,995.79	5,480,602.97	-
603233	大参林	2020-09-25	2021-03-25	大宗交易	76.26	74.95	27,000	2,059,020.00	2,023,650.00	-
603501	韦尔股份	2020-09-04	2021-03-04	大宗交易	173.09	218.45	17,000	2,942,530.00	3,713,650.00	-
603583	捷昌驱动	2020-10-20	2021-04-16	非公开发行流通受限	60.88	72.42	8,459	514,983.92	612,600.78	-
603658	安图生物	2020-07-23	2021-01-25	大宗交易	150.20	142.29	17,000	2,553,400.00	2,418,930.00	-
605277	新亚电子	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688060	云涌科技	2020-07-03	2021-01-11	新股锁定	44.47	81.69	2,400	106,728.00	196,056.00	-
688069	德林海	2020-07-15	2021-01-22	新股锁定	67.20	62.45	2,253	151,401.60	140,699.85	-
688093	世华科技	2020-09-22	2021-03-30	新股锁定	17.55	23.63	4,595	80,642.25	108,579.85	-
688095	福昕软件	2020-09-01	2021-03-08	新股锁定	238.53	228.79	1,981	472,527.93	453,232.99	-
688311	盟升电子	2020-07-24	2021-02-01	新股锁定	41.58	115.36	4,182	173,887.56	482,435.52	-
688313	仕佳光子	2020-08-04	2021-02-18	新股锁定	10.82	22.92	7,151	77,373.82	163,900.92	-
688336	三生国健	2020-07-15	2021-01-22	新股锁定	28.18	24.29	14,352	404,439.36	348,610.08	-
688338	赛科希德	2020-07-27	2021-02-08	新股锁定	50.35	54.59	3,041	153,114.35	166,008.19	-

688500	慧辰资讯	2020-07-09	2021-01-18	新股锁定	34.21	38.76	3,414	116,792.94	132,326.64	-
688521	芯原股份	2020-08-11	2021-02-18	新股锁定	38.53	77.99	13,200	508,596.00	1,029,468.00	-
688528	秦川物联	2020-06-19	2021-01-04	新股锁定	11.33	16.34	8,337	94,458.21	136,226.58	-
688617	惠泰医疗	2020-12-30	2021-01-07	新股未上市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
688698	伟创电气	2020-12-22	2021-06-29	新股锁定	10.75	15.29	4,751	51,073.25	72,642.79	-
688788	科思科技	2020-10-13	2021-04-22	新股锁定	106.04	109.59	3,629	384,819.16	397,702.11	-

7.4.12.1.2 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
113616	韦尔转债	2020-12-28	2021-01-22	老股东配债	100.00	100.00	1,510	151,000.00	151,000.00	-
123083	朗新转债	2020-12-09	2021-01-06	老股东配债	100.00	100.00	9	900.00	900.00	-

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算，在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金持有的上市公司非公开发行股份，减持采取集中竞价交易方式或采取大宗交易方式的根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由法规规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于 2020 年 12 月 31 日,本基金无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2020 年 12 月 31 日,本基金无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2020 年 12 月 31 日, 本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险, 主要包括:

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

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。

7.4.13.2 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，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，违约风险发生的可能性很小；在银行间同业市场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 12 月 31 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 7.82%。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。

7.4.13.2.1 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12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	85,024,433.70
合计	85,024,433.70

注：未评级债券为国债。

7.4.13.2.2 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12月31日
AAA	140,684,442.84
AAA 以下	46,001,165.14
未评级	48,133,800.00
合计	234,819,407.98

注：未评级债券为国债及政策性金融债。

7.4.13.3 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上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 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 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开放式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）。

本基金所持的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 7.4.12。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 12 月 31 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 4.02%。

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

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

本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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	27,880,858.37	-	-	-	27,880,858.37

结算备付金	241,189,334.29	-	-	-	241,189,334.29
存出保证金	175,480,400.60	-	-	-	175,480,400.60
交易性金融资产	167,599,209.30	140,802,829.30	11,441,803.08	1,595,276,211.58	1,915,120,053.26
应收证券清算款	-	-	-	15,381,647.96	15,381,647.96
应收申购款	-	-	-	30,100,730.36	30,100,730.36
应收利息	-	-	-	3,654,615.27	3,654,615.27
资产总计	612,149,802.56	140,802,829.30	11,441,803.08	1,644,413,205.17	2,408,807,640.11
负债					
应付证券清算款	-	-	-	7,993,078.85	7,993,078.85
应付管理人报酬	-	-	-	3,160,026.83	3,160,026.83
应付销售服务费	-	-	-	42,207.00	42,207.00
应付托管费	-	-	-	526,671.12	526,671.12
应付交易费用	-	-	-	1,781,998.42	1,781,998.42
应付赎回款	-	-	-	9,214,191.94	9,214,191.94
应付税费	-	-	-	3,722.86	3,722.86
其他负债	-	-	-	185,314.89	185,314.89
负债总计	-	-	-	22,907,211.91	22,907,211.91
利率敏感度缺口	612,149,802.56	140,802,829.30	11,441,803.08	1,621,505,993.26	2,385,900,428.20

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进行了分类。

7.4.13.4.1.2 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12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-1,655,886.98
	市场利率下降 25 个基点	1,677,524.27

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2020年12月31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	-	24,461,454.42	24,461,454.42
资产合计	-	24,461,454.42	24,461,454.42
以外币计价的负债			
应付证券清算款	-	7,993,078.85	7,993,078.85
负债合计	-	7,993,078.85	7,993,078.85
资产负债表 外汇风险敞口净额	-	16,468,375.57	16,468,375.57

注：出于列报考虑，风险敞口金额以人民币列示，以资产负债表日即期汇率折算。

7.4.13.4.2.2 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12月31日
	所有外币相对人民币升值 5%	823,418.78
	所有外币相对人民币贬值 5%	-823,418.78

7.4.13.4.3 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。本基金投资组合中股票资产及存托凭证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%；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。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%。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,595,276,211.58	66.86
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	1,595,276,211.58	66.86

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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12月31日
	业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	13,332,664.86
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-13,332,664.86

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 以公允价值计量的资产和负债

下文列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次

取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 1,531,711,019.88 元，第二层次的余额为人民币 383,409,033.38 元，无属于第三层次的余额。

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.2 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,595,276,211.58	66.23
	其中：股票	1,595,276,211.58	66.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	319,843,841.68	13.28
	其中：债券	319,843,841.68	13.28
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	269,070,192.66	11.17
8	其他各项资产	224,617,394.19	9.32
9	合计	2,408,807,640.11	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	3,072,152.69	0.13
B	采矿业	38,050,589.86	1.59
C	制造业	1,018,325,388.13	42.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,780,416.00	0.28
E	建筑业	2,519,206.00	0.11
F	批发和零售业	5,560,792.72	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	26,074,297.20	1.09
H	住宿和餐饮业	1,417,075.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	58,358,071.41	2.45
J	金融业	285,618,703.40	11.97
K	房地产业	57,578,172.14	2.41
L	租赁和商务服务业	13,997,133.00	0.59
M	科学研究和技术服务业	24,786,340.30	1.04
N	水利、环境和公共设施管理业	1,200,957.84	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,063,568.00	0.51
R	文化、体育和娱乐业	15,411,893.47	0.65
S	综合	-	-
	合计	1,570,814,757.16	65.84

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	13,670,926.85	0.57
医疗保健	412,874.92	0.02
原材料	1,540,432.65	0.06
金融	8,837,220.00	0.37
合计	24,461,454.42	1.03

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	70,790	141,438,420.00	5.93
2	601318	中国平安	830,700	72,254,286.00	3.03
3	600036	招商银行	1,339,500	58,871,025.00	2.47
4	000333	美的集团	474,910	46,114,140.40	1.93
5	601166	兴业银行	1,702,200	35,524,914.00	1.49
6	002475	立讯精密	615,986	34,569,134.32	1.45
7	000858	五粮液	115,500	33,708,675.00	1.41
8	300059	东方财富	1,070,800	33,194,800.00	1.39
9	000002	万科 A	974,800	27,976,760.00	1.17
10	000001	平安银行	1,403,200	27,137,888.00	1.14
11	002594	比亚迪	133,543	25,947,404.90	1.09
12	600030	中信证券	875,341	25,735,025.40	1.08
13	600031	三一重工	720,300	25,196,094.00	1.06
14	600887	伊利股份	550,100	24,407,937.00	1.02
15	601899	紫金矿业	2,495,600	23,184,124.00	0.97
16	600438	通威股份	565,700	21,745,508.00	0.91
17	000725	京东方 A	3,428,300	20,569,800.00	0.86
18	601012	隆基股份	218,600	20,154,920.00	0.84
19	002415	海康威视	413,391	20,053,597.41	0.84
20	603259	药明康德	143,660	19,353,875.20	0.81
21	000651	格力电器	312,204	19,337,915.76	0.81
22	600048	保利地产	1,219,000	19,284,580.00	0.81
23	300014	亿纬锂能	226,115	18,428,372.50	0.77
24	600276	恒瑞医药	160,370	17,874,840.20	0.75
25	600690	海尔智家	582,289	17,008,661.69	0.71

26	000661	长春高新	35,800	16,070,978.00	0.67
27	300760	迈瑞医疗	35,900	15,293,400.00	0.64
28	002142	宁波银行	416,400	14,715,576.00	0.62
29	600741	华域汽车	502,100	14,470,522.00	0.61
30	002410	广联达	181,500	14,291,310.00	0.60
31	002352	顺丰控股	160,024	13,882,117.52	0.58
32	600521	华海药业	409,220	13,835,728.20	0.58
33	00700	腾讯控股	28,800	13,670,926.85	0.57
34	600570	恒生电子	124,821	13,093,722.90	0.55
35	601601	中国太保	337,700	12,967,680.00	0.54
36	600176	中国巨石	642,040	12,815,118.40	0.54
37	300124	汇川技术	136,500	12,735,450.00	0.53
38	601888	中国中免	43,900	12,399,555.00	0.52
39	600009	上海机场	160,880	12,172,180.80	0.51
40	603501	韦尔股份	53,600	12,171,910.00	0.51
41	300122	智飞生物	80,959	11,974,645.69	0.50
42	603218	日月股份	416,067	11,877,068.97	0.50
43	002271	东方雨虹	292,900	11,364,520.00	0.48
44	000100	TCL 科技	1,516,800	10,738,944.00	0.45
45	300316	晶盛机电	350,131	10,531,940.48	0.44
46	300450	先导智能	121,300	10,187,987.00	0.43
47	601966	玲珑轮胎	286,957	10,092,277.69	0.42
48	300413	芒果超媒	134,200	9,729,500.00	0.41
49	300601	康泰生物	53,300	9,300,850.00	0.39
50	002557	洽洽食品	168,901	9,095,318.85	0.38
51	03908	中金公司	500,000	8,837,220.00	0.37
52	603833	欧派家居	63,650	8,560,925.00	0.36
53	601225	陕西煤业	904,315	8,446,302.10	0.35
54	600309	万华化学	91,931	8,369,398.24	0.35
55	000338	潍柴动力	459,848	7,260,999.92	0.30
56	002311	海大集团	109,383	7,164,586.50	0.30
57	601636	旗滨集团	556,641	7,125,004.80	0.30
58	000157	中联重科	714,553	7,074,074.70	0.30
59	002179	中航光电	90,300	7,069,587.00	0.30
60	300347	泰格医药	42,120	6,807,013.20	0.29
61	600900	长江电力	348,000	6,667,680.00	0.28
62	000568	泸州老窖	29,100	6,581,256.00	0.28
63	603986	兆易创新	33,020	6,521,450.00	0.27
64	600346	恒力石化	220,700	6,172,979.00	0.26
65	300408	三环集团	158,810	5,915,672.50	0.25
66	002867	周大生	216,600	5,772,390.00	0.24
67	600989	宝丰能源	510,000	5,716,900.00	0.24
68	600885	宏发股份	103,598	5,617,083.56	0.24
69	300144	宋城演艺	316,060	5,600,583.20	0.23

70	002938	鹏鼎控股	106,016	5,202,064.72	0.22
71	600563	法拉电子	48,000	4,901,920.00	0.21
72	300454	深信服	20,000	4,804,400.00	0.20
73	000708	中信特钢	203,944	4,443,939.76	0.19
74	000739	普洛药业	190,800	4,441,824.00	0.19
75	002236	大华股份	222,934	4,434,157.26	0.19
76	000830	鲁西化工	342,600	4,378,428.00	0.18
77	603195	公牛集团	20,900	4,290,561.00	0.18
78	000513	丽珠集团	102,700	4,159,350.00	0.17
79	002007	华兰生物	92,800	3,919,872.00	0.16
80	600486	扬农化工	29,600	3,907,200.00	0.16
81	600745	闻泰科技	40,000	3,872,800.00	0.16
82	600038	中直股份	61,700	3,869,207.00	0.16
83	300451	创业慧康	276,900	3,746,457.00	0.16
84	603882	金域医学	28,800	3,689,856.00	0.15
85	002493	荣盛石化	133,000	3,672,130.00	0.15
86	002601	龙蟠佰利	118,900	3,658,553.00	0.15
87	000895	双汇发展	77,701	3,647,284.94	0.15
88	002705	新宝股份	90,100	3,615,625.00	0.15
89	000656	金科股份	502,800	3,564,852.00	0.15
90	002008	大族激光	82,500	3,526,875.00	0.15
91	601100	恒立液压	33,016	3,504,428.00	0.15
92	603899	晨光文具	39,334	3,483,419.04	0.15
93	600507	方大特钢	490,300	3,402,682.00	0.14
94	002332	仙琚制药	252,553	3,276,298.13	0.14
95	600660	福耀玻璃	65,800	3,161,690.00	0.13
96	002812	恩捷股份	22,269	3,157,298.82	0.13
97	600496	精工钢构	700,700	3,139,136.00	0.13
98	300433	蓝思科技	100,600	3,079,366.00	0.13
99	600585	海螺水泥	59,300	3,061,066.00	0.13
100	000786	北新建材	76,100	3,047,805.00	0.13
101	600055	万东医疗	300,000	3,036,000.00	0.13
102	002714	牧原股份	39,250	3,026,175.00	0.13
103	600426	华鲁恒升	80,800	3,013,840.00	0.13
104	002600	领益智造	249,700	2,993,903.00	0.13
105	000538	云南白药	26,284	2,985,862.40	0.13
106	600383	金地集团	215,500	2,909,250.00	0.12
107	300271	华宇软件	121,800	2,907,366.00	0.12
108	603369	今世缘	50,500	2,897,690.00	0.12
109	000933	神火股份	361,300	2,883,174.00	0.12
110	300037	新宙邦	28,400	2,879,760.00	0.12
111	603129	春风动力	16,500	2,874,135.00	0.12
112	600988	赤峰黄金	159,300	2,853,063.00	0.12
113	002384	东山精密	109,700	2,852,200.00	0.12

114	601231	环旭电子	147,300	2,848,782.00	0.12
115	601168	西部矿业	230,100	2,848,638.00	0.12
116	002080	中材科技	116,800	2,824,224.00	0.12
117	002831	裕同科技	92,100	2,820,102.00	0.12
118	002727	一心堂	84,400	2,811,364.00	0.12
119	000877	天山股份	184,500	2,785,950.00	0.12
120	300737	科顺股份	129,800	2,785,508.00	0.12
121	601799	星宇股份	13,800	2,766,900.00	0.12
122	600529	山东药玻	55,100	2,763,265.00	0.12
123	600845	宝信软件	39,800	2,745,404.00	0.12
124	603416	信捷电气	30,000	2,725,200.00	0.11
125	688202	美迪西	17,330	2,724,795.90	0.11
126	603233	大参林	35,800	2,713,130.00	0.11
127	002371	北方华创	14,800	2,674,952.00	0.11
128	002624	完美世界	84,631	2,496,614.50	0.10
129	601117	中国化学	423,600	2,486,532.00	0.10
130	000951	中国重汽	78,884	2,481,690.64	0.10
131	603236	移远通信	13,240	2,475,085.60	0.10
132	603658	安图生物	17,000	2,418,930.00	0.10
133	300702	天宇股份	25,800	2,412,300.00	0.10
134	002444	巨星科技	77,500	2,411,025.00	0.10
135	000636	风华高科	71,400	2,406,180.00	0.10
136	600298	安琪酵母	46,700	2,384,969.00	0.10
137	300253	卫宁健康	136,225	2,383,937.50	0.10
138	603960	克来机电	50,000	2,347,500.00	0.10
139	002001	新和成	69,452	2,339,143.36	0.10
140	002541	鸿路钢构	64,000	2,337,920.00	0.10
141	601838	成都银行	216,200	2,306,854.00	0.10
142	002726	龙大肉食	185,000	2,290,300.00	0.10
143	600872	中炬高新	32,500	2,166,125.00	0.09
144	002532	天山铝业	305,343	2,122,133.85	0.09
145	601360	三六零	135,000	2,097,900.00	0.09
146	300639	凯普生物	52,900	1,937,982.00	0.08
147	002318	久立特材	176,700	1,926,030.00	0.08
148	002968	新大正	38,700	1,917,585.00	0.08
149	001914	招商积余	89,000	1,916,170.00	0.08
150	603678	火炬电子	25,400	1,836,420.00	0.08
151	603806	福斯特	21,104	1,802,281.60	0.08
152	600588	用友网络	40,880	1,793,405.60	0.08
153	603737	三棵树	11,600	1,757,400.00	0.07
154	002595	豪迈科技	59,027	1,750,150.55	0.07
155	002025	航天电器	26,800	1,746,824.00	0.07
156	000596	古井贡酒	6,400	1,740,800.00	0.07
157	002967	广电计量	45,200	1,656,580.00	0.07

158	000547	航天发展	60,200	1,655,500.00	0.07
159	300470	中密控股	34,400	1,637,440.00	0.07
160	300015	爱尔眼科	20,920	1,566,698.80	0.07
161	002027	分众传媒	157,600	1,555,512.00	0.07
162	01787	山东黄金	102,250	1,540,432.65	0.06
163	600161	天坛生物	36,700	1,530,390.00	0.06
164	300525	博思软件	52,797	1,515,273.90	0.06
165	300558	贝达药业	14,100	1,513,917.00	0.06
166	300866	安克创新	9,451	1,476,057.18	0.06
167	300033	同花顺	11,700	1,450,566.00	0.06
168	002508	老板电器	35,531	1,448,954.18	0.06
169	002430	杭氧股份	49,800	1,448,682.00	0.06
170	603881	数据港	24,100	1,448,651.00	0.06
171	600104	上汽集团	58,900	1,439,516.00	0.06
172	688029	南微医学	7,805	1,436,198.05	0.06
173	300427	红相股份	58,700	1,431,693.00	0.06
174	600754	锦江酒店	27,500	1,417,075.00	0.06
175	002614	奥佳华	105,108	1,413,702.60	0.06
176	300607	拓斯达	39,360	1,367,760.00	0.06
177	002837	英维克	76,700	1,342,250.00	0.06
178	600406	国电南瑞	49,100	1,304,587.00	0.05
179	002126	银轮股份	94,500	1,301,265.00	0.05
180	601689	拓普集团	33,800	1,298,934.00	0.05
181	600926	杭州银行	84,200	1,256,264.00	0.05
182	002262	恩华药业	77,200	1,232,884.00	0.05
183	002216	三全食品	46,600	1,209,270.00	0.05
184	603866	桃李面包	20,300	1,199,730.00	0.05
185	002803	吉宏股份	36,900	1,189,656.00	0.05
186	002138	顺络电子	47,300	1,159,796.00	0.05
187	601233	桐昆股份	54,000	1,111,860.00	0.05
188	300999	金龙鱼	12,114	1,069,545.06	0.04
189	002064	华峰氨纶	105,600	1,065,504.00	0.04
190	300759	康龙化成	8,600	1,035,440.00	0.04
191	688521	芯原股份	13,200	1,029,468.00	0.04
192	600323	瀚蓝环境	40,113	995,203.53	0.04
193	603987	康德莱	63,400	994,746.00	0.04
194	300146	汤臣倍健	39,900	963,585.00	0.04
195	002832	比音勒芬	58,600	951,664.00	0.04
196	603700	宁水集团	30,000	875,100.00	0.04
197	300572	安车检测	21,300	870,744.00	0.04
198	603601	再升科技	63,700	869,505.00	0.04
199	002214	大立科技	30,500	839,360.00	0.04
200	603816	顾家家居	10,000	705,100.00	0.03
201	300136	信维通信	19,300	692,484.00	0.03

202	002223	鱼跃医疗	23,200	654,472.00	0.03
203	603444	吉比特	1,500	639,000.00	0.03
204	002258	利尔化学	30,000	627,000.00	0.03
205	603583	捷昌驱动	8,521	617,390.28	0.03
206	002128	露天煤业	55,800	610,452.00	0.03
207	300119	瑞普生物	30,000	566,400.00	0.02
208	300482	万孚生物	6,000	535,260.00	0.02
209	688311	盟升电子	4,182	482,435.52	0.02
210	688095	福昕软件	1,981	453,232.99	0.02
211	000672	上峰水泥	23,000	448,730.00	0.02
212	01066	威高股份	28,000	412,874.92	0.02
213	688788	科思科技	3,629	397,702.11	0.02
214	688336	三生国健	14,352	348,610.08	0.01
215	002353	杰瑞股份	9,410	329,350.00	0.01
216	300896	爱美客	473	285,389.28	0.01
217	002695	煌上煌	11,700	267,930.00	0.01
218	002013	中航机电	22,680	259,686.00	0.01
219	688060	云涌科技	2,400	196,056.00	0.01
220	688338	赛科希德	3,041	166,008.19	0.01
221	688313	仕佳光子	7,151	163,900.92	0.01
222	688069	德林海	2,253	140,699.85	0.01
223	688528	秦川物联	8,337	136,226.58	0.01
224	688500	慧辰资讯	3,414	132,326.64	0.01
225	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.01
226	002511	中顺洁柔	5,642	117,748.54	0.00
227	688093	世华科技	4,595	108,579.85	0.00
228	601211	国泰君安	6,000	105,180.00	0.00
229	002690	美亚光电	2,000	88,560.00	0.00
230	300920	润阳科技	2,503	85,427.39	0.00
231	601222	林洋能源	9,800	77,616.00	0.00
232	300575	中旗股份	2,000	76,800.00	0.00
233	688698	伟创电气	4,751	72,642.79	0.00
234	601088	中国神华	3,100	55,831.00	0.00
235	600461	洪城水业	8,000	54,080.00	0.00
236	600803	新奥股份	3,900	53,001.00	0.00
237	601818	光大银行	13,100	52,269.00	0.00
238	600028	中国石化	12,700	51,181.00	0.00
239	300860	锋尚文化	381	48,261.27	0.00
240	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.00
241	601336	新华保险	800	46,376.00	0.00
242	300861	美畅股份	895	45,734.50	0.00
243	600138	中青旅	4,100	42,066.00	0.00
244	600886	国投电力	4,400	38,016.00	0.00
245	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00

246	601928	凤凰传媒	5,300	33,549.00	0.00
247	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.00
248	601390	中国中铁	6,200	32,674.00	0.00
249	601369	陕鼓动力	4,500	32,310.00	0.00
250	600219	南山铝业	10,000	31,600.00	0.00
251	000703	恒逸石化	2,400	30,720.00	0.00
252	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
253	300877	金春股份	569	28,933.65	0.00
254	300498	温氏股份	1,503	27,399.69	0.00
255	600352	浙江龙盛	2,000	27,240.00	0.00
256	000060	中金岭南	5,400	26,028.00	0.00
257	300868	杰美特	593	25,665.04	0.00
258	300577	开润股份	900	23,472.00	0.00
259	000915	山大华特	1,000	23,390.00	0.00
260	300894	火星号	628	23,217.16	0.00
261	000598	兴蓉环境	4,300	20,640.00	0.00
262	002028	思源电气	1,000	20,060.00	0.00
263	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
264	600998	九州通	1,100	19,976.00	0.00
265	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
266	600987	航民股份	3,400	19,482.00	0.00
267	002327	富安娜	2,500	19,150.00	0.00
268	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
269	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
270	002299	圣农发展	700	18,578.00	0.00
271	600522	中天科技	1,700	18,428.00	0.00
272	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
273	603035	常熟汽饰	1,300	17,524.00	0.00
274	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
275	300132	青松股份	900	16,911.00	0.00
276	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
277	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
278	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
279	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
280	300682	朗新科技	1,100	16,082.00	0.00
281	601137	博威合金	1,400	16,072.00	0.00
282	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
283	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
284	002645	华宏科技	1,700	15,436.00	0.00
285	603515	欧普照明	500	15,105.00	0.00
286	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
287	300114	中航电测	1,000	14,950.00	0.00
288	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
289	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00

290	002396	星网锐捷	600	13,836.00	0.00
291	300260	新莱应材	800	13,424.00	0.00
292	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
293	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
294	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
295	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
296	002916	深南电路	100	10,806.00	0.00
297	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
298	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
299	600582	天地科技	3,000	9,240.00	0.00
300	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
301	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
302	002241	歌尔股份	239	8,919.48	0.00
303	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
304	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
305	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
306	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00
307	300226	上海钢联	80	5,248.00	0.00
308	002869	金溢科技	150	5,034.00	0.00
309	002912	中新赛克	60	3,477.60	0.00
310	300685	艾德生物	39	3,051.75	0.00
311	300118	东方日升	91	2,623.53	0.00
312	603568	伟明环保	110	2,082.30	0.00
313	603609	禾丰牧业	100	1,182.00	0.00
314	000975	银泰黄金	116	998.76	0.00
315	600720	祁连山	67	909.86	0.00
316	300138	晨光生物	35	670.25	0.00
317	002050	三花智控	18	443.70	0.00

注：根据浙江华峰氨纶股份有限公司于 2021 年 1 月 4 日发布的《关于公司名称及经营范围变更完成的公告》，经公司申请，并经深圳证券交易所核准，公司证券简称于 2021 年 1 月 4 日起由“华峰氨纶”变更为“华峰化学”，证券代码不变，仍为“002064”。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	157,153,277.25	6.59
2	600036	招商银行	109,357,828.18	4.58

3	601318	中国平安	95,403,782.57	4.00
4	600030	中信证券	81,172,548.94	3.40
5	002415	海康威视	67,816,285.83	2.84
6	300059	东方财富	67,436,872.44	2.83
7	000333	美的集团	61,172,175.23	2.56
8	000651	格力电器	52,325,276.47	2.19
9	601166	兴业银行	51,983,405.22	2.18
10	000002	万科 A	50,034,094.07	2.10
11	601688	华泰证券	50,025,452.88	2.10
12	002594	比亚迪	49,938,857.82	2.09
13	000858	五粮液	49,506,716.56	2.07
14	600276	恒瑞医药	49,019,256.10	2.05
15	000338	潍柴动力	47,300,857.00	1.98
16	600887	伊利股份	43,721,025.55	1.83
17	600048	保利地产	41,087,675.91	1.72
18	00700	腾讯控股	40,019,030.00	1.68
19	000001	平安银行	39,593,445.93	1.66
20	000661	长春高新	37,764,316.00	1.58

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	65,589,497.98	2.75
2	600036	招商银行	64,773,514.52	2.71
3	600519	贵州茅台	60,240,840.39	2.52
4	601688	华泰证券	50,170,592.72	2.10
5	002415	海康威视	48,690,078.16	2.04
6	300059	东方财富	46,377,131.26	1.94
7	000338	潍柴动力	43,942,217.03	1.84
8	688981	中芯国际	42,767,728.08	1.79
9	600276	恒瑞医药	40,029,739.08	1.68
10	002241	歌尔股份	38,957,173.30	1.63
11	000858	五粮液	37,806,184.99	1.58
12	000333	美的集团	36,477,363.89	1.53
13	002007	华兰生物	35,084,259.22	1.47
14	000568	泸州老窖	34,215,008.40	1.43
15	002594	比亚迪	33,577,481.20	1.41
16	601398	工商银行	31,972,690.00	1.34
17	600585	海螺水泥	31,175,314.48	1.31

18	000651	格力电器	31,073,488.64	1.30
19	000661	长春高新	29,440,102.83	1.23
20	601318	中国平安	29,092,016.90	1.22

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	4,702,489,516.88
卖出股票的收入（成交）总额	3,694,522,845.81

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。

8.5 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	95,030,433.70	3.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	38,127,800.00	1.60
	其中：政策性金融债	38,127,800.00	1.60
4	企业债券	20,227,000.00	0.85
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	166,458,607.98	6.98
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	319,843,841.68	13.41

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	69,993,000.00	2.93

2	110059	浦发转债	652,920	66,467,256.00	2.79
3	160206	16 国开 06	200,000	20,018,000.00	0.84
4	110226	11 国开 26	180,000	18,109,800.00	0.76
5	132007	16 凤凰 EB	164,440	16,935,675.60	0.71

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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
IC2103	IC2103	5.00	6,251,400.00	-21,840.00	-
IF2103	IF2103	-841.00	-1,314,886,680.00	-102,847,137.69	-
IF2106	IF2106	-48.00	-74,419,200.00	-9,202,011.43	-
公允价值变动总额合计					-112,070,989.12
股指期货投资本期收益					-371,392,377.12
股指期货投资本期公允价值变动					-112,070,989.12

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。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。

本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活

跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 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 1,595,276,211.58 元，占基金资产净值的比例为 66.86%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-1,383,054,480.00 元，占基金资产净值的比例为-57.97%，空头合约市值占股票资产的比例为-86.70%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为-6,182,427.26 元，公允价值变动损益为 135,964,710.58 元。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 报告期内本基金投资的浦发转债（110059）的发行人因未按专营部门制规定开展同业业务，同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目，为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保，未按规定进行贷款资金支付管理与控制，通过票据转贴现业务调节信贷规模，办理无真实贸易背景的贴现业务，未按权限和程序办理委托贷款业务等违规行为，于 2020 年 8 月 10 日被中国银行保险监督管理委员会上海监管局责令改正、并处以罚款 2100 万元。

对该证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为全国性大型银行，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。

报告期内本基金投资的兴业银行（601166），作为债务融资工具主承销商，因在债务融资工具存续期间未能对京粮集团资产无偿划转重大事项进行有效监测，及时督导京粮集团进行存续期重大事项披露，也未及时召开持有人会议，于 2020 年 5 月 15 日被中国银行间市场交易商协会责令整改。因同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权等违规行为，于 2020 年 8 月 31

日被中国银保监会福建监管局没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元。因为无证机构提供转接清算服务、为支付机构超范围经营提供支付服务、违规连通上下游支付机构提供转接清算服务等，且上述违规行为未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定等行为，于 2020 年 9 月 4 日被中国人民银行福州中心支行给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款。

对该证券的投资决策程序的说明：公司资产质量夯实稳健，拨备相对充足，信用成本保持较低水平且相对稳定；整体息差未来在经营转型深化和资产负债结构改善下具备提升的空间。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。

其余八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。

8.13.2 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。

8.13.3 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	175,480,400.60
2	应收证券清算款	15,381,647.96
3	应收股利	-
4	应收利息	3,654,615.27
5	应收申购款	30,100,730.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	224,617,394.19

8.13.4 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	110059	浦发转债	66,467,256.00	2.79
2	132007	16 凤凰 EB	16,935,675.60	0.71
3	128112	歌尔转 2	15,993,000.00	0.67
4	132009	17 中油 EB	14,954,455.60	0.63

5	132015	18 中油 EB	7,545,000.00	0.32
6	127015	希望转债	2,635,664.80	0.11
7	110065	淮矿转债	2,522,000.00	0.11
8	127012	招路转债	2,453,635.00	0.10
9	110045	海澜转债	2,423,000.00	0.10
10	110064	建工转债	1,948,572.60	0.08
11	113014	林洋转债	1,898,505.00	0.08
12	132004	15 国盛 EB	1,512,300.00	0.06
13	113505	杭电转债	1,232,500.00	0.05
14	110033	国贸转债	1,186,900.00	0.05
15	110048	福能转债	1,124,000.00	0.05
16	113532	海环转债	1,087,680.00	0.05
17	110034	九州转债	1,051,020.00	0.04
18	113017	吉视转债	966,900.00	0.04
19	128037	岩土转债	963,600.00	0.04
20	128044	岭南转债	955,185.00	0.04
21	110068	龙净转债	875,330.00	0.04
22	113024	核建转债	801,771.00	0.03
23	113012	骆驼转债	716,365.00	0.03
24	127016	鲁泰转债	715,160.34	0.03
25	128081	海亮转债	713,880.00	0.03
26	113519	长久转债	597,861.00	0.03
27	127013	创维转债	554,109.60	0.02
28	128087	孚日转债	534,117.50	0.02
29	113030	东风转债	524,750.00	0.02
30	113026	核能转债	517,050.00	0.02
31	113564	天目转债	486,760.00	0.02
32	128064	司尔转债	471,580.00	0.02
33	128071	合兴转债	469,980.00	0.02
34	113525	台华转债	458,820.00	0.02
35	128107	交科转债	431,920.00	0.02
36	128010	蔚蓝转债	413,070.00	0.02
37	113508	新风转债	396,375.00	0.02
38	113530	大丰转债	395,640.00	0.02
39	123049	维尔转债	333,600.00	0.01
40	113534	鼎胜转债	330,480.00	0.01
41	110041	蒙电转债	327,270.00	0.01
42	113021	中信转债	315,630.00	0.01
43	113025	明泰转债	255,340.00	0.01
44	128083	新北转债	211,940.00	0.01
45	110038	济川转债	209,900.00	0.01
46	110052	贵广转债	202,300.00	0.01
47	128032	双环转债	196,060.00	0.01
48	110051	中天转债	143,088.00	0.01

49	127011	中鼎转 2	120,550.00	0.01
50	113034	滨化转债	116,830.00	0.00
51	110047	山鹰转债	106,830.00	0.00
52	128101	联创转债	106,410.00	0.00
53	127014	北方转债	104,520.00	0.00
54	123004	铁汉转债	99,290.00	0.00
55	128018	时达转债	35,833.00	0.00
56	110069	瀚蓝转债	1,336.50	0.00

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000333	美的集团	19,052,000.00	0.80	大宗交易

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
海富通安益对冲混合 A	6,156	361,209.75	1,847,482,909.08	83.08%	376,124,323.37	16.92%
海富通安益对冲混合 C	703	116,119.13	34,237,978.12	41.94%	47,393,766.89	58.06%
合计	6,859	336,089.66	1,881,720,887.20	81.63%	423,518,090.26	18.37%

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)。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	海富通安益对冲混合 A	2,259,820.19	0.1016%
	海富通安益对冲混合 C	278,281.96	0.3409%
	合计	2,538,102.15	0.1101%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	10~50
	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

§ 10 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末基金总申购份额	1,834,629,599.06	342,541,825.82
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	1,970,359,202.87	659,697,761.55
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	2,223,607,232.45	81,631,745.01

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、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、2020 年 7 月 25 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，分别聘请孙海忠先生、胡光涛先生担任公司副总经理职务。

4、2020 年 8 月 11 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四次会议审议通过，奚万荣先生不再担任公司督察长职务，并决定由公司董事长杨仓兵先生代为履行督察长职务，代为履行督察长职务的期限不超过 90 日。

5、2020 年 8 月 22 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四次会议审议通过，聘请岳冲先生担任公司督察长职务，公司董事长杨仓兵先生不再代行督察长职务。

6、2020 年 11 月 11 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二十七次临时会议审议通过，孙海忠先生不再担任公司副总经理职务。

7、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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内改聘毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金审计的会计师事务所，并依法履行了公告手续。报告期内本基金应支付给所聘任会计师事务所的报酬为 65,000.00 元，该审计机构已为本基金提供审计服务的连续年限为 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	2,215,898,162.37	26.59%	1,927,245.89	28.88%	-
长江证券	1	1,553,566,140.63	18.64%	1,279,301.76	19.17%	-
国元证券	1	1,009,573,103.35	12.11%	826,157.60	12.38%	-
光大证券	1	1,006,045,676.16	12.07%	780,782.46	11.70%	-
国金证券	1	636,331,259.90	7.63%	452,625.17	6.78%	-
太平洋证券	2	571,764,750.58	6.86%	406,989.43	6.10%	-
华创证券	1	551,639,553.55	6.62%	417,410.19	6.25%	-
申万宏源(原申万)	1	313,303,271.69	3.76%	237,870.20	3.56%	-
国泰君安	2	309,495,298.97	3.71%	223,739.89	3.35%	-
兴业证券	1	119,884,774.80	1.44%	87,715.57	1.31%	-
招商证券	1	47,356,066.60	0.57%	33,684.55	0.50%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金减少国元证券一个券商交易单元。

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主观性评议，形成证券公司交易单元租用意见。

(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，形成证券公司交易单元租用意见，并报公司总经理办公会核准。

<2> 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核准。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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	197,242,675.90	21.99%	13,309,100,000.00	63.03%	-	-
长江证券	233,234,390.59	26.00%	3,011,200,000.00	14.26%	-	-
国元证券	163,163,826.70	18.19%	4,524,400,000.00	21.43%	-	-
光大证券	34,603,053.35	3.86%	-	-	-	-
国金证券	21,657,296.69	2.41%	-	-	-	-
太平洋证券	51,667,241.30	5.76%	-	-	-	-
华创证券	4,580,951.41	0.51%	-	-	-	-
申万宏源(原申万)	23,069,611.24	2.57%	45,000,000.00	0.21%	-	-
国泰君安	151,643,751.22	16.90%	195,000,000.00	0.92%	-	-
兴业证券	16,304,014.30	1.82%	30,000,000.00	0.14%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海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	2020-01-15
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	2020-03-02

		站	
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基金恢复申购、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	2020-05-11
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
29	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	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	2020-07-01
30	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	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	2020-07-08
31	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	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	2020-07-11
32	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中山证券有限责任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	2020-07-13
33	海富通基金管理有限公司关于高级管理	证券时报、基金管理	2020-07-25

	人员变更的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
34	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	2020-07-25
35	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	2020-08-11
36	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	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	2020-08-13
37	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	2020-08-22
38	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国联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	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	2020-08-26
39	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	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	2020-08-26
40	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	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	2020-09-11
41	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	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	2020-09-11
42	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	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	2020-09-15
43	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行招赢通为销售平台的公告	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	2020-09-16
44	海富通基金管理有限公司关于网上直销开通汇款交易业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会	2020-09-17

		会基金电子披露网站	
45	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中国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	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	2020-09-19
46	海富通基金管理有限公司关于进一步提请投资者及时提供或更新身份信息以免影响业务办理的公告	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	2020-09-24
47	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加招商银行股份有限公司旗下招赢通平台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	2020-09-26
48	海富通基金管理有限公司关于旗下基金获配捷昌驱动（603583）非公开发行 A 股的公告	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	2020-10-22
49	海富通基金管理有限公司关于进一步提请投资者及时提供或更新身份信息以免影响业务办理的公告	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	2020-10-24
50	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增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	2020-10-28
51	海富通基金管理有限公司关于网上直销汇款交易业务开展费率优惠的公告	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	2020-10-29
52	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	2020-11-05
53	海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购和转换转入业务的公告	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	2020-11-05
54	海富通基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	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	2020-11-11
55	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	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	2020-11-18

		站	
56	海富通基金管理有限公司关于旗下基金获配仙琚制药（002332）非公开发行 A 股的公告	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	2020-12-01
57	海富通基金管理有限公司关于进一步提请投资者及时提供或更新身份信息以免影响业务办理的公告	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	2020-12-01
58	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并相应修订基金合同及托管协议的公告	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	2020-12-01
59	海富通基金管理有限公司关于旗下基金获配日月股份（603218）非公开发行 A 股的公告	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	2020-12-03
60	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	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	2020-12-05
61	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海长量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	2020-12-16
62	海富通基金管理有限公司关于旗下基金获配天山铝业（002532）非公开发行 A 股的公告	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	2020-12-25
63	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司为销售机构的公告	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	2020-12-31

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		区间					
机构	1	2020/8/4-2020 /12/31	650,9 06,83 7.98	-	150,000 ,000.00	500,906,83 7.98	21.73%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；</p> <p>2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。</p> <p>3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> <p>4、其他可能的风险。</p> <p>另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。</p>							

12.2 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 92 只公募基金。截至 2020 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1251 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”。

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 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。

13.3 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
二〇二一年三月三十一日