

海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金
2021 年第 2 季度报告
2021 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年七月二十一日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 20 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 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,848,100,785.42 份 |
| 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。 | |
| 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 | |
| 下属两级基金的基金简称 | 海富通安益对冲混合 A | 海富通安益对冲混合 C |
| 下属两级基金的交易代码 | 008831 | 008830 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 1,592,950,280.64 份 | 255,150,504.78 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 (2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日) | |
|----------------|---|----------------|
| | 海富通安益对冲混合 A | 海富通安益对冲混合 C |
| 1.本期已实现收益 | 99,780,011.94 | 6,460,624.94 |
| 2.本期利润 | 4,613,605.99 | 1,425,956.78 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0028 | 0.0111 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,679,311,498.40 | 267,373,108.64 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0542 | 1.0479 |

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。

3.2 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、海富通安益对冲混合 A：

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益 | 业绩比较基准收益 | ①—③ | ②—④ |
|----|--------|----------|----------|----------|-----|-----|
| | | | | | | |

| | | ② | 率③ | 率标准差 ④ | | |
|------------|-------|-------|-------|-----------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.20% | 0.31% | 0.68% | 0.01% | -0.48% | 0.30% |
| 过去六个月 | 1.85% | 0.48% | 1.35% | 0.01% | 0.50% | 0.47% |
| 过去一年 | 3.08% | 0.41% | 2.75% | 0.01% | 0.33% | 0.40% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.42% | 0.36% | 3.99% | 0.01% | 1.43% | 0.35% |

2、海富通安益对冲混合 C:

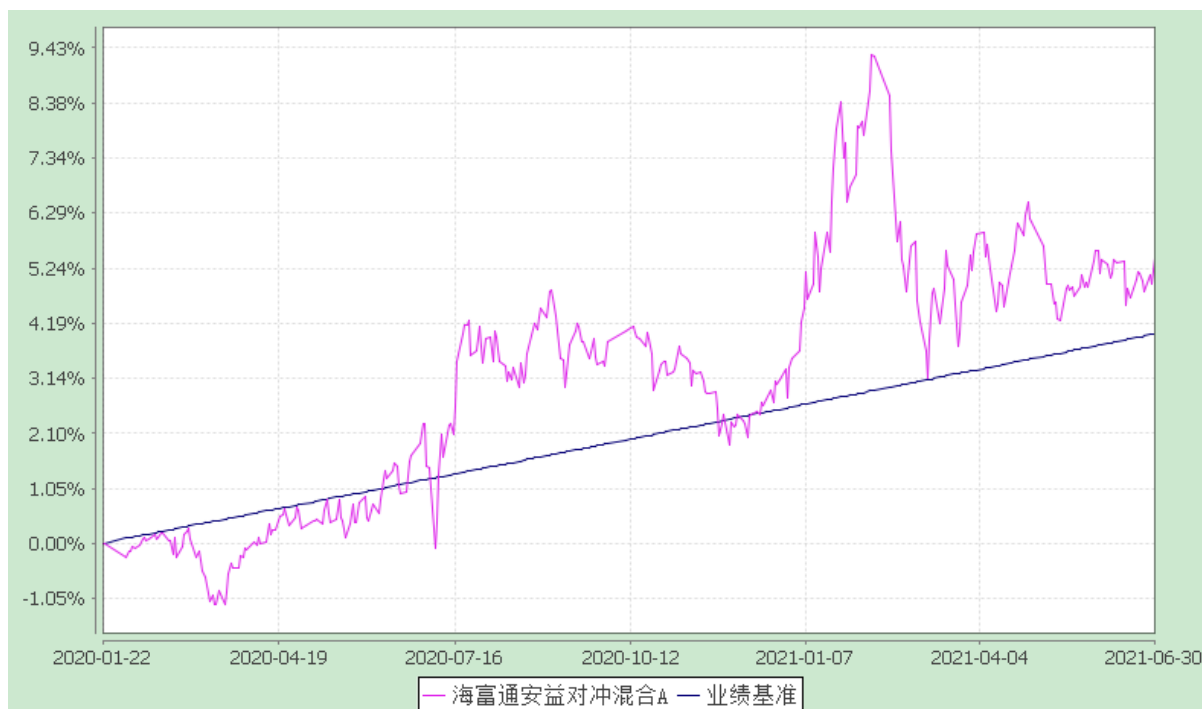
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.10% | 0.31% | 0.68% | 0.01% | -0.58% | 0.30% |
| 过去六个月 | 1.64% | 0.48% | 1.35% | 0.01% | 0.29% | 0.47% |
| 过去一年 | 2.65% | 0.41% | 2.75% | 0.01% | -0.10% | 0.40% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.79% | 0.36% | 3.99% | 0.01% | 0.80% | 0.35% |

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

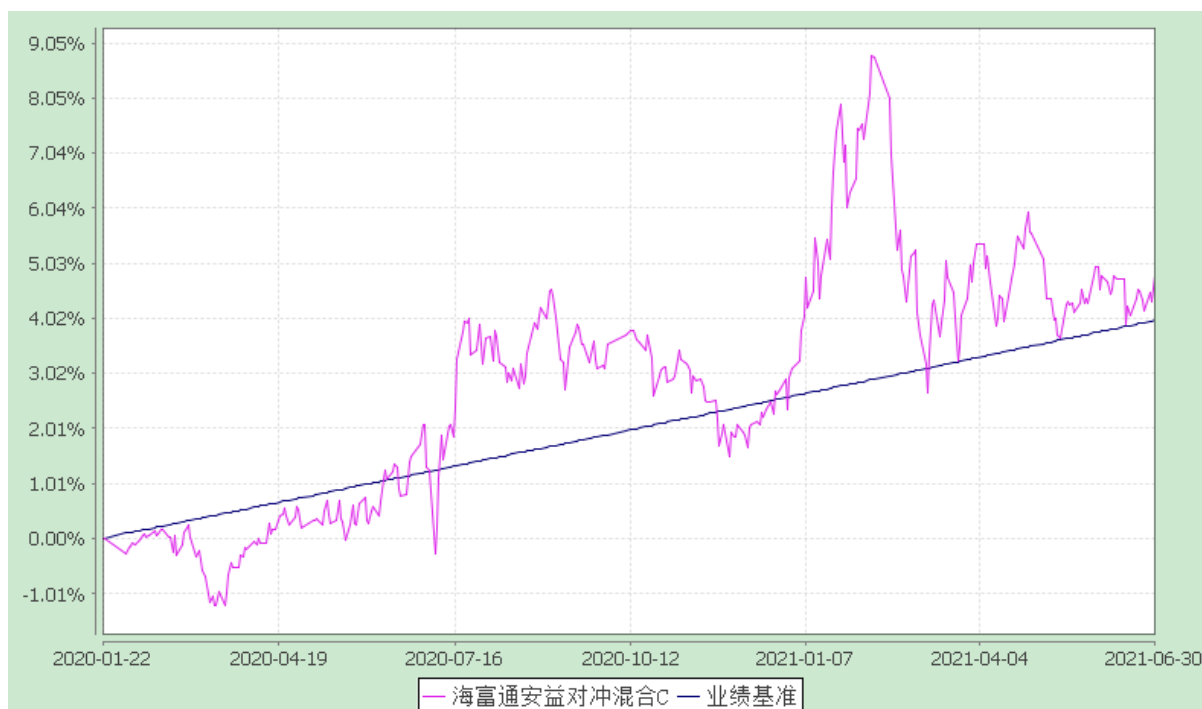
1. 海富通安益对冲混合 A

(2020 年 1 月 22 日至 2021 年 6 月 30 日)



2. 海富通安益对冲混合 C

(2020 年 1 月 22 日至 2021 年 6 月 30 日)



注：本基金合同于 2020 年 1 月 22 日生效。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； 量化投资部总监。 | 2020-01-22 | - | 21 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

2021 年二季度，全球市场在新冠疫情后整体走牛，由于疫苗接种以及大规模的财政刺激，二季度美国经济持续恢复，随着美债收益率震荡走弱，市场流动性预期转向宽松。国内消费仍未完全恢复到疫情前的水平，出口也面临不确定性，就业压力仍大，二季度货币政策继续维持“稳健中性”的操作风格，市场流动性也保持“量平价稳”的特征。

在流动性泛滥、各大经济体逐步复工复产的背景下，二季度全球权益市场均表现出较强走势。具体来看，2021 年二季度沪深 300 指数、科创 50 指数、中小 100 指数、创业板指等主要指数涨幅分别达到 3.48%、27.23%、11.29%、26.05%。就行业表现而言，28 个申万一级行业表现分化显著。二季度涨幅居前五位的行业分别是电气设备、电子、汽车、综合、化工，涨幅分别为 30.70%、21.22%、18.99%、17.54% 和 16.78%。与之相比，家用电器、农林牧渔、房地产、公共事业、建筑材料表现最差，其中家用电器跌幅最惨为-8.51%。

从二季度 A 股内部的结构看，业绩高确定和较高增长的资产获得了市场的追捧。二季度行情主要集中在医药和科技两个方向，包括医美、CXO 为代表的医药板块，以及新能源车、光伏和半导体、物联网等中国经济转型升级的科技板块。而传统经济领域的家电、房地产、非银和银行等防御性的板块持续表现低迷。

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 3 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，海富通安益对冲混合 A 净值增长率为 0.20%，同期业绩比较基准收益率为 0.68%，基金净值跑输业绩比较基准 0.48 个百分点；海富通安益对冲混合 C 净值增长率为 0.10%，同期业绩比较基准收益率为 0.68%，基金净值跑输业绩比较基准 0.58 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 | 1,218,590,381.63 | 61.77 |
| | 其中：股票 | 1,218,590,381.63 | 61.77 |
| 2 | 固定收益投资 | 122,203,177.00 | 6.19 |
| | 其中：债券 | 122,203,177.00 | 6.19 |
| | 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 | - | - |
| | 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 | 484,866,989.13 | 24.58 |
| 7 | 其他资产 | 147,277,892.36 | 7.46 |
| 8 | 合计 | 1,972,938,440.12 | 100.00 |

注：本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为54,115,654.14元，占资产净值比例为2.78%；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为25,046,649.76元，占资产净值比例为1.29%。

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 | 2,338,136.97 | 0.12 |
| B | 采矿业 | 21,003,939.37 | 1.08 |
| C | 制造业 | 782,021,724.26 | 40.17 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 7,084,880.39 | 0.36 |
| E | 建筑业 | 2,522,506.44 | 0.13 |
| F | 批发和零售业 | 4,787,167.98 | 0.25 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|------------------|-------|
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 45,189,734.04 | 2.32 |
| J | 金融业 | 189,562,390.60 | 9.74 |
| K | 房地产业 | 19,903,467.50 | 1.02 |
| L | 租赁和商务服务业 | 22,123,490.00 | 1.14 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 25,333,285.88 | 1.30 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 899,031.30 | 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 | 9,444,263.00 | 0.49 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 7,214,060.00 | 0.37 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,139,428,077.73 | 58.53 |

5.2.2 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（%） |
|----------|---------------|--------------|
| 非日常生活消费品 | 11,323,776.72 | 0.58 |
| 日常消费品 | 834,742.66 | 0.04 |
| 金融 | 20,740,802.18 | 1.07 |
| 医疗保健 | 8,969,822.40 | 0.46 |
| 信息技术 | 23,298,240.00 | 1.20 |
| 通信服务 | 13,994,919.94 | 0.72 |
| 合计 | 79,162,303.90 | 4.07 |

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

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 | 600519 | 贵州茅台 | 22,890 | 47,077,863.00 | 2.42 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 775,000 | 41,997,250.00 | 2.16 |
| 3 | 000858 | 五粮液 | 135,923 | 40,490,102.47 | 2.08 |
| 4 | 603259 | 药明康德 | 160,852 | 25,187,814.68 | 1.29 |
| 5 | 000333 | 美的集团 | 344,610 | 24,594,815.70 | 1.26 |
| 6 | 300059 | 东方财富 | 693,100 | 22,726,749.00 | 1.17 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 7 | 002142 | 宁波银行 | 552,900 | 21,546,513.00 | 1.11 |
| 8 | 000001 | 平安银行 | 949,900 | 21,486,738.00 | 1.10 |
| 9 | 601888 | 中国中免 | 70,400 | 21,127,040.00 | 1.09 |
| 10 | 601012 | 隆基股份 | 234,912 | 20,869,582.08 | 1.07 |

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 | 79,554,000.00 | 4.09 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 10,174,000.00 | 0.52 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 2,544,177.00 | 0.13 |
| 8 | 同业存单 | 29,931,000.00 | 1.54 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 122,203,177.00 | 6.28 |

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 | 019640 | 20 国债 10 | 795,540 | 79,554,000.00 | 4.09 |
| 2 | 112183748 | 21 云南红塔银行 CD040 | 300,000 | 29,931,000.00 | 1.54 |
| 3 | 143178 | 17 杭金 01 | 100,000 | 10,174,000.00 | 0.52 |
| 4 | 113050 | 南银转债 | 16,090 | 1,609,000.00 | 0.08 |
| 5 | 127036 | 三花转债 | 1,706 | 223,468.94 | 0.01 |

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 |
|-------------------|--------|---------|-----------------|----------------|-----------------|
| IF2112 | IF2112 | -149.00 | -229,766,940.00 | -8,628,060.00 | - |
| IC2109 | IC2109 | -73.00 | -97,338,200.00 | -4,898,844.44 | - |
| IF2109 | IF2109 | -458.00 | -709,863,360.00 | -35,784,059.93 | - |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | -49,310,964.37 |
| 股指期货投资本期收益(元) | | | | | 57,795,864.38 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | -129,024,884.38 |

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。

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，本基金不参与国债期货交易。

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，本基金不参与国债期货交易。

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 1,218,590,381.63 元，占基金资产净值的比例为 62.60%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-1,036,968,500.00 元，占基金资产净值的比例为-53.27%，空头合约市值占股票资产的比例为-85.10%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 114,048,632.57 元，公允价值变动损益为-100,877,975.84 元。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 报告期内本基金投资的宁波银行（002142），作为债务融资工具主承销商，因以不正当手段承揽业务、发行工作程序执行不到位，未按照规定开展询价等工作，于2020年12月31日被中国银行间市场交易商协会处以警告、暂停其债务融资工具相关业务2个月的处罚，暂停业务期间，宁波银行不得担任债务融资工具簿记管理人，并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：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平安银行（000001），因贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等违规行为，于2020年10月16日被宁波银保监局处罚罚款人民币100万元。对该证券的投资决策程序的说明：公司资产质量向好，对公不良继续下降，零售转型再进新阶，成果显著。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招商银行（600036），因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品、理财产品之间风险隔离不到位等多项违规行为，于2021年05月17日被中国银行保险监督管理委员会处以罚款7170万元。对该证券的投资决策程序的说明：公司是中国境内第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行。2021年存款结构进一步优化，活期存款占比进一步提升。资产端，高收益资产占比进一步提升。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。其余七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 | 129,098,195.96 |
| 2 | 应收证券清算款 | 15,615,366.88 |
| 3 | 应收股利 | 73,640.00 |
| 4 | 应收利息 | 2,444,437.35 |
| 5 | 应收申购款 | 46,252.17 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 147,277,892.36 |

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 | 128037 | 岩土转债 | 214,860.00 | 0.01 |
| 2 | 132022 | 20 广版 EB | 156,421.20 | 0.01 |
| 3 | 113525 | 台华转债 | 110,280.00 | 0.01 |
| 4 | 113039 | 嘉泽转债 | 57,255.00 | 0.00 |
| 5 | 127020 | 中金转债 | 8,885.70 | 0.00 |
| 6 | 127025 | 冀东转债 | 2,246.37 | 0.00 |
| 7 | 123071 | 天能转债 | 2,093.58 | 0.00 |
| 8 | 123083 | 朗新转债 | 1,105.83 | 0.00 |
| 9 | 127022 | 恒逸转债 | 614.00 | 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

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§6 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 |
|---------------|------------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,774,052,127.46 | 111,492,440.91 |
| 本报告期基金总申购份额 | 244,959,156.65 | 193,374,752.84 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 426,061,003.47 | 49,716,688.97 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,592,950,280.64 | 255,150,504.78 |

§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

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 |
|------------------------------|---------------|------------|
| 报告期期初管理人持有的本 基金份额 | 49,218,738.86 | - |
| 本报告期买入/申购总份额 | - | - |
| 本报告期卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本 基金份额 | 49,218,738.86 | - |
| 报告期期末持有的本基金份 额占基金总份额比例（%） | 3.09 | - |

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
|----|----|------------------------|----------------|------|----------------|----------------|--------|
| 机构 | 1 | 2021/4/1-2021/6/30 | 399,999,000.00 | - | - | 399,999,000.00 | 21.64% |
| | 2 | 2021/4/1-2021/6/17 | 500,906,837.98 | - | 157,120,000.00 | 343,786,837.98 | 18.60% |

产品特有风险

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：

- 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；
- 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。
- 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。
- 4、其他可能的风险。

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。

8.2 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 99 只公募基金。截至 2021 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1296 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”。

§9 备查文件目录

9.1 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他文件

9.2 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。

9.3 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
二〇二一年七月二十一日