

海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金
2021 年中期报告
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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	59
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	60
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	60
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	60
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
7.12 市场中性策略执行情况.....	61
7.13 投资组合报告附注.....	61
§8 基金份额持有人信息	62

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	63
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	63
9 开放式基金份额变动	64
§10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息	69
§12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金	
基金简称	海富通阿尔法对冲混合	
基金主代码	519062	
交易代码	519062	
基金运作方式	契约型、发起式、开放式	
基金合同生效日	2014 年 11 月 20 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	6,081,928,939.15 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C
下属分级基金的交易代码	519062	008795
报告期末下属分级基金的份额总额	5,913,300,540.02 份	168,628,399.13 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	许俊
	联系电话	021-38650788	010-66594319
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942

注册地址	上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦 36-37层	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦 36-37层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	杨仓兵	刘连舸

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021年1月1日至2021年6月30日）	
	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C
本期已实现收益	403,868,492.06	10,887,950.20
本期利润	152,058,933.35	2,731,713.70
加权平均基金份额本期利润	0.0204	0.0153
本期加权平均净值利润率	1.74%	1.30%
本期基金份额净值增长率	1.38%	1.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C
期末可供分配利润	694,578,390.38	18,679,102.32
期末可供分配基金份额利润	0.1175	0.1108
期末基金资产净值	6,934,194,707.98	196,643,198.94
期末基金份额净值	1.173	1.166
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	

	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C
基金份额累计净值增长率	62.37%	4.11%

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

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通阿尔法对冲混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.09%	0.30%	0.22%	0.01%	-0.31%	0.29%
过去三个月	-0.09%	0.32%	0.68%	0.01%	-0.77%	0.31%
过去六个月	1.38%	0.50%	1.35%	0.01%	0.03%	0.49%
过去一年	1.03%	0.42%	2.75%	0.01%	-1.72%	0.41%
过去三年	13.07%	0.32%	8.49%	0.01%	4.58%	0.31%
自基金合同生效起至今	62.37%	0.34%	20.55%	0.01%	41.82%	0.33%

海富通阿尔法对冲混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.17%	0.28%	0.22%	0.01%	-0.39%	0.27%
过去三个月	-0.26%	0.31%	0.68%	0.01%	-0.94%	0.30%
过去六个月	1.13%	0.50%	1.35%	0.01%	-0.22%	0.49%
过去一年	0.60%	0.42%	2.75%	0.01%	-2.15%	0.41%
自基金合同生效起至今	4.11%	0.38%	3.98%	0.01%	0.13%	0.37%

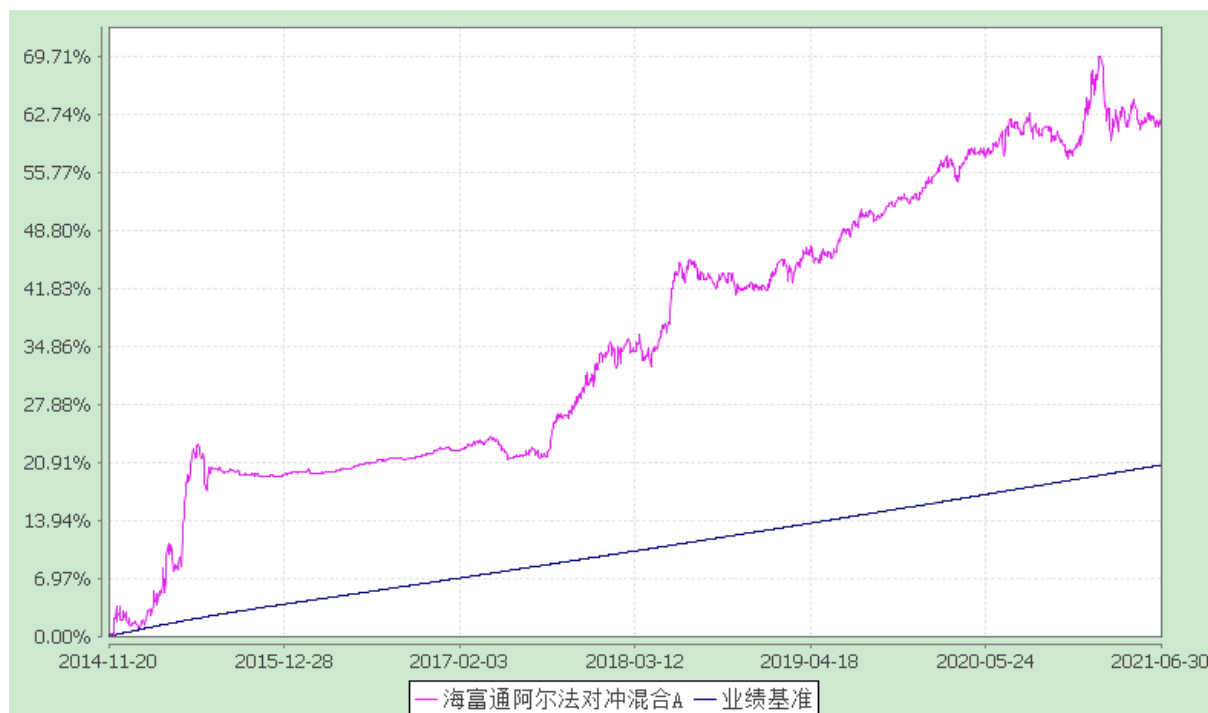
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金

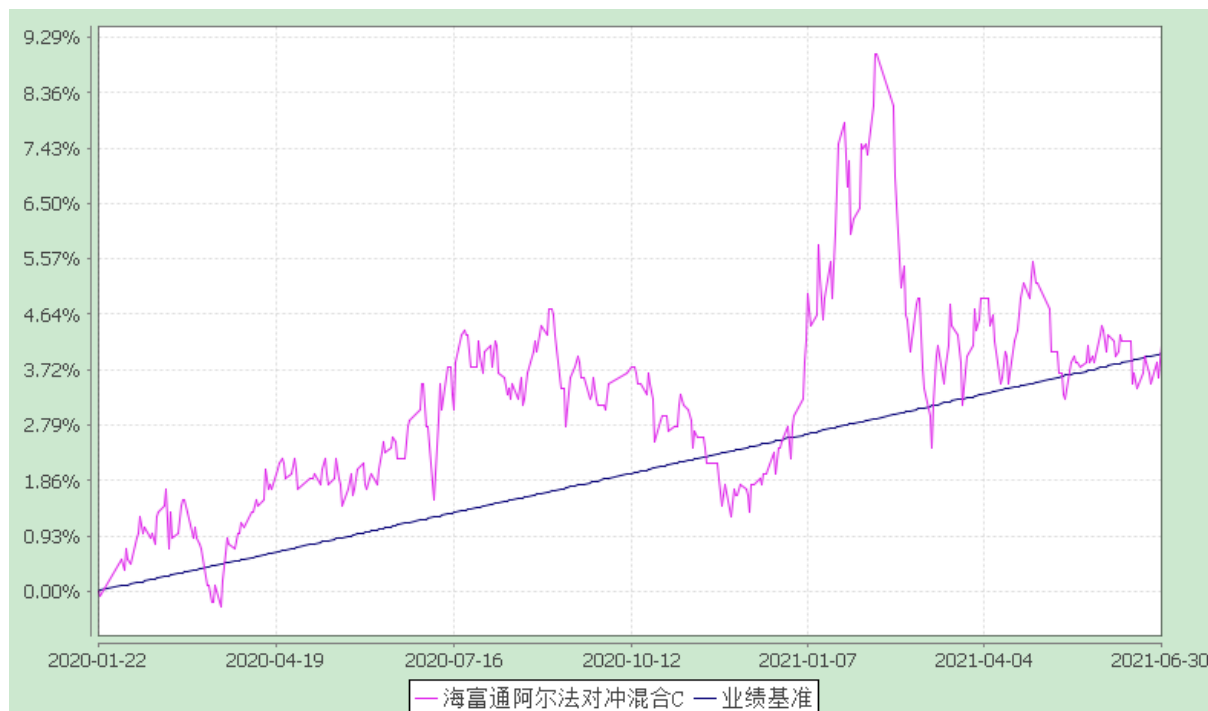
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014 年 11 月 20 日至 2021 年 6 月 30 日)

海富通阿尔法对冲混合 A



海富通阿尔法对冲混合 C



注：本基金合同于 2014 年 11 月 20 日生效，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。本基金于 2020 年 1 月 21 日发

布公告，自 2020 年 1 月 22 日起增加一种新的收费模式份额-C 类基金份额。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 87 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、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、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金。

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；量化投资部总监。	2018-04-09	-	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量化分析师、高级量化分析师、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。
朱斌全	本基金的基金经理	2018-11-30	-	14年	硕士,持有基金从业人员资格证书。2005年7月至2006年8月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交易员。2007年4月加入海富通基金管理有限公司,历任交易员、高级交易员、量化分析师、投资经理、基金经理助理。2018年11月起任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019年10月起兼任海富通富祥混合、海富通沪深300增强(原海富通富睿混合)、海富通量化多因子混合及海富通欣益混合的基金经理。2020年10月起兼任海富通欣享混合、海富通新内

					需混合的基金经理。
陈林海	本基金的基金经理助理。	2020-05-11	2021-04-30	9 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任上海从容投资管理有限公司研究员，华泰柏瑞基金管理有限公司研究员、高级研究员。2015 年 9 月加入海富通基金管理有限公司，历任股票分析师、高级股票分析师。2020 年 5 月至 2021 年 4 月任量化投资部的基金经理助理。2021 年 4 月起任海富通添鑫收益债券基金经理。

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、交易占比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，全球各大经济体从疫情中逐渐复苏，虽然路径有所曲折但经济活力显著增加。由于全球供应链还在恢复中，全球流动性释放充分，大宗商品价格涨幅最为显著。海外需求强劲但海运费用涨幅惊人，出口企业盈利增长受到相当制约。相对外需，国内需求稍显疲弱，日益上涨的原材料压缩中游制造业利润。消费服务业复苏态势确立但强度较弱，新经济（新消费）增长态势显著高于旧经济。资本市场担忧的全球货币紧缩在上半年没有得到应验。

市场整体走势如同 N 字型态势，风格出现明显变化。春节前，核心资产为主的“茅指数”领涨，春节后担心美债利率上行和货币政策转向，核心资产领跌。五月以来，十年期国债利率继续下行带来成长股反弹。尤其是降准以来，市场风格向成长板块继续偏移。上半年 A 股主要指数方面，上证指数上涨 3.40%，沪深 300 上涨 0.24%，中证 800 上涨 1.72%，中小综指上涨 5.19%，创业板指上涨 17.22%。分行业看，周期和医药行业领涨，钢铁、化工、煤炭、综合和医药分别上涨 26.34%、19.12%、18.33%、16.93% 和 16.10%；非银金融和军工通信明显落后，非银金融、国防军工、农林牧渔、通信和综合金融分别下跌 11.02%、8.46%、7.84%、3.35% 和 2.88%。

从上半年市场内部的结构看，周期和成长交相呼应成为市场两条主线。周期主线在一季度演绎得淋漓尽致，尤其在碳达峰的政策预期下，与此匹配的是相关行业上半年的业绩表现。同样是业绩靓丽的电动车产业链和半导体，五月以来行情同样演绎得如火如荼。消费领域除了医药 CXO 和次高端白酒，整体表现较弱。市场上半年赚钱效应明显，小盘股表现优于大盘股，核心资产相对疲弱。市场交易集中度有所下降，双创指数表现靓丽。整个市场反映出经济结构转型带来的红利，中国优势供应链成为市场配置热点。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通阿尔法对冲混合 A 净值增长率为 1.38%，同期业绩比较基准收益率为 1.35%，基金净值跑赢业绩比较基准 0.03 个百分点；海富通阿尔法对冲混合 C 净值增长率为 1.13%，同期业绩比较基准收益率为 1.35%，基金净值跑输业绩比较基准 0.22 个百分点。报告期内股票市场波动较大，导致基金跑输基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济复苏态势或依然延续，政策工具箱已经提前打开。经济韧性依旧，出口与地

产投资扩张趋势或可延续。货币政策预期可能更加平稳，对整个市场的影响或弱于上半年。当然，信用风险事件可能还会持续发生，流动性条件或与上半年相仿。

不管是周期还是成长，上半年的主线就是业绩（分子端）。上游原材料价格压力下半年依然明显，上游盈利或依然强于中游。产业趋势变化将是权益市场的主要驱动力。经济结构变化带来的红利较为确定，电动车、半导体、光伏等受益于政策导向的行业投资机会，或更加容易把握。行业格局较为良好的周期板块或可享受业绩增长带来的收益。

未来，本基金将继续在控制风险的基础上，积极寻找市场的机构性机会，力争跑赢市场。同时，基金依然会参与新股申购，努力增厚收益；本基金也将利用动态的仓位调整或者股指期货套保等风险管理工具来控制回撤风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	433,797,300.16	41,800,216.80
结算备付金		1,137,442,831.65	358,421,104.23
存出保证金		510,493,956.28	757,804,318.58
交易性金融资产	6.4.7.2	5,138,255,981.86	9,271,464,320.00
其中：股票投资		4,951,727,461.58	7,423,156,031.70
基金投资		-	-
债券投资		186,528,520.28	1,848,308,288.30

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		73,950,889.96	183,280,473.67
应收利息	6.4.7.5	5,388,444.84	23,412,020.70
应收股利		-	-
应收申购款		456,543.04	2,647,808.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		7,299,785,947.79	10,638,830,262.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		152,498,534.22	200,138,080.33
应付管理人报酬		9,368,795.14	14,430,878.93
应付托管费		1,561,465.81	2,405,146.48
应付销售服务费		65,922.70	89,786.95
应付交易费用	6.4.7.7	5,049,579.11	8,815,990.54
应交税费		4,562.40	79,028.91
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	399,181.49	663,772.42
负债合计		168,948,040.87	226,622,684.56
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	6,081,928,939.15	8,996,705,240.48
未分配利润	6.4.7.10	1,048,908,967.77	1,415,502,337.74
所有者权益合计		7,130,837,906.92	10,412,207,578.22
负债和所有者权益总计		7,299,785,947.79	10,638,830,262.78

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 6,081,928,939.15 份。其中海富通阿尔法对冲混合 A 类基金份额总额 5,913,300,540.02 份，基金份额净值 1.173 元；海富通阿尔法对冲混合 C 类基金份额总额 168,628,399.13 份，基金份额净值 1.166 元。

6.2 利润表

会计主体：海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		259,859,524.86	420,244,363.03
1.利息收入		21,683,159.24	32,735,746.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,338,318.33	20,542,923.92
债券利息收入		6,250,559.13	10,326,865.70
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,094,281.78	1,865,957.19
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		491,150,243.09	55,484,445.55
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,024,056,758.28	156,131,177.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-32,812,376.81	10,023,243.46
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-535,003,076.00	-168,365,766.83
股利收益	6.4.7.16	34,908,937.62	57,695,791.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-259,965,795.21	324,357,184.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	6,991,917.74	7,666,986.38
减：二、费用		105,068,877.81	80,893,196.06
1. 管理人报酬		66,919,364.28	56,971,223.84
2. 托管费		11,153,227.29	9,495,204.09
3. 销售服务费		416,844.35	496,153.62
4. 交易费用	6.4.7.19	26,389,893.75	13,459,600.73
5. 利息支出		7,218.89	2,623.21
其中：卖出回购金融资产支出		7,218.89	2,623.21
6.税金及附加		10,249.83	297,302.28
7. 其他费用	6.4.7.20	172,079.42	171,088.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		154,790,647.05	339,351,166.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		154,790,647.05	339,351,166.97

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	8,996,705,240.48	1,415,502,337.74	10,412,207,578.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	154,790,647.05	154,790,647.05
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）	-2,914,776,301.33	-521,384,017.02	-3,436,160,318.35
其中：1.基金申购款	1,216,821,071.21	215,005,852.21	1,431,826,923.42
2.基金赎回款	-4,131,597,372.54	-736,389,869.23	-4,867,987,241.77
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）	6,081,928,939.15	1,048,908,967.77	7,130,837,906.92
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,968,495,020.59	331,138,683.09	3,299,633,703.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	339,351,166.97	339,351,166.97
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	8,131,196,932.04	1,110,901,846.84	9,242,098,778.88
其中：1.基金申购款	10,223,030,967.04	1,382,111,626.10	11,605,142,593.14
2.基金赎回款	-2,091,834,035.00	-271,209,779.26	-2,363,043,814.26
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	11,099,691,952.63	1,781,391,696.90	12,881,083,649.53

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]895 号《关于准予海富通阿尔法对冲混合型发起式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《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 719,531,193.38 元。经向中国证监会备案,《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2014 年 11 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 719,877,758.17 份基金份额,其中认购资金利息折合 346,564.79 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、股指期货、权证、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%~120% 之间。在每个交易日日终持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 95%,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳

入投资范围。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2021 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 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。

6.4.3 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 6.4.2 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况、2021 上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(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。

(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。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	433,797,300.16
定期存款	-
其他存款	-
合计	433,797,300.16

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,405,285,575.97	4,951,727,461.58	546,441,885.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	186,367,001.68	186,528,520.28	161,518.60
	银行间市场	-	-	-
	合计	186,367,001.68	186,528,520.28	161,518.60
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,591,652,577.65	5,138,255,981.86	546,603,404.21

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-3,951,857,775.07	-	-	-
——股指期货	-3,951,857,775.07	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-3,951,857,775.07	-	-	-

注：于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货情况：持有卖出 IC2109 合约市值-229,344,800.00 元，公允价值变动-10,798,935.02 元；卖出 IF2108 合约市值-427,102,500.00 元，公允价值变动 585,840.00 元；卖出 IF2109 合约市值-2,715,459,840.00 元，公允价值变动-134,048,166.77 元；卖出 IF2112 合约市值-758,693,520.00 元，公允价值变动-34,481,623.14 元；公允价值变动合计-178,742,884.93 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	28,590.93
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	1,591,877.01
应收债券利息	3,766,262.98
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	630.41
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	1,083.51
合计	5,388,444.84

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	5,049,579.11
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,049,579.11

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	295,043.14
应付证券出借违约金	-
预提费用	104,138.35
合计	399,181.49

6.4.7.9 实收基金

海富通阿尔法对冲混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	8,797,483,734.76	8,797,483,734.76
本期申购	1,094,307,850.79	1,094,307,850.79
本期赎回（以“-”号填列）	-3,978,491,045.53	-3,978,491,045.53
本期末	5,913,300,540.02	5,913,300,540.02

海富通阿尔法对冲混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	199,221,505.72	199,221,505.72
本期申购	122,513,220.42	122,513,220.42
本期赎回（以“-”号填列）	-153,106,327.01	-153,106,327.01
本期末	168,628,399.13	168,628,399.13

注：1、申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

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

6.4.7.10 未分配利润

海富通阿尔法对冲混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	506,888,179.48	878,077,265.26	1,384,965,444.74
本期利润	403,868,492.06	-251,809,558.71	152,058,933.35
本期基金份额交易产生的变动数	-216,178,281.16	-299,951,928.97	-516,130,210.13
其中：基金申购款	63,097,259.90	130,587,372.97	193,684,632.87
基金赎回款	-279,275,541.06	-430,539,301.94	-709,814,843.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	694,578,390.38	326,315,777.58	1,020,894,167.96

海富通阿尔法对冲混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,670,322.83	19,866,570.17	30,536,893.00
本期利润	10,887,950.20	-8,156,236.50	2,731,713.70
本期基金份额交易产生的变动数	-2,879,170.71	-2,374,636.18	-5,253,806.89
其中：基金申购款	6,312,635.10	15,008,584.24	21,321,219.34
基金赎回款	-9,191,805.81	-17,383,220.42	-26,575,026.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,679,102.32	9,335,697.49	28,014,799.81

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	733,937.99
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	13,561,767.31
其他	42,613.03
合计	14,338,318.33

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	10,855,735,391.82
减：卖出股票成本总额	9,831,678,633.54
买卖股票差价收入	1,024,056,758.28

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,960,945,408.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,967,939,719.48
减：应收利息总额	25,818,065.43
买卖债券差价收入	-32,812,376.81

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益（税前）	-535,003,076.00
合计	-535,003,076.00

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	34,908,937.62
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	34,908,937.62

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-615,934,531.21
——股票投资	-643,360,115.75
——债券投资	27,425,584.54
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	355,968,736.00
——权证投资	-
——股指期货	355,968,736.00
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	-259,965,795.21

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	6,642,353.45
转换费收入	349,564.29
合计	6,991,917.74

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

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	26,389,618.75
银行间市场交易费用	275.00
合计	26,389,893.75

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	49,341.07
其他费用	600.00
债券托管账户维护费	18,000.00
合计	172,079.42

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
海通证券	2,240,120,695.80	11.89%	3,658,083,038.89	29.48%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的 比例
海通证券	1,610,896.88	12.18%	465,624.67	9.22%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的 比例
海通证券	2,641,270.02	35.49%	2,431,800.66	51.53%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	66,919,364.28	56,971,223.84
其中：支付销售机构的客户维护费	11,770,507.22	7,346,963.32

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	11,153,227.29	9,495,204.09

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C	合计
中国银行	-	12,296.89	12,296.89
海通证券	-	2,269.60	2,269.60
海富通基金	-	77,761.12	77,761.12
合计	-	92,327.61	92,327.61
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		

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

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	433,797,300.16	733,937.99	246,453,132.88	1,044,087.39

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券	300933	中辰股份	网下发行	11,117	37,464.29
海通证券	688680	海优新材	网下发行	2,795	195,482.30
海通证券	300940	南极光	网下发行	3,068	39,147.68
海通证券	688687	凯因科技	网下发行	5,354	101,618.92
海通证券	688665	四方光电	网下发行	1,687	49,817.11
海通证券	688092	爱科科技	网下发行	1,137	21,728.07
海通证券	688626	翔宇医疗	网下发行	3,652	105,250.64
海通证券	688630	芯碁微装	网下发行	3,397	51,736.31
海通证券	688682	霍莱沃	网下发行	946	43,251.12
海通证券	300981	中红医疗	网下发行	6,003	291,685.77
海通证券	688217	睿昂基因	网下发行	1,040	19,156.80
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券	300847	中船汉光	网下发行	1,421	9,861.74

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000661	长春高新	2021-05-20	2021-11-22	大宗交易	470.01	360.79	47,000	22,090,470.00	16,957,130.00	-
300702	天宇股份	2021-01-18	2021-07-20	非公开发行流通受限	80.95	34.49	222,360	9,999,996.35	7,669,196.40	2
300782	卓胜微	2021-04-30	2021-11-25	大宗交易	368.10	498.67	27,000	9,938,700.00	13,464,090.00	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股锁定流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股锁定流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	新股锁定流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定流通受限	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	新股锁定流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股锁定流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股锁定流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-

				流通受限						
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股锁定流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	新股锁定流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股锁定流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	3
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	新股锁定流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	新股锁定流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股锁定流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股锁定流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股锁定流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	新股锁定流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-

				受限						
30096 2	中金 辐照	2021-0 3-29	2021-1 0-11	新股 锁定 流通 受限	3.40	16.37	576	1,958. 40	9,429. 12	-
30096 3	中洲 特材	2021-0 3-30	2021-1 0-11	新股 锁定 流通 受限	12.13	22.49	283	3,432. 79	6,364. 67	-
30096 7	晓鸣 股份	2021-0 4-02	2021-1 0-13	新股 锁定 流通 受限	4.54	11.54	507	2,301. 78	5,850. 78	-
30096 8	格林 精密	2021-0 4-06	2021-1 0-15	新股 锁定 流通 受限	6.87	12.07	1,162	7,982. 94	14,025 .34	-
30097 3	立高 食品	2021-0 4-08	2021-1 0-15	新股 锁定 流通 受限	28.28	115.71	360	10,180 .80	41,655 .60	-
30097 5	商络 电子	2021-0 4-14	2021-1 0-21	新股 锁定 流通 受限	5.48	13.03	492	2,696. 16	6,410. 76	-
30097 9	华利 集团	2021-0 4-15	2021-1 0-26	新股 锁定 流通 受限	33.22	87.50	925	30,728 .50	80,937 .50	-
30098 1	中红 医疗	2021-0 4-19	2021-1 0-27	新股 锁定 流通 受限	48.59	90.39	601	29,202 .59	54,324 .39	-
30098 5	致远 新能	2021-0 4-21	2021-1 0-29	新股 锁定 流通 受限	24.90	24.81	295	7,345. 50	7,318. 95	-
30098 6	志特 新材	2021-0 4-21	2021-1 1-01	新股 锁定 流通 受限	14.79	30.57	264	3,904. 56	8,070. 48	-
30098 7	川网 传媒	2021-0 4-28	2021-1 1-11	新股 锁定 流通 受限	6.79	26.81	301	2,043. 79	8,069. 81	-

300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	新股锁定流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	新股锁定流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股锁定流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股锁定流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股锁定流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股锁定流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股锁定流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	新股锁定流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股锁定流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股锁定流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股未上	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-

				市并 锁定							
30102 1	英诺 激光	2021-0 6-28	2021-0 7-06	新股 未上 市	9.46	9.46	2,609	24,681 .14	24,681 .14	-	
30102 1	英诺 激光	2021-0 6-28	2022-0 1-06	新股 未上 市并 锁定	9.46	9.46	290	2,743. 40	2,743. 40	-	
60350 1	韦尔 股份	2021-0 2-02	2021-0 8-02	大宗 交易	280.00	308.39	56,000	15,680 ,000.0 0	17,269 ,840.0 0	-	
60516 2	新中 港	2021-0 6-29	2021-0 7-07	新股 未上 市	6.07	6.07	1,377	8,358. 39	8,358. 39	-	
60528 7	德才 股份	2021-0 6-28	2021-0 7-06	新股 未上 市	31.56	31.56	349	11,014 .44	11,014 .44	-	
68806 7	爱威 科技	2021-0 6-07	2021-1 2-16	新股 锁定 流通 受限	14.71	24.83	1,259	18,519 .89	31,260 .97	-	
68808 7	英科 再生	2021-0 6-30	2021-0 7-09	新股 未上 市	21.96	21.96	2,469	54,219 .24	54,219 .24	-	
68822 6	威腾 电气	2021-0 6-28	2021-0 7-07	新股 未上 市	6.42	6.42	2,693	17,289 .06	17,289 .06	-	
68862 5	呈和 科技	2021-0 5-31	2021-1 2-07	新股 锁定 流通 受限	16.48	42.63	2,672	44,034 .56	113,90 7.36	-	
68863 9	华恒 生物	2021-0 4-14	2021-1 0-22	新股 锁定 流通 受限	23.16	42.28	2,302	53,314 .32	97,328 .56	-	
68865 9	元琛 科技	2021-0 3-24	2021-1 0-08	新股 锁定 流通 受限	6.50	10.46	3,671	23,861 .50	38,398 .66	-	
68866 2	富信 科技	2021-0 3-25	2021-1 0-08	新股 锁定 流通 受限	15.61	29.51	2,556	39,899 .16	75,427 .56	-	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券											

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位: 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113049	长汽转债	2021-06-10	2021-07-08	老股东配债	100.00	100.00	160	16,000.00	16,000.00	-
113050	南银转债	2021-06-15	2021-07-01	老股东配债	100.00	100.00	47,360	4,736,000.00	4,736,000.00	-
113050	南银转债	2021-06-17	2021-07-01	新债未上市	100.00	100.00	8,720	872,000.00	872,000.00	-
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	老股东配债	100.00	100.00	4,085	408,500.00	408,500.00	-

注：1、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。

2、[300702]天宇股份于 2021 年 1 月 18 日非公开定增买入数量 123,533 股，成本 9,999,996.35 元；于 2021 年 6 月 18 日送股，数量 98,827 股。因此总数量 222,360 股，总成本 9,999,996.35 元。

3、[300948]冠中生态于 2021 年 2 月 18 日中签新股锁定流通受限数量 216 股，成本 2,808.00 元；于 2021 年 6 月 4 日送股，数量 108 股。因此总数量 324 股，总成本 2,808.00 元。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021-06-30	重大事项停牌	56.35	2021-07-01	59.49	703,000	34,137,369.35	39,614,050.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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

本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及股指期货等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

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

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

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

靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.47%(2020 年 12 月 31 日：12.46%)。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	153,132,000.00	314,284,200.00
合计	153,132,000.00	314,284,200.00

注：未评级部分为国债和政策性金融债。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	31,760,599.50	1,068,106,956.42
AAA 以下	1,635,920.78	228,767,931.88
未评级	-	237,149,200.00
合计	33,396,520.28	1,534,024,088.30

注：未评级部分为政策性金融债和国债。

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 1.43%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	433,797,300.16	-	-	-	433,797,300.16
结算备付金	1,137,442,831.65	-	-	-	1,137,442,831.65
存出保证金	510,493,956.28	-	-	-	510,493,956.28

交易性金融资产	165,248,800.00	14,260,159.50	7,019,560.78	4,951,727,461.58	5,138,255,981.86
应收申购款	-	-	-	456,543.04	456,543.04
应收证券清算款	-	-	-	73,950,889.96	73,950,889.96
应收利息	-	-	-	5,388,444.84	5,388,444.84
资产总计	2,246,982,888.09	14,260,159.50	7,019,560.78	5,031,523,339.42	7,299,785,947.79
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	9,368,795.14	9,368,795.14
应付托管费	-	-	-	1,561,465.81	1,561,465.81
应付销售服务费	-	-	-	65,922.70	65,922.70
应付交易费用	-	-	-	5,049,579.11	5,049,579.11
应交税金	-	-	-	4,562.40	4,562.40
应付赎回款	-	-	-	152,498,534.22	152,498,534.22
其他负债	-	-	-	399,181.49	399,181.49
负债总计	-	-	-	168,948,040.87	168,948,040.87
利率敏感度缺口	2,246,982,888.09	14,260,159.50	7,019,560.78	4,862,575,298.55	7,130,837,906.92
上年度末 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	41,800,216.80	-	-	-	41,800,216.80
结算备付金	358,421,104.23	-	-	-	358,421,104.23
存出保证金	757,804,318.58	-	-	-	757,804,318.58
交易性金融资产	807,190,397.30	988,101,635.75	53,016,255.25	7,423,156,031.70	9,271,464,320.00
应收申购款	-	-	-	2,647,808.80	2,647,808.80
应收证券清算款	-	-	-	183,280,473.67	183,280,473.67
应收利息	-	-	-	23,412,020.70	23,412,020.70
资产总计	1,965,216,036.91	988,101,635.75	53,016,255.25	7,632,496,334.87	10,638,830,262.78

负债					
应付管理人报酬	-	-	-	14,430,878.93	14,430,878.93
应付托管费	-	-	-	2,405,146.48	2,405,146.48
应付销售服务费	-	-	-	89,786.95	89,786.95
应付交易费用	-	-	-	8,815,990.54	8,815,990.54
应交税金	-	-	-	79,028.91	79,028.91
应付赎回款	-	-	-	200,138,080.33	200,138,080.33
其他负债	-	-	-	663,772.42	663,772.42
负债总计	-	-	-	226,622,684.56	226,622,684.56
利率敏感度缺口	1,965,216,036.91	988,101,635.75	53,016,255.25	7,405,873,650.31	10,412,207,578.22

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他变量保持不变		
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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率上升25个基点	-217,812.68	-9,353,580.27
市场利率下降25个基点	220,286.20	9,467,506.45	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，形成对不同市场周期的预测和判断，通过灵活主动且有纪律的资产配置，确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例，追求较高的收益，同时规避市场的系统性风险。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。在每个交易日日终持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	4,951,727,46 1.58	69.44	7,423,156,031 .70	71.29
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,951,727,46 1.58	69.44	7,423,156,031 .70	71.29

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准（附注 6.4.1）上升5%	60,565,699.91	77,329,912.54
	业绩比较基准（附注 6.4.1）下降5%	-60,565,699.91	-77,329,912.54

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	4,951,727,461.58	67.83
	其中：股票	4,951,727,461.58	67.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	186,528,520.28	2.56
	其中：债券	186,528,520.28	2.56
	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	1,571,240,131.81	21.52
8	其他各项资产	590,289,834.12	8.09
9	合计	7,299,785,947.79	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	10,661,412.00	0.15
B	采矿业	87,234,673.77	1.22
C	制造业	3,336,768,219.33	46.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,654,598.51	0.47
E	建筑业	11,555,372.44	0.16
F	批发和零售业	23,669,234.88	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	1,416,546.46	0.02
H	住宿和餐饮业	34,170.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	188,303,775.06	2.64
J	金融业	889,930,698.70	12.48
K	房地产业	83,316,975.19	1.17
L	租赁和商务服务业	102,989,588.10	1.44
M	科学研究和技术服务业	99,367,227.93	1.39
N	水利、环境和公共设施管理业	6,059,079.13	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,044,500.00	0.01
Q	卫生和社会工作	44,737,283.68	0.63
R	文化、体育和娱乐业	30,984,106.40	0.43
S	综合	-	-
	合计	4,951,727,461.58	69.44

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	104,150	214,205,305.00	3.00
2	600036	招商银行	3,301,297	178,897,284.43	2.51

3	000858	五 粮 液	586,900	174,831,641.00	2.45
4	000333	美的集团	1,533,343	109,434,689.91	1.53
5	300059	东方财富	3,171,597	103,996,665.63	1.46
6	603259	药明康德	612,355	95,888,669.45	1.34
7	601888	中国中免	315,341	94,633,834.10	1.33
8	601012	隆基股份	974,827	86,603,630.68	1.21
9	000001	平安银行	3,777,424	85,445,330.88	1.20
10	601318	中国平安	1,318,500	84,753,180.00	1.19
11	601166	兴业银行	3,831,100	78,729,105.00	1.10
12	600309	万华化学	718,405	78,176,832.10	1.10
13	002142	宁波银行	2,005,040	78,136,408.80	1.10
14	600031	三一重工	2,380,358	69,197,007.06	0.97
15	600690	海尔智家	2,492,373	64,577,384.43	0.91
16	300124	汇川技术	851,050	63,198,973.00	0.89
17	002415	海康威视	975,645	62,929,102.50	0.88
18	000063	中兴通讯	1,853,300	61,585,159.00	0.86
19	002594	比亚迪	241,600	60,641,600.00	0.85
20	600958	东方证券	5,855,634	58,497,783.66	0.82
21	000568	泸州老窖	247,194	58,322,952.36	0.82
22	002475	立讯精密	1,196,327	55,031,042.00	0.77
23	601238	广汽集团	4,085,057	52,901,488.15	0.74
24	600438	通威股份	1,111,700	48,103,259.00	0.67
25	603501	韦尔股份	146,203	46,315,206.00	0.65
26	300750	宁德时代	86,400	46,206,720.00	0.65
27	601377	兴业证券	4,723,199	45,626,102.34	0.64
28	600660	福耀玻璃	753,035	42,057,004.75	0.59
29	000661	长春高新	111,505	41,920,565.00	0.59
30	601009	南京银行	3,925,100	41,292,052.00	0.58
31	600460	士兰微	703,000	39,614,050.00	0.56
32	002271	东方雨虹	709,141	39,229,680.12	0.55
33	002311	海大集团	466,403	38,058,484.80	0.53
34	600104	上汽集团	1,726,594	37,933,270.18	0.53
35	002230	科大讯飞	552,900	37,364,982.00	0.52
36	300014	亿纬锂能	354,390	36,831,752.70	0.52
37	002179	中航光电	465,333	36,770,613.66	0.52
38	300122	智飞生物	194,108	36,245,786.84	0.51
39	002624	完美世界	1,483,940	35,481,005.40	0.50
40	000002	万 科 A	1,459,579	34,752,575.99	0.49
41	300760	迈瑞医疗	69,285	33,260,264.25	0.47
42	603369	今世缘	608,798	32,972,499.68	0.46
43	688036	传音控股	157,068	32,905,746.00	0.46
44	600399	抚顺特钢	1,795,800	32,575,812.00	0.46
45	300454	深信服	120,803	31,345,962.44	0.44
46	300408	三环集团	729,706	30,954,128.52	0.43

47	603882	金域医学	187,612	29,974,769.24	0.42
48	600926	杭州银行	2,030,150	29,944,712.50	0.42
49	300529	健帆生物	328,899	28,403,717.64	0.40
50	600276	恒瑞医药	412,405	28,031,167.85	0.39
51	000830	鲁西化工	1,479,600	27,712,908.00	0.39
52	002812	恩捷股份	117,697	27,552,867.70	0.39
53	600919	江苏银行	3,750,850	26,631,035.00	0.37
54	600900	长江电力	1,285,433	26,531,337.12	0.37
55	600028	中国石化	6,026,000	26,273,360.00	0.37
56	300274	阳光电源	222,800	25,635,368.00	0.36
57	688169	石头科技	20,240	25,522,640.00	0.36
58	601225	陕西煤业	2,143,173	25,396,600.05	0.36
59	002241	歌尔股份	590,300	25,229,422.00	0.35
60	601799	星宇股份	109,742	24,770,964.24	0.35
61	000786	北新建材	630,406	24,743,435.50	0.35
62	600176	中国巨石	1,571,476	24,373,592.76	0.34
63	000739	普洛药业	812,928	23,900,083.20	0.34
64	600486	扬农化工	213,146	23,823,328.42	0.33
65	600426	华鲁恒升	766,900	23,735,555.00	0.33
66	688519	南亚新材	621,851	23,481,093.76	0.33
67	002636	金安国纪	1,374,441	22,293,433.02	0.31
68	002968	新大正	511,275	22,266,026.25	0.31
69	601233	桐昆股份	920,100	22,165,209.00	0.31
70	000733	振华科技	361,300	22,064,591.00	0.31
71	600887	伊利股份	597,823	22,017,821.09	0.31
72	002557	洽洽食品	497,164	21,427,768.40	0.30
73	600893	航发动力	400,000	21,276,000.00	0.30
74	300413	芒果超媒	308,109	21,136,277.40	0.30
75	600171	上海贝岭	690,700	21,018,001.00	0.29
76	600585	海螺水泥	509,651	20,921,173.55	0.29
77	603267	鸿远电子	163,100	20,863,752.00	0.29
78	002001	新 和 成	726,667	20,840,809.56	0.29
79	002430	杭氧股份	596,194	20,622,350.46	0.29
80	002129	中环股份	512,900	19,797,940.00	0.28
81	601966	玲珑轮胎	447,021	19,552,698.54	0.27
82	603899	晨光文具	222,088	18,779,761.28	0.26
83	601689	拓普集团	490,357	18,354,062.51	0.26
84	601211	国泰君安	1,036,200	17,760,468.00	0.25
85	600030	中信证券	703,339	17,541,274.66	0.25
86	300628	亿联网络	205,700	17,237,660.00	0.24
87	603678	火炬电子	254,974	17,210,745.00	0.24
88	002653	海思科	780,500	16,796,360.00	0.24
89	601838	成都银行	1,305,900	16,506,576.00	0.23
90	603799	华友钴业	143,948	16,438,861.60	0.23

91	002555	三七互娱	680,500	16,345,610.00	0.23
92	002727	一心堂	492,876	16,319,124.36	0.23
93	000596	古井贡酒	67,600	16,190,200.00	0.23
94	300316	晶盛机电	316,494	15,982,947.00	0.22
95	603986	兆易创新	80,100	15,050,790.00	0.21
96	002709	天赐材料	139,270	14,843,396.60	0.21
97	603218	日月股份	546,660	14,803,552.80	0.21
98	300347	泰格医药	75,550	14,603,815.00	0.20
99	600845	宝信软件	285,094	14,511,284.60	0.20
100	603816	顾家家居	186,499	14,412,642.72	0.20
101	300782	卓胜微	27,977	13,989,227.50	0.20
102	601100	恒立液压	158,617	13,628,372.64	0.19
103	688268	华特气体	180,858	13,596,904.44	0.19
104	002867	周大生	687,234	13,586,616.18	0.19
105	000932	华菱钢铁	2,056,900	13,575,540.00	0.19
106	002460	赣锋锂业	111,861	13,545,248.49	0.19
107	300724	捷佳伟创	116,600	13,526,766.00	0.19
108	002050	三花智控	563,700	13,517,526.00	0.19
109	000983	山西焦煤	1,615,650	13,426,051.50	0.19
110	601899	紫金矿业	1,384,578	13,416,560.82	0.19
111	000656	金科股份	2,303,421	13,336,807.59	0.19
112	000776	广发证券	880,700	13,333,798.00	0.19
113	600048	保利地产	1,061,874	12,784,962.96	0.18
114	002138	顺络电子	327,900	12,712,683.00	0.18
115	300207	欣旺达	382,400	12,450,944.00	0.17
116	000651	格力电器	228,700	11,915,270.00	0.17
117	601117	中国化学	1,289,000	11,291,640.00	0.16
118	603416	信捷电气	172,600	10,954,922.00	0.15
119	601601	中国太保	371,410	10,759,747.70	0.15
120	600885	宏发股份	164,300	10,301,610.00	0.14
121	688002	睿创微纳	100,318	10,014,745.94	0.14
122	300751	迈为股份	21,960	9,985,212.00	0.14
123	002541	鸿路钢构	170,725	9,961,803.75	0.14
124	002223	鱼跃医疗	261,000	9,951,930.00	0.14
125	002332	仙琚制药	792,842	9,942,238.68	0.14
126	300496	中科创达	62,700	9,847,662.00	0.14
127	688526	科前生物	270,775	9,807,470.50	0.14
128	603156	养元饮品	327,800	9,368,524.00	0.13
129	600703	三安光电	291,600	9,345,780.00	0.13
130	600862	中航高科	298,800	9,197,064.00	0.13
131	603987	康德莱	351,478	9,138,428.00	0.13
132	000425	徐工机械	1,422,700	9,062,599.00	0.13
133	688111	金山办公	22,865	9,027,102.00	0.13
134	300144	宋城演艺	526,500	8,845,200.00	0.12

135	600745	闻泰科技	89,500	8,672,550.00	0.12
136	300570	太辰光	539,700	8,635,200.00	0.12
137	600298	安琪酵母	157,400	8,559,412.00	0.12
138	600406	国电南瑞	366,720	8,522,572.80	0.12
139	002371	北方华创	29,361	8,144,154.18	0.11
140	688089	XD 嘉必优	169,032	7,758,568.80	0.11
141	300737	科顺股份	244,193	7,677,427.92	0.11
142	300702	天宇股份	222,534	7,675,359.48	0.11
143	600563	法拉电子	48,016	7,603,813.76	0.11
144	002791	坚朗五金	38,600	7,490,330.00	0.11
145	603605	珀莱雅	36,800	7,238,928.00	0.10
146	300482	万孚生物	111,824	7,233,894.56	0.10
147	002714	牧原股份	116,421	7,080,725.22	0.10
148	600803	新奥股份	424,200	7,003,542.00	0.10
149	000338	潍柴动力	387,580	6,926,054.60	0.10
150	605111	新洁能	38,420	6,925,973.40	0.10
151	002444	巨星科技	202,500	6,901,200.00	0.10
152	603833	欧派家居	48,494	6,884,208.24	0.10
153	002532	天山铝业	813,318	6,823,738.02	0.10
154	600521	华海药业	324,842	6,782,700.96	0.10
155	002353	杰瑞股份	150,500	6,727,350.00	0.09
156	603290	斯达半导	20,700	6,624,000.00	0.09
157	600219	南山铝业	1,745,061	6,282,219.60	0.09
158	601666	平煤股份	876,960	6,235,185.60	0.09
159	603195	公牛集团	30,318	6,124,236.00	0.09
160	603129	春风动力	49,100	6,092,328.00	0.09
161	603659	璞泰来	39,880	5,447,608.00	0.08
162	000547	航天发展	283,800	5,355,306.00	0.08
163	603456	九洲药业	108,538	5,272,776.04	0.07
164	300450	先导智能	86,237	5,186,293.18	0.07
165	600499	科达制造	359,467	5,176,324.80	0.07
166	601877	正泰电器	155,027	5,174,801.26	0.07
167	603179	新泉股份	156,200	5,135,856.00	0.07
168	603517	绝味食品	59,600	5,023,684.00	0.07
169	002705	新宝股份	185,700	4,874,625.00	0.07
170	000538	云南白药	42,100	4,871,812.00	0.07
171	300659	中孚信息	144,100	4,837,437.00	0.07
172	002410	广联达	70,013	4,774,886.60	0.07
173	002459	晶澳科技	96,900	4,748,100.00	0.07
174	603896	寿仙谷	115,700	4,713,618.00	0.07
175	300653	正海生物	60,000	4,698,000.00	0.07
176	002092	中泰化学	445,900	4,579,393.00	0.06
177	605068	明新旭腾	126,700	4,557,399.00	0.06
178	300777	中简科技	100,000	4,518,000.00	0.06

179	688109	品茗股份	57,291	4,448,073.24	0.06
180	000513	丽珠集团	88,102	4,406,862.04	0.06
181	600138	中青旅	419,400	4,403,700.00	0.06
182	600522	中天科技	436,500	4,365,000.00	0.06
183	600372	中航电子	261,200	4,322,860.00	0.06
184	300394	天孚通信	170,620	4,320,098.40	0.06
185	002389	航天彩虹	189,500	4,136,785.00	0.06
186	600323	瀚蓝环境	185,200	4,035,508.00	0.06
187	300037	新宙邦	40,000	4,004,000.00	0.06
188	603233	大参林	78,001	3,986,631.11	0.06
189	002821	凯莱英	10,100	3,763,260.00	0.05
190	002508	老板电器	79,131	3,679,591.50	0.05
191	603185	上机数控	20,000	3,579,000.00	0.05
192	002299	圣农发展	149,700	3,574,836.00	0.05
193	002027	分众传媒	364,400	3,429,004.00	0.05
194	002585	双星新材	150,000	3,019,500.00	0.04
195	300168	万达信息	205,992	3,007,483.20	0.04
196	601677	明泰铝业	152,703	2,985,343.65	0.04
197	600989	宝丰能源	205,300	2,808,504.00	0.04
198	002690	美亚光电	50,200	2,799,152.00	0.04
199	603893	瑞芯微	20,000	2,789,200.00	0.04
200	603113	金能科技	150,000	2,709,000.00	0.04
201	002080	中材科技	102,300	2,677,191.00	0.04
202	300525	博思软件	147,100	2,611,025.00	0.04
203	002258	利尔化学	100,000	2,580,000.00	0.04
204	688006	杭可科技	30,000	2,550,000.00	0.04
205	002028	思源电气	79,960	2,461,968.40	0.03
206	600398	海澜之家	328,100	2,375,444.00	0.03
207	603700	宁水集团	96,000	2,322,240.00	0.03
208	002979	雷赛智能	79,905	2,290,876.35	0.03
209	688099	晶晨股份	20,400	2,288,880.00	0.03
210	002507	涪陵榨菜	60,082	2,262,688.12	0.03
211	300775	三角防务	59,100	2,257,620.00	0.03
212	300502	新易盛	70,525	2,203,906.25	0.03
213	300174	元力股份	131,800	2,090,348.00	0.03
214	300451	创业慧康	235,270	2,079,786.80	0.03
215	300067	安诺其	473,100	2,010,675.00	0.03
216	603516	淳中科技	91,000	1,938,300.00	0.03
217	603136	天目湖	117,885	1,938,029.40	0.03
218	300575	中旗股份	79,100	1,926,876.00	0.03
219	603686	龙马环卫	124,487	1,893,447.27	0.03
220	603600	永艺股份	181,400	1,864,792.00	0.03
221	603809	豪能股份	140,420	1,856,352.40	0.03
222	300452	山河药辅	124,400	1,856,048.00	0.03

223	688021	奥福环保	41,460	1,855,749.60	0.03
224	600507	方大特钢	254,082	1,722,675.96	0.02
225	601995	中金公司	28,000	1,722,000.00	0.02
226	002035	华帝股份	223,900	1,616,558.00	0.02
227	688208	道通科技	18,113	1,575,649.87	0.02
228	300136	信维通信	46,900	1,448,272.00	0.02
229	000807	云铝股份	120,000	1,428,000.00	0.02
230	000028	国药一致	35,700	1,350,888.00	0.02
231	002920	德赛西威	11,800	1,298,944.00	0.02
232	600056	中国医药	104,200	1,266,030.00	0.02
233	600985	淮北矿业	102,500	1,251,525.00	0.02
234	002318	久立特材	101,900	1,224,838.00	0.02
235	601633	长城汽车	28,000	1,220,520.00	0.02
236	002216	三全食品	72,100	1,187,487.00	0.02
237	002607	中公教育	50,000	1,044,500.00	0.01
238	300979	华利集团	9,246	1,028,699.40	0.01
239	603368	柳药股份	52,109	1,028,631.66	0.01
240	002391	长青股份	142,800	1,001,028.00	0.01
241	603613	国联股份	10,000	999,700.00	0.01
242	002949	华阳国际	58,900	995,410.00	0.01
243	600990	四创电子	25,000	994,250.00	0.01
244	000885	城发环境	103,500	989,460.00	0.01
245	300284	苏交科	168,500	985,725.00	0.01
246	002327	富安娜	127,200	984,528.00	0.01
247	300788	中信出版	26,500	974,405.00	0.01
248	300577	开润股份	45,324	971,293.32	0.01
249	603018	华设集团	118,900	945,255.00	0.01
250	000039	中集集团	50,000	909,000.00	0.01
251	603010	万盛股份	40,000	838,800.00	0.01
252	002493	荣盛石化	47,484	820,048.68	0.01
253	600782	新钢股份	140,000	781,200.00	0.01
254	603345	安井食品	3,000	762,060.00	0.01
255	300677	英科医疗	6,000	748,800.00	0.01
256	300822	贝仕达克	26,667	709,342.20	0.01
257	002955	鸿合科技	36,890	704,230.10	0.01
258	600114	东睦股份	83,400	699,726.00	0.01
259	600779	水井坊	5,000	631,750.00	0.01
260	688981	中芯国际	10,000	618,200.00	0.01
261	601808	中海油服	42,400	608,864.00	0.01
262	300259	新天科技	126,900	577,395.00	0.01
263	603198	迎驾贡酒	13,000	575,900.00	0.01
264	002020	京新药业	58,500	497,250.00	0.01
265	000963	华东医药	10,600	487,706.00	0.01
266	601898	中煤能源	59,700	426,855.00	0.01

267	300058	蓝色光标	69,000	417,450.00	0.01
268	601865	福莱特	10,000	395,300.00	0.01
269	600316	洪都航空	10,000	384,800.00	0.01
270	601636	旗滨集团	20,086	372,796.16	0.01
271	603589	口子窖	5,000	338,450.00	0.00
272	300759	康龙化成	1,500	325,485.00	0.00
273	688396	华润微	3,284	298,909.68	0.00
274	603260	合盛硅业	3,800	292,258.00	0.00
275	002623	亚玛顿	6,600	279,114.00	0.00
276	603378	亚士创能	5,000	275,100.00	0.00
277	000799	酒鬼酒	1,000	255,600.00	0.00
278	688122	西部超导	3,476	225,488.12	0.00
279	300416	苏试试验	9,800	224,420.00	0.00
280	600570	恒生电子	2,342	218,391.50	0.00
281	002568	百润股份	2,000	189,580.00	0.00
282	300007	汉威科技	10,000	183,600.00	0.00
283	300395	菲利华	3,800	183,236.00	0.00
284	000625	长安汽车	5,763	151,451.64	0.00
285	601919	中远海控	4,800	146,592.00	0.00
286	600882	妙可蓝多	2,000	139,600.00	0.00
287	603486	科沃斯	600	136,848.00	0.00
288	600809	山西汾酒	300	134,400.00	0.00
289	002797	第一创业	17,800	127,092.00	0.00
290	002511	中顺洁柔	4,601	126,757.55	0.00
291	000050	深天马 A	8,795	124,713.10	0.00
292	002304	洋河股份	600	124,320.00	0.00
293	601717	郑煤机	10,600	123,278.00	0.00
294	600487	亨通光电	10,600	120,840.00	0.00
295	600808	马钢股份	27,600	118,404.00	0.00
296	600153	建发股份	14,600	118,260.00	0.00
297	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.00
298	603885	吉祥航空	7,300	111,398.00	0.00
299	600967	内蒙一机	10,900	110,308.00	0.00
300	600388	龙净环保	12,400	105,648.00	0.00
301	601828	美凯龙	8,800	105,600.00	0.00
302	600884	杉杉股份	4,500	104,940.00	0.00
303	300010	豆神教育	17,900	101,493.00	0.00
304	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
305	300699	光威复材	1,300	98,735.00	0.00
306	688639	华恒生物	2,302	97,328.56	0.00
307	000869	张裕 A	2,600	96,564.00	0.00
308	601168	西部矿业	8,000	95,440.00	0.00
309	002422	科伦药业	4,700	93,765.00	0.00
310	600201	生物股份	5,300	92,485.00	0.00

311	600867	通化东宝	7,400	88,356.00	0.00
312	603737	三棵树	500	88,000.00	0.00
313	600637	东方明珠	10,700	87,633.00	0.00
314	688188	柏楚电子	200	87,200.00	0.00
315	002372	伟星新材	4,100	84,747.00	0.00
316	600038	中直股份	1,600	84,384.00	0.00
317	000723	美锦能源	11,100	83,916.00	0.00
318	603707	健友股份	2,000	83,500.00	0.00
319	600170	上海建工	30,100	83,076.00	0.00
320	600060	海信视像	4,900	82,810.00	0.00
321	600160	巨化股份	9,300	82,212.00	0.00
322	600763	通策医疗	200	82,200.00	0.00
323	600588	用友网络	2,463	81,919.38	0.00
324	002281	光迅科技	3,300	81,180.00	0.00
325	002191	劲嘉股份	7,600	80,864.00	0.00
326	002081	金螳螂	10,200	80,784.00	0.00
327	603883	老百姓	1,500	79,020.00	0.00
328	600908	无锡银行	13,600	78,880.00	0.00
329	688390	固德威	235	78,490.00	0.00
330	600859	王府井	2,700	77,976.00	0.00
331	000402	金融街	11,500	77,625.00	0.00
332	000400	许继电气	6,100	77,226.00	0.00
333	601000	唐山港	31,900	76,879.00	0.00
334	002839	张家港行	14,100	76,704.00	0.00
335	600195	中牧股份	6,400	76,544.00	0.00
336	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.00
337	300113	顺网科技	5,800	75,052.00	0.00
338	600863	内蒙华电	32,100	74,793.00	0.00
339	603983	丸美股份	1,400	72,954.00	0.00
340	002419	天虹股份	11,000	72,160.00	0.00
341	688116	天奈科技	600	70,800.00	0.00
342	300696	爱乐达	1,700	70,754.00	0.00
343	600583	海油工程	15,300	68,850.00	0.00
344	002946	新乳业	4,500	68,175.00	0.00
345	002044	美年健康	7,400	67,414.00	0.00
346	002244	滨江集团	15,500	64,945.00	0.00
347	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
348	688008	澜起科技	987	61,569.06	0.00
349	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
350	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
351	300418	昆仑万维	3,200	52,416.00	0.00
352	002074	国轩高科	1,100	47,916.00	0.00
353	600089	特变电工	3,700	47,545.00	0.00
354	603338	浙江鼎力	800	46,952.00	0.00

355	603348	文灿股份	1,300	45,500.00	0.00
356	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
357	600315	上海家化	700	42,098.00	0.00
358	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
359	688088	虹软科技	700	39,025.00	0.00
360	300308	中际旭创	1,000	38,520.00	0.00
361	688659	元琛科技	3,671	38,398.66	0.00
362	300755	华致酒行	900	36,729.00	0.00
363	000021	深科技	1,900	36,366.00	0.00
364	603638	艾迪精密	840	36,010.80	0.00
365	002572	索菲亚	1,465	35,453.00	0.00
366	600066	宇通客车	2,800	34,972.00	0.00
367	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
368	600754	锦江酒店	600	34,170.00	0.00
369	300119	瑞普生物	1,000	33,820.00	0.00
370	300463	迈克生物	800	33,672.00	0.00
371	603650	彤程新材	700	33,670.00	0.00
372	002124	天邦股份	4,800	33,648.00	0.00
373	600409	三友化工	3,300	33,363.00	0.00
374	600511	国药股份	1,000	33,060.00	0.00
375	600325	华发股份	4,900	33,026.00	0.00
376	600497	驰宏锌锗	7,500	32,325.00	0.00
377	600970	中材国际	3,500	32,095.00	0.00
378	002396	星网锐捷	1,500	32,025.00	0.00
379	603568	伟明环保	1,400	31,962.00	0.00
380	600008	首创环保	10,600	31,906.00	0.00
381	300630	普利制药	600	31,440.00	0.00
382	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.00
383	000738	航发控制	1,500	31,245.00	0.00
384	000729	燕京啤酒	4,300	31,132.00	0.00
385	601200	上海环境	2,600	31,122.00	0.00
386	002745	木林森	2,300	30,820.00	0.00
387	600039	四川路桥	4,900	30,723.00	0.00
388	002468	申通快递	4,000	30,480.00	0.00
389	688200	华峰测控	64	30,293.12	0.00
390	603786	科博达	400	30,200.00	0.00
391	600729	重庆百货	1,100	30,195.00	0.00
392	601598	中国外运	5,900	29,795.00	0.00
393	603868	飞科电器	700	29,442.00	0.00
394	002206	海利得	4,700	29,187.00	0.00
395	600350	山东高速	4,700	28,905.00	0.00
396	603515	欧普照明	1,100	28,237.00	0.00
397	601098	中南传媒	3,200	28,224.00	0.00
398	300073	当升科技	500	28,095.00	0.00

399	603583	捷昌驱动	552	27,942.24	0.00
400	002597	金禾实业	800	27,760.00	0.00
401	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
402	002747	埃斯顿	700	27,335.00	0.00
403	300957	贝泰妮	100	27,169.00	0.00
404	603599	广信股份	900	27,072.00	0.00
405	601398	工商银行	5,100	26,367.00	0.00
406	601668	中国建筑	5,600	26,040.00	0.00
407	600456	宝钛股份	600	25,740.00	0.00
408	300661	圣邦股份	100	25,273.00	0.00
409	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
410	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
411	002340	格林美	2,200	20,570.00	0.00
412	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
413	002139	拓邦股份	1,100	19,789.00	0.00
414	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
415	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
416	300146	汤臣倍健	500	16,450.00	0.00
417	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
418	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
419	601577	长沙银行	1,500	13,410.00	0.00
420	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
421	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
422	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
423	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
424	688536	思瑞浦	22	12,122.00	0.00
425	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
426	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
427	300753	爱朋医疗	500	11,310.00	0.00
428	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
429	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
430	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
431	300285	国瓷材料	200	9,750.00	0.00
432	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
433	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
434	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
435	300015	爱尔眼科	128	9,085.44	0.00
436	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
437	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
438	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
439	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
440	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
441	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
442	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00

443	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
444	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
445	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
446	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
447	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
448	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
449	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
450	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
451	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
452	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
453	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
454	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
455	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
456	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
457	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
458	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
459	300770	新媒股份	80	3,896.00	0.00
460	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
461	603708	家家悦	141	2,449.17	0.00
462	300012	华测检测	71	2,263.48	0.00
463	000708	中信特钢	96	2,000.64	0.00
464	600377	宁沪高速	183	1,786.08	0.00
465	000975	银泰黄金	184	1,749.84	0.00
466	603606	东方电缆	83	1,671.62	0.00
467	600547	山东黄金	68	1,306.96	0.00
468	600009	上海机场	26	1,251.38	0.00
469	603960	克来机电	31	1,026.10	0.00
470	000961	中南建设	170	1,006.40	0.00
471	600720	祁连山	89	938.06	0.00
472	002602	世纪华通	120	770.40	0.00
473	000725	京东方 A	94	586.56	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	296,968,390.92	2.85
2	600276	恒瑞医药	152,563,183.09	1.47
3	300122	智飞生物	116,166,622.46	1.12
4	002594	比亚迪	109,469,991.58	1.05

5	601318	中国平安	108,071,353.41	1.04
6	002230	科大讯飞	90,130,242.97	0.87
7	601238	广汽集团	87,871,968.39	0.84
8	601377	兴业证券	83,226,447.53	0.80
9	002142	宁波银行	80,664,453.94	0.77
10	601899	紫金矿业	77,614,335.56	0.75
11	600690	海尔智家	74,387,980.72	0.71
12	000063	中兴通讯	71,027,468.54	0.68
13	600893	航发动力	69,779,467.85	0.67
14	300750	宁德时代	69,671,741.28	0.67
15	601012	隆基股份	67,860,837.99	0.65
16	000858	五粮液	66,038,898.55	0.63
17	600309	万华化学	65,439,558.62	0.63
18	002027	分众传媒	63,618,374.63	0.61
19	002475	立讯精密	63,478,069.40	0.61
20	688036	传音控股	63,471,275.64	0.61

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	520,347,432.92	5.00
2	300059	东方财富	409,083,516.91	3.93
3	601318	中国平安	330,907,741.58	3.18
4	601899	紫金矿业	197,329,773.00	1.90
5	002594	比亚迪	190,063,729.65	1.83
6	600276	恒瑞医药	177,509,655.63	1.70
7	600036	招商银行	166,255,071.51	1.60
8	601166	兴业银行	161,352,432.45	1.55
9	300122	智飞生物	142,756,601.76	1.37
10	002475	立讯精密	137,470,361.52	1.32
11	600030	中信证券	127,414,259.11	1.22
12	300014	亿纬锂能	126,142,132.24	1.21
13	002415	海康威视	121,223,797.54	1.16
14	600438	通威股份	120,053,100.58	1.15
15	601012	隆基股份	117,106,253.77	1.12
16	000002	万科 A	115,260,109.32	1.11
17	002241	歌尔股份	112,108,428.40	1.08
18	000725	京东方 A	112,083,482.74	1.08
19	000001	平安银行	108,865,302.65	1.05

20	000100	TCL 科技	107,895,674.54	1.04
----	--------	--------	----------------	------

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	8,003,610,179.17
卖出股票的收入（成交）总额	10,855,735,391.82

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	153,132,000.00	2.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	23,131,400.00	0.32
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	10,265,120.28	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	186,528,520.28	2.62

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019640	20 国债 10	1,531,320	153,132,000.00	2.15
2	136855	16 光控 03	130,000	13,101,400.00	0.18

3	143189	18 蓉产 01	100,000	10,030,000.00	0.14
4	113050	南银转债	56,080	5,608,000.00	0.08
5	132007	16 凤凰 EB	20,000	2,086,800.00	0.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2109	IF2109	-1,752.00	-2,715,459,840.00	-134,048,166.77	-
IF2112	IF2112	-492.00	-758,693,520.00	-34,481,623.14	-
IC2109	IC2109	-172.00	-229,344,800.00	-10,798,935.02	-
IF2108	IF2108	-275.00	-427,102,500.00	585,840.00	-
公允价值变动总额合计					-178,742,884.93
股指期货投资本期收益					-535,003,076.00
股指期货投资本期公允价值变动					355,968,736.00

注：股指期货投资本期收益中已扣除本期股指期货差价收入应缴纳增值税额。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 4,951,727,461.58 元，占基金资产净值的比例为 69.44%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-4,130,600,660.00 元，占基金资产净值的比例为-57.93%，空头合约市值占股票资产的比例为-83.42%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 523,962,619.90 元，公允价值变动损益为 -287,391,379.75 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

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

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	510,493,956.28
2	应收证券清算款	73,950,889.96
3	应收股利	-
4	应收利息	5,388,444.84
5	应收申购款	456,543.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	590,289,834.12

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	132007	16 凤凰 EB	2,086,800.00	0.03
2	132022	20 广版 EB	769,070.90	0.01
3	128064	司尔转债	240,360.00	0.00
4	110061	川投转债	149,328.60	0.00

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
海富通阿尔法对冲混合 A	205,165	28,822.17	5,019,247,913.61	84.88%	894,052,626.41	15.12%
海富通阿尔法对冲混合 C	10,319	16,341.54	85,134,033.72	50.49%	83,494,365.41	49.51%
合计	215,484	28,224.50	5,104,381,947.33	83.93%	977,546,991.82	16.07%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	海富通阿尔法对冲混合 A	2,170,217.59	0.0367%
	海富通阿尔法对冲混合 C	176,582.62	0.1047%
	合计	2,346,800.21	0.0386%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	海富通阿尔法对冲混合 A	>100
	海富通阿尔法对冲混合 C	-
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通阿尔法对冲混合 A	50~100
	海富通阿尔法对冲混合 C	-
	合计	50~100

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金募集期间, 本基金管理人运用固有资金总计 1000.10 万元认购了本基金, 其中, 发起资金总计人民币 1000 万元, 认购费用为人民币 1000 元, 符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有不少于 3 年。截至 2017 年 11 月 20 日, 发

起份额承诺持有期限已经届满。2017 年 12 月公司赎回所有份额。截止报告期末，公司未持有本基金份额。

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C
基金合同生效日（2014 年 11 月 20 日）基金份额总额	719,877,758.17	-
本报告期期初基金份额总额	8,797,483,734.76	199,221,505.72
本报告期基金总申购份额	1,094,307,850.79	122,513,220.42
减：本报告期基金总赎回份额	3,978,491,045.53	153,106,327.01
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	5,913,300,540.02	168,628,399.13

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	4,006,547,253.89	21.27%	2,902,633.22	21.95%	-
国盛证券	2	2,721,199,057.71	14.45%	1,986,052.02	15.02%	-
海通证券	4	2,240,120,695.80	11.89%	1,610,896.88	12.18%	-
渤海证券	1	1,938,540,650.68	10.29%	1,378,882.85	10.43%	-
开源证券	2	1,847,142,436.54	9.81%	1,327,318.05	10.04%	-
天风证券	2	1,115,903,887.35	5.92%	816,061.68	6.17%	-
华创证券	1	993,405,163.82	5.27%	408,588.49	3.09%	-
民生证券	2	879,268,793.12	4.67%	635,225.41	4.80%	-
招商证券	2	788,836,524.07	4.19%	575,421.22	4.35%	-
长江证券	1	548,209,593.16	2.91%	335,121.63	2.53%	-
西南证券	2	474,544,457.01	2.52%	345,984.70	2.62%	-
野村东方国际证券	1	327,862,829.21	1.74%	233,208.71	1.76%	-
太平洋证券	2	272,969,195.30	1.45%	199,621.11	1.51%	-
中信证券	2	251,534,393.79	1.34%	178,916.86	1.35%	-
中信建投	2	177,692,470.16	0.94%	108,623.79	0.82%	-
华西证券	1	159,911,171.02	0.85%	116,943.28	0.88%	-
中金公司	2	91,559,533.25	0.49%	65,126.34	0.49%	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元没有发生变更。

2、(1)交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行主观性评议，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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	回购交易	权证交易

	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总 额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
国泰君安	241,886,951.15	15.33%	1,070,000,000.00	37.74%	-	-
国盛证券	557,673,075.45	35.34%	245,000,000.00	8.64%	-	-
海通证券	169,851,236.60	10.76%	-	-	-	-
渤海证券	70,591,537.55	4.47%	-	-	-	-
开源证券	144,861,010.30	9.18%	350,000,000.00	12.35%	-	-
天风证券	62,033,033.01	3.93%	370,000,000.00	13.05%	-	-
华创证券	465,366.86	0.03%	-	-	-	-
民生证券	232,107,221.73	14.71%	-	-	-	-
招商证券	77,802,846.61	4.93%	200,000,000.00	7.05%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	589,715.20	0.04%	200,000,000.00	7.05%	-	-
野村东方国际 证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	200,000,000.00	7.05%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	200,000,000.00	7.05%	-	-
中金公司	20,238,652.05	1.28%	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日
----	------	--------	-------

			期
1	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-01
2	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-01
3	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-05
4	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加国泰君安证券股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-12
5	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-19
6	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-19
7	海富通基金管理有限公司关于旗下基金获配天宇股份（300702）非公开发行 A 股的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-20
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海联泰基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-28
9	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-29
10	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加浙商银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-30
11	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-02
12	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-04
13	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华龙证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-24
14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京恒天明泽基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-26
15	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金	中国证券报、基金管理人	2021-02-26

	新增国盛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	网站及中国证监会基金电子披露网站	
16	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东吴证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-05
17	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-16
18	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-17
19	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增甬兴证券有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-18
20	海富通基金管理有限公司关于网上直销平台开通中国工商银行快捷支付业务并开展申购费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
21	海富通基金管理有限公司关于调整网上直销金账户业务并实施费率优惠的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-22
22	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-25
23	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-29
24	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民商基金销售(上海)有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-13
25	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-15
26	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-21
27	海富通基金管理有限公司关于调整基金经理助理的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-06
28	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申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-06
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-11

30	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中信银行股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-05-20
31	海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加中国人寿保险股份有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-30

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 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”。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准设立海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金的文件
- (二) 海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金基金合同
- (三) 海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金托管协议
- (五) 中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六) 报告期内海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇二一年八月三十一日