

海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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：二〇二三年八月三十一日

§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 2023 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 2023 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 | 14 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 15 |
| 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 | 15 |
| §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 | 16 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表 | 16 |
| 6.2 利润表 | 17 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 18 |
| 6.4 报表附注 | 20 |
| §7 投资组合报告 | 44 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 44 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 45 |
| 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 | 65 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 67 |
| 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 | 67 |
| 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 | 68 |
| 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 | 68 |
| 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 | 68 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 68 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 68 |
| 7.12 市场中性策略执行情况 | 68 |
| 7.13 投资组合报告附注 | 68 |
| §8 基金份额持有人信息 | 70 |

| | |
|---|-----------|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 70 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 71 |
| 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 | 71 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 | 71 |
| 9 开放式基金份额变动 | 71 |
| §10 重大事件揭示 | 72 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 72 |
| 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 | 72 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 72 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 72 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 72 |
| 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 | 72 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 72 |
| 10.8 其他重大事件 | 74 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 75 |
| §12 备查文件目录 | 76 |
| 12.1 备查文件目录 | 76 |
| 12.2 存放地点 | 77 |
| 12.3 查阅方式 | 77 |

§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 | 406,031,530.62 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 | 377,429,709.47 份 | 28,601,821.15 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 | 010-66596688 |
| | 电子邮箱 | chongyue@hftfund.com | fxjd_hq@bank-of-china.com |
| 客户服务电话 | | 40088-40099 | 95566 |
| 传真 | | 021-33830166 | 010-66594942 |

| | | |
|-------|--|---------------|
| 注册地址 | 中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室 | 北京西城区复兴门内大街1号 |
| 办公地址 | 中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室 | 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 | 葛海蛟 |

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（2023 年 1 月 1 日至 2023 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 | -19,944,088.27 | -1,337,506.86 |
| 本期利润 | 2,320,557.43 | 51,618.62 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0047 | 0.0015 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.43% | 0.14% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.18% | -0.01% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 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 | 35,407,963.41 | 2,261,287.53 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0938 | 0.0791 |
| 期末基金资产净值 | 412,837,672.88 | 30,863,108.68 |

| | | |
|--------------|-----------------------|--------------|
| 期末基金份额净值 | 1.0938 | 1.0791 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023 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 | 51.41% | -3.65% |

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 | 0.64% | 0.22% | 0.22% | 0.01% | 0.42% | 0.21% |
| 过去三个月 | 1.17% | 0.22% | 0.68% | 0.01% | 0.49% | 0.21% |
| 过去六个月 | 0.18% | 0.22% | 1.35% | 0.01% | -1.17% | 0.21% |
| 过去一年 | -5.95% | 0.30% | 2.75% | 0.01% | -8.70% | 0.29% |
| 过去三年 | -5.79% | 0.37% | 8.48% | 0.01% | -14.27% | 0.36% |
| 自基金合同生效起至今 | 51.41% | 0.34% | 27.27% | 0.01% | 24.14% | 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 | 0.62% | 0.22% | 0.22% | 0.01% | 0.40% | 0.21% |
| 过去三个月 | 1.07% | 0.22% | 0.68% | 0.01% | 0.39% | 0.21% |
| 过去六个月 | -0.01% | 0.22% | 1.35% | 0.01% | -1.36% | 0.21% |
| 过去一年 | -6.32% | 0.30% | 2.75% | 0.01% | -9.07% | 0.29% |
| 过去三年 | -6.89% | 0.37% | 8.48% | 0.01% | -15.37% | 0.36% |
| 自基金合同生效起至今 | -3.65% | 0.36% | 9.78% | 0.01% | -13.43% | 0.35% |

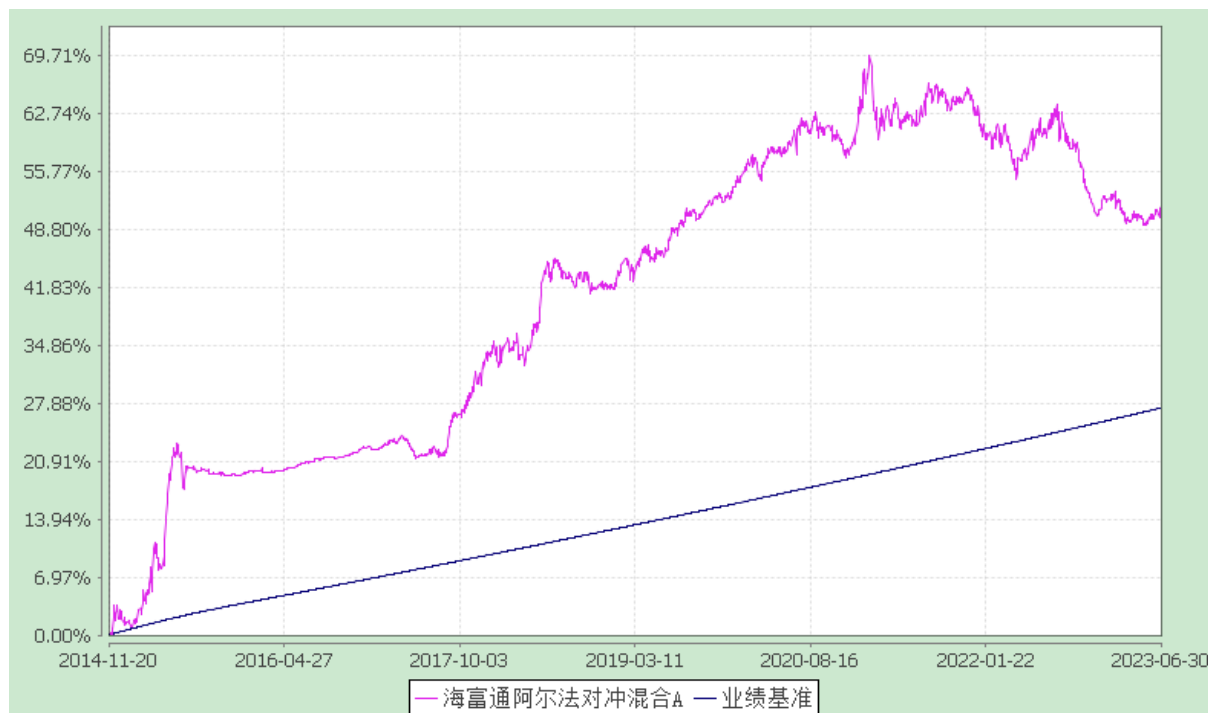
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 2023 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 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 90 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、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、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、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、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通欣润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；总经理助理兼量化投资部总监。 | 2018-04-09 | - | 23 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 |

| | | | | | |
|-----|------------|------------|---|----|--|
| | | | | | <p>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总经理助理兼量化投资部总监。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月至2022年8月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020年3月至2021年7月兼任海富通中证500增强(原海富通中证内地低碳指数)基金经理。2020年4月至2021年7月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。2021年7月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。</p> |
| 林立禾 | 本基金的基金经理助理 | 2022-10-14 | - | 4年 | <p>美国密歇根大学定量金融与风险管理硕士。历任中欧基金管理有限公司风险管理部量化风控岗。2020年8月加入海富通基金管理有限公司,任量化研究员。2022年10月起任海富通阿尔法对冲混合型</p> |

| | | | | | |
|-----|----------|------------|---|------|---|
| | | | | | 发起式证券投资基金的基金经理助理。2022 年 12 月起兼任海富通中证 500 增强型证券投资基金、海富通量化先锋股票型证券投资基金的基金经理助理。2023 年 3 月起兼任海富通富利三个月持有基金经理助理。 |
| 李自悟 | 本基金的基金经理 | 2023-04-10 | - | 15 年 | 硕士，持有基金从业人员资格证书。2008 年 4 月至 2010 年 1 月任 MNJ Capital Management 交易员，2010 年 7 月至 2011 年 6 月任 BlackRock 研究员，2011 年 7 月至 2016 年 3 月任国家外汇管理局中央外汇业务中心基金经理，2016 年 3 月至 2019 年 8 月任上海均直资产管理有限公司基金经理，2019 年 9 月至 2022 年 8 月任野村东方国际证券量化投资主管。2022 年 8 月加入海富通基金管理有限公司。2023 年 2 月起任海富通量化先锋股票、海富通中证 500 增强基金经理。2023 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合基金经理。 |

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。

4.3.2 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

2023 年上半年，国内经济总体呈现复苏态势，其中一季度由于积压需求释放表现尤其明显。3 月后经济运行有所放缓，总需求的修复本身需要一个过程，经济仍在主动去库存阶段，价格端呈现下行态势，但总体来说，上半年宏观经济呈现稳中向好态势，政策定力较足。海外方面，美国一季度发生银行业危机事件，美联储降息的预期时点一度被提前。但美国经济在二季度仍表现较强韧性，通胀读数仍偏高，市场对美国经济衰退的预期不断延后，相应利率终点的预期也后移，影响全球资产价格。产业端，上半年 AI 浪潮席卷全球，全球科技巨头大量增加相关资本开支，一些 AI 应用逐渐涌现，全球主要科技巨头走出牛市行情。

A 股市场整体表现稍弱，风格出现明显切换。春节前，顺周期风格下消费、金融、部分周期品、地产链涨幅靠前，出行链、新能源等资产表现较弱。随着 3 月后国内经济走弱以及 AI 科技浪潮爆发，权益市场出现明显风格切换，以 TMT 为代表的科技成长板块及以低估值、高股息为代表的“中特估”板块表现较好。二季度市场呈现了主题投资活跃的状态。

上半年 A 股主要指数表现方面，上证指数上涨 3.65%，沪深 300 下跌 0.75%，中证 800 上涨 0.02%，中小综指上涨 2.25%，创业板指下跌 5.61%。分行业看，成长板块表现较强，通信、传媒、计算机行业分别上涨 50.7%、42.8%、27.6%；顺周期与消费板块相对落后，房地产和建筑材料行业分别下跌 14.3%、10.5%，商贸零售、美容护理、食品饮料行业分别下跌 23.4%、13.6%、9.1%。

从上半年市场内部结构来看，主线还是在成长，中字头央企行情也表现亮眼。成长主线基本从 2 月份开始演绎，随着 OpenAI 的 AI 软件全球用户数量的快速上升，3-4 月市场沿着应用-大模型-基础算力的产业变化在传媒、计算机、通信等板块寻找投资机会。由于全球科技龙头相关资本开支的快速增加，算力板块表现尤其突出。另外，由于消费疫后复苏条线预期充分，白酒、航空、机场等相关板块上半年表现弱势，而新能源板块跟随自身产业周期，调整幅度也较大。整体而言，市场上半年反映了中国经济内在结构调整的运行节奏，也反映了市场对产业优化升级的期待，产业逻辑仍

是主导市场的线索。

本报告期内，市场风格轮动较快，考虑到当前市场较为极致的交易结构以及后续基本面定价的回归，在宏观经济复苏的前提下，本基金积极配置拥挤度较低、盈利有预期改善的高性价比资产，组合风格向均衡结构靠拢，同时提升盈利质量和业绩因子的权重。

因子方面，价值因子上半年表现较好，模型中成长因子表现较差，分析师预期类因子表现也较差，老赛道成长股调整较多；小市值因子、股息率、波动率因子上半年表现较好。

组合风格上相对均衡，在业绩和估值匹配的公司中寻找投资机会。本基金积极投资股票市场，力争在风险可控的基础上跑赢市场。

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 0.18%，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 1.17 个百分点。海富通阿尔法对冲混合 C 净值增长率为-0.01%，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 1.36 个百分点。报告期内，市场的预期博弈强于基本面，上半年市场风格波动剧烈，组合没能及时做出相应调整，股票现货部分跑输市场，导致基金净值跑输基准。

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，随着宏观政策基调转向稳增长，国内经济预期企稳，将进入自然复苏阶段，经济复苏的态势将延续。从库存周期看，下半年中美经济周期均将进入被动去库存阶段，今年年底明年年初可能进入主动补库存阶段，内需将逐步企稳回升，外需保持较强韧性。同时，在房地产市场托底、地方债务化解背景下，国内货币政策将保持宽松状态，流动性合理充裕，对 A 股较为偏正面。海外，美联储加息周期也行至尾声，对全球风险资产估值的压制减轻。同时，随着国内外政策态度的明朗，上半年市场风险偏好逐步下行的过程基本结束，下半年风险偏好有望回升。

下半年，继续关注政策驱动、产业驱动的投资主线。结构上，受益于近期宏观政策的调整，顺周期核心资产包括消费、地产链、部分库存偏低的商品及制造业，将有修复性机会。以 AI 为代表的 TMT 板块，更多地需要关注其自身的技术、产品等产业周期发展，关注国内外 AI 应用的进展。中期看，经济结构变化带来的红利较为确定，汽车、半导体等受益于产业趋势及政策导向的行业，或更加容易把握。

进入下半年，本基金会重视个股景气与估值的匹配度。后市操作上，本基金将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相对指数的超额收益，并通过股指期货对冲将股票部分的超额收益转化为绝对收益。同时，本基金依然会积极参与新股、可转债的申购，努力增厚收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资 产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 11,678,044.34 | 11,409,387.61 |
| 结算备付金 | | 81,427,350.35 | 188,182,118.01 |
| 存出保证金 | | 33,442,750.30 | 63,260,248.42 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 320,769,008.58 | 587,884,400.59 |
| 其中：股票投资 | | 301,532,668.08 | 543,808,508.70 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 19,236,340.50 | 44,075,891.89 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | -5,830.13 |
| 应收清算款 | | 1,113,434.93 | 20,797,756.59 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 61,681.46 | 55,751.11 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 448,492,269.96 | 871,583,832.20 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 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 | | - | - |
| 应付清算款 | | 364,351.80 | 1,900,338.13 |
| 应付赎回款 | | 2,896,496.58 | 307,788.83 |
| 应付管理人报酬 | | 555,570.30 | 1,169,663.61 |
| 应付托管费 | | 92,595.04 | 194,943.96 |
| 应付销售服务费 | | 10,122.18 | 18,645.19 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 23.75 | 538.33 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 872,328.75 | 1,264,549.64 |
| 负债合计 | | 4,791,488.40 | 4,856,467.69 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 406,031,530.62 | 794,462,315.09 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 37,669,250.94 | 72,265,049.42 |
| 净资产合计 | | 443,700,781.56 | 866,727,364.51 |
| 负债和净资产总计 | | 448,492,269.96 | 871,583,832.20 |

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0938 元，C 类基金份额净值 1.0791 元。

基金份额总额 406,031,530.62 份，其中 A 类基金份额 377,429,709.47 份，C 类基金份额 28,601,821.15 份。

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 7,579,965.77 | -76,181,731.53 |
| 1.利息收入 | | 801,382.93 | 6,943,372.54 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 793,590.66 | 6,835,914.55 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 7,792.27 | 107,457.99 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -17,137,834.90 | -100,305,904.54 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -2,604,511.94 | -360,375,085.52 |

| | | | |
|----------------------------|----------|---------------------|------------------------|
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 328,490.32 | 3,091,673.89 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.13 | -18,127,855.56 | 246,933,123.81 |
| 股利收益 | 6.4.7.14 | 3,266,042.28 | 10,044,383.28 |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.15 | 23,653,771.18 | 13,172,727.52 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 262,646.56 | 4,008,072.95 |
| 减：二、营业总支出 | | 5,207,789.72 | 29,347,901.02 |
| 1. 管理人报酬 | | 4,297,872.27 | 24,028,878.13 |
| 2. 托管费 | | 716,312.05 | 4,004,813.07 |
| 3. 销售服务费 | | 73,103.43 | 250,266.24 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | 21,998.66 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | 21,998.66 |
| 6. 信用减值损失 | | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 29.10 | 902,025.35 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.17 | 120,472.87 | 139,919.57 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 2,372,176.05 | -105,529,632.55 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 2,372,176.05 | -105,529,632.55 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 2,372,176.05 | -105,529,632.55 |

6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | | |
|-----------------|---------------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| | 实收基金 | 其他综合 收益（若有） | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 794,462,315.09 | - | 72,265,049.42 | 866,727,364.51 |
| 二、本期期初净 | 794,462,315.09 | - | 72,265,049.42 | 866,727,364.5 |

| | | | | |
|--|--|------------|-----------------|-------------------|
| 资产（基金净值） | | | | 1 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -388,430,784.47 | - | -34,595,798.48 | -423,026,582.95 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 2,372,176.05 | 2,372,176.05 |
| （二）、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） | -388,430,784.47 | - | -36,967,974.53 | -425,398,759.00 |
| 其中：1.基金申购款 | 38,228,970.48 | - | 3,303,838.68 | 41,532,809.16 |
| 2.基金赎回款 | -426,659,754.95 | - | -40,271,813.21 | -466,931,568.16 |
| （三）、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） | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 406,031,530.62 | - | 37,669,250.94 | 443,700,781.56 |
| 项目 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益（若有） | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 4,080,424,362.60 | - | 738,793,269.77 | 4,819,217,632.37 |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 4,080,424,362.60 | - | 738,793,269.77 | 4,819,217,632.37 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -2,341,769,773.24 | - | -456,405,700.98 | -2,798,175,474.22 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -105,529,632.55 | -105,529,632.55 |
| （二）、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） | -2,341,769,773.24 | - | -350,876,068.43 | -2,692,645,841.67 |
| 其中：1.基金申购 | 478,749,664.67 | - | 69,731,107.12 | 548,480,771.79 |

| | | | | |
|--|-------------------|---|-----------------|-------------------|
| 款 | | | | 9 |
| 2.基金赎回款 | -2,820,519,437.91 | - | -420,607,175.55 | -3,241,126,613.46 |
| (三)、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) | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 1,738,654,589.36 | - | 282,387,568.79 | 2,021,042,158.15 |

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 2023 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和《资产管理产品相关会计处理规定》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 2023 年 6 月 30 日的财务状况、2023 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

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 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。

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 2023 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
| | |

| | |
|----------------|---------------|
| 活期存款 | 11,678,044.34 |
| 等于：本金 | 11,675,395.23 |
| 加：应计利息 | 2,649.11 |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 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 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 合计 | 11,678,044.34 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | | |
|---------------|------------------------|---------------|----------------|--------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 298,911,378.68 | - | 301,532,668.08 | 2,621,289.40 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所 | 167,839.60 | | |
| | 市场 | 19,064,237.54 | 19,236,340.50 | 4,263.36 |
| | 银行间 | | - | |
| | 市场 | - | - | - |
| 合计 | 19,064,237.54 | 167,839.60 | 19,236,340.50 | 4,263.36 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 317,975,616.22 | 167,839.60 | 320,769,008.58 | 2,625,552.76 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | |
|----|------------------------|------|----|
| | 合同/名义 | 公允价值 | 备注 |
| | | | |

| | 金额 | 资产 | 负债 | |
|--------|-----------------|----|----|---|
| 利率衍生工具 | - | - | - | - |
| 货币衍生工具 | - | - | - | - |
| 权益衍生工具 | -263,255,998.03 | - | - | - |
| ——股指期货 | -263,255,998.03 | - | - | - |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | -263,255,998.03 | - | - | - |

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

| 代码 | 名称 | 持仓量(买/卖) | 合约市值 | 公允价值变动 |
|------------|--------|----------|----------------|--------------|
| IF2312 | IF2312 | -28.00 | -32,316,480.00 | 2,520.00 |
| IF2309 | IF2309 | -85.00 | -97,894,500.00 | 2,690,293.59 |
| IM2309 | IM2309 | -37.00 | -48,369,360.00 | -440,360.00 |
| IC2309 | IC2309 | -7.00 | -8,358,000.00 | 282,084.44 |
| IM2312 | IM2312 | -57.00 | -73,867,440.00 | -84,320.00 |
| 合计 | - | - | - | 2,450,218.03 |
| 减：可抵销期货暂收款 | - | - | - | 2,450,218.03 |
| 净额 | - | - | - | 0.00 |

注：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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 9,400.39 |
| 应付证券出借违约金 | - |

| | |
|----------|------------|
| 应付交易费用 | 773,668.21 |
| 其中：交易所市场 | 773,668.21 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 89,260.15 |
| 合计 | 872,328.75 |

6.4.7.7 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 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 743,706,885.57 | 743,706,885.57 |
| 本期申购 | 36,868,289.53 | 36,868,289.53 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -403,145,465.63 | -403,145,465.63 |
| 本期末 | 377,429,709.47 | 377,429,709.47 |

海富通阿尔法对冲混合 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 50,755,429.52 | 50,755,429.52 |
| 本期申购 | 1,360,680.95 | 1,360,680.95 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -23,514,289.32 | -23,514,289.32 |
| 本期末 | 28,601,821.15 | 28,601,821.15 |

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。

6.4.7.8 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 | 122,526,690.16 | -54,279,548.39 | 68,247,141.77 |
| 本期利润 | -19,944,088.27 | 22,264,645.70 | 2,320,557.43 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -53,772,796.68 | 18,613,060.89 | -35,159,735.79 |
| 其中：基金申购款 | 4,425,549.24 | -1,227,148.87 | 3,198,400.37 |
| 基金赎回款 | -58,198,345.92 | 19,840,209.76 | -38,358,136.16 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 48,809,805.21 | -13,401,841.80 | 35,407,963.41 |

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 | 7,657,257.16 | -3,639,349.51 | 4,017,907.65 |
| 本期利润 | -1,337,506.86 | 1,389,125.48 | 51,618.62 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -3,066,569.47 | 1,258,330.73 | -1,808,238.74 |
| 其中：基金申购款 | 167,210.78 | -61,772.47 | 105,438.31 |
| 基金赎回款 | -3,233,780.25 | 1,320,103.20 | -1,913,677.05 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 3,253,180.83 | -991,893.30 | 2,261,287.53 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|---------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入 | 45,985.08 |
| 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 | 741,531.24 |
| 其他 | 6,074.34 |
| 合计 | 793,590.66 |

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|---------------------------------|
| | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 卖出股票成交总额 | 1,213,435,160.49 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,213,181,364.14 |
| 减：交易费用 | 2,858,308.29 |
| 买卖股票差价收入 | -2,604,511.94 |

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 302,943.24 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 25,547.08 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 328,490.32 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 69,212,222.66 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 68,097,012.33 |
| 减：应计利息总额 | 1,088,472.47 |
| 减：交易费用 | 1,190.78 |
| 买卖债券差价收入 | 25,547.08 |

6.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|-------------------|----------------------------|
| 股指期货投资收益（税前） | -18,067,764.43 |
| 减：股指期货差价收入应缴纳增值税额 | - |
| 减：交易费用 | 60,091.13 |
| 合计 | -18,127,855.56 |

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 3,266,042.28 |
| 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 | 3,266,042.28 |

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | 24,904,706.75 |
| ——股票投资 | 24,767,600.67 |
| ——债券投资 | 137,106.08 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | -1,250,935.57 |
| ——权证投资 | - |
| ——股指期货 | -1,250,935.57 |
| 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 | 23,653,771.18 |

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 262,623.43 |
| 基金转换费收入 | 23.13 |
| 合计 | 262,646.56 |

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。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 审计费用 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行划款手续费 | 12,612.72 |
| 其他费用 | 600.00 |
| 债券托管账户维护费 | 18,000.00 |
| 合计 | 120,472.87 |

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 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 | - | - | 1,304,517,518.53 | 13.40% |

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 2023年1月1日至2023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 | - | - | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 | 948,700.65 | 15.62% | 459,527.00 | 19.60% |

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 2023年1月1日至2023年6月 30日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 4,297,872.27 | 24,028,878.13 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,473,052.64 | 4,738,680.37 |

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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 x 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月 30日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 716,312.05 | 4,004,813.07 |

注：支付基金托管人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。其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 x 0.25% / 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 2023年1月1日至2023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 | - | 3,518.79 | 3,518.79 |
| 海通证券 | - | 707.39 | 707.39 |
| 海富通基金 | - | 6,883.48 | 6,883.48 |
| 合计 | - | 11,109.66 | 11,109.66 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 | - | 6,480.40 | 6,480.40 |
| 海通证券 | - | 482.23 | 482.23 |
| 海富通基金 | - | 111,358.29 | 111,358.29 |
| 合计 | - | 118,320.92 | 118,320.92 |

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费年费率为 0.40%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。销售服务费的计算方法如下：日销售服务费 = 前一日 C 类份额的基金资产净值 x 0.40% / 当年天数。

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 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 | 11,678,044.34 | 45,985.08 | 48,595,956.25 | 339,904.63 |

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 2023年1月1日至2023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 | 688469 | 中芯集成 | 网下发行 | 48,643 | 276,778.67 |
| 上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 | 688234 | 天岳先进 | 网下发行 | 6,759 | 559,577.61 |
| 海通证券 | 688259 | 创耀科技 | 网下发行 | 1,595 | 106,227.00 |
| 海通证券 | 301228 | 实朴检测 | 网下发行 | 3,721 | 74,717.68 |

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2023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 | 受限期 | 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 |
|--------|------|------------|---------|----------|-------|--------|----------|------------|------------|----|
| 001287 | 中电港 | 2023-03-30 | 6个月 | 新股锁定 | 11.88 | 21.02 | 762 | 9,052.56 | 16,017.24 | - |
| 001367 | 海森药业 | 2023-03-30 | 6个月 | 新股锁定 | 44.48 | 39.48 | 55 | 2,446.40 | 2,171.40 | - |
| 001380 | 华纬科技 | 2023-05-09 | 6个月 | 新股锁定 | 28.84 | 30.78 | 170 | 4,902.80 | 5,232.60 | - |
| 301141 | 中科磁业 | 2023-03-27 | 6个月 | 新股锁定 | 41.20 | 42.69 | 262 | 10,794.40 | 11,184.78 | - |
| 301157 | 华塑科技 | 2023-03-01 | 6个月 | 新股锁定 | 56.50 | 52.93 | 150 | 8,475.00 | 7,939.50 | - |
| 301170 | 锡南科技 | 2023-06-16 | 6个月 | 新股锁定 | 34.00 | 34.93 | 250 | 8,500.00 | 8,732.50 | - |
| 301202 | 朗威股份 | 2023-06-28 | 1个月内(含) | 新股未上市 | 25.82 | 25.82 | 2,754 | 71,108.28 | 71,108.28 | - |
| 301202 | 朗威股份 | 2023-06-28 | 6个月 | 新股未上市并锁定 | 25.82 | 25.82 | 306 | 7,900.92 | 7,900.92 | - |
| 301210 | 金杨股份 | 2023-06-21 | 6个月 | 新股锁定 | 57.88 | 49.17 | 281 | 16,264.28 | 13,816.77 | - |
| 301225 | 恒勃股份 | 2023-06-08 | 6个月 | 新股锁定 | 35.66 | 33.26 | 333 | 11,874.78 | 11,075.58 | - |
| 301232 | 飞沃科技 | 2023-06-08 | 6个月 | 新股锁定 | 72.50 | 58.42 | 165 | 11,962.50 | 9,639.30 | - |
| 301260 | 格力博 | 2023-01-20 | 6个月 | 新股锁定 | 30.85 | 23.63 | 1,773 | 54,697.05 | 41,895.99 | - |
| 301261 | 恒工精密 | 2023-06-29 | 1个月内(含) | 新股未上市 | 36.90 | 36.90 | 1,775 | 65,497.50 | 65,497.50 | - |
| 301261 | 恒工精密 | 2023-06-29 | 6个月 | 新股未上市并锁定 | 36.90 | 36.90 | 198 | 7,306.20 | 7,306.20 | - |
| 301291 | 明阳电气 | 2023-06-21 | 6个月 | 新股锁定 | 38.13 | 31.03 | 614 | 23,411.82 | 19,052.42 | - |
| 301292 | 海科新源 | 2023-06-29 | 1个月内(含) | 新股未上市 | 19.99 | 19.99 | 5,241 | 104,767.59 | 104,767.59 | - |
| 30129 | 海科 | 2023-0 | 6个月 | 新股 | 19.99 | 19.99 | 583 | 11,654 | 11,654 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|---------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 2 | 新源 | 6-29 | | 未上市并锁定 | | | | .17 | .17 | |
| 301293 | 三博脑科 | 2023-04-25 | 6个月 | 新股锁定 | 29.60 | 71.42 | 333 | 9,856.80 | 23,782.86 | - |
| 301301 | 川宁生物 | 2022-12-20 | 6个月 | 新股锁定 | 5.00 | 8.96 | 3,574 | 17,870.00 | 32,023.04 | - |
| 301315 | 威士顿 | 2023-06-13 | 6个月 | 新股锁定 | 32.29 | 51.12 | 226 | 7,297.54 | 11,553.12 | - |
| 301320 | 豪江智能 | 2023-06-01 | 6个月 | 新股锁定 | 13.06 | 20.62 | 642 | 8,384.52 | 13,238.04 | - |
| 301323 | 新莱福 | 2023-05-29 | 6个月 | 新股锁定 | 39.06 | 39.36 | 228 | 8,905.68 | 8,974.08 | - |
| 301337 | 亚华电子 | 2023-05-16 | 6个月 | 新股锁定 | 32.60 | 30.37 | 232 | 7,563.20 | 7,045.84 | - |
| 301345 | 涛涛车业 | 2023-03-10 | 6个月 | 新股锁定 | 73.45 | 46.64 | 216 | 15,865.20 | 10,074.24 | - |
| 301357 | 北方长龙 | 2023-04-11 | 6个月 | 新股锁定 | 50.00 | 48.39 | 190 | 9,500.00 | 9,194.10 | - |
| 301358 | 湖南裕能 | 2023-02-01 | 6个月 | 新股锁定 | 23.77 | 42.89 | 1,092 | 25,956.84 | 46,835.88 | - |
| 301360 | 荣旗科技 | 2023-04-17 | 6个月 | 新股锁定 | 71.88 | 92.60 | 134 | 9,631.92 | 12,408.40 | - |
| 301373 | 凌玮科技 | 2023-01-20 | 6个月 | 新股锁定 | 33.73 | 31.85 | 277 | 9,343.21 | 8,822.45 | - |
| 301376 | 致欧科技 | 2023-06-14 | 6个月 | 新股锁定 | 24.66 | 22.51 | 420 | 10,357.20 | 9,454.20 | - |
| 301382 | 蜂助手 | 2023-05-09 | 6个月 | 新股锁定 | 23.80 | 32.84 | 408 | 9,710.40 | 13,398.72 | - |
| 301386 | 未来电器 | 2023-03-21 | 6个月 | 新股锁定 | 29.99 | 23.79 | 378 | 11,336.22 | 8,992.62 | - |
| 301387 | 光大同创 | 2023-04-10 | 6个月 | 新股锁定 | 58.32 | 45.36 | 307 | 17,904.24 | 13,925.52 | - |
| 301419 | 阿莱德 | 2023-02-02 | 6个月 | 新股锁定 | 24.80 | 43.85 | 330 | 8,184.00 | 14,470.50 | - |
| 301428 | 世纪恒通 | 2023-05-10 | 6个月 | 新股锁定 | 26.35 | 30.60 | 229 | 6,034.15 | 7,007.40 | - |
| 301439 | 泓淋电力 | 2023-03-10 | 6个月 | 新股锁定 | 19.99 | 16.90 | 826 | 16,511.74 | 13,959.40 | - |
| 301488 | 豪恩汽电 | 2023-06-26 | 1个月内(含) | 新股未上市 | 39.78 | 39.78 | 2,356 | 93,721.68 | 93,721.68 | - |
| 301488 | 豪恩汽电 | 2023-06-26 | 6个月 | 新股未上 | 39.78 | 39.78 | 262 | 10,422.36 | 10,422.36 | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|----------|----------------|------|----------|-------|-------|-------|---------------|---------------|---|
| | | | | 市并 锁定 | | | | | | |
| 60106 1 | 中信 金属 | 2023-0 3-30 | 6 个月 | 新股 锁定 | 6.58 | 7.58 | 1,604 | 10,554 .32 | 12,158 .32 | - |
| 60312 5 | 常青 科技 | 2023-0 3-30 | 6 个月 | 新股 锁定 | 25.98 | 24.53 | 160 | 4,156. 80 | 3,924. 80 | - |
| 60313 7 | 恒尚 节能 | 2023-0 4-10 | 6 个月 | 新股 锁定 | 15.90 | 17.09 | 139 | 2,210. 10 | 2,375. 51 | - |
| 60317 2 | 万丰 股份 | 2023-0 4-28 | 6 个月 | 新股 锁定 | 14.58 | 16.13 | 122 | 1,778. 76 | 1,967. 86 | - |
| 68814 6 | 中船 特气 | 2023-0 4-13 | 6 个月 | 新股 锁定 | 36.15 | 38.13 | 454 | 16,412 .10 | 17,311 .02 | - |
| 68824 9 | 晶合 集成 | 2023-0 4-24 | 6 个月 | 新股 锁定 | 19.86 | 18.06 | 2,604 | 51,715 .44 | 47,028 .24 | - |
| 68830 7 | 中润 光学 | 2023-0 2-08 | 6 个月 | 新股 锁定 | 23.88 | 31.73 | 2,455 | 58,625 .40 | 77,897 .15 | - |
| 68835 2 | 颀中 科技 | 2023-0 4-11 | 6 个月 | 新股 锁定 | 12.10 | 12.07 | 1,507 | 18,234 .70 | 18,189 .49 | - |
| 68836 1 | 中科 飞测 | 2023-0 5-12 | 6 个月 | 新股 锁定 | 23.60 | 64.67 | 449 | 10,596 .40 | 29,036 .83 | - |
| 68842 9 | 时创 能源 | 2023-0 6-20 | 6 个月 | 新股 锁定 | 19.20 | 25.53 | 346 | 6,643. 20 | 8,833. 38 | - |
| 68843 3 | 华曙 高科 | 2023-0 4-07 | 6 个月 | 新股 锁定 | 26.66 | 31.50 | 418 | 11,143 .88 | 13,167 .00 | - |
| 68845 8 | 美芯 晟 | 2023-0 5-15 | 6 个月 | 新股 锁定 | 75.00 | 90.76 | 188 | 14,100 .00 | 17,062 .88 | - |
| 68846 9 | 中芯 集成 | 2023-0 4-28 | 6 个月 | 新股 锁定 | 5.69 | 5.41 | 4,865 | 27,681 .85 | 26,319 .65 | - |
| 68847 2 | 阿特 斯 | 2023-0 6-02 | 6 个月 | 新股 锁定 | 11.10 | 17.04 | 1,809 | 20,079 .90 | 30,825 .36 | - |
| 68847 8 | 晶升 股份 | 2023-0 4-13 | 6 个月 | 新股 锁定 | 32.52 | 42.37 | 402 | 13,073 .04 | 17,032 .74 | - |
| 68848 4 | 南芯 科技 | 2023-0 3-28 | 6 个月 | 新股 锁定 | 39.99 | 36.71 | 582 | 23,274 .18 | 21,365 .22 | - |
| 68851 2 | 慧智 微 | 2023-0 5-08 | 6 个月 | 新股 锁定 | 20.92 | 19.16 | 678 | 14,183 .76 | 12,990 .48 | - |
| 68852 3 | 航天 环宇 | 2023-0 5-26 | 6 个月 | 新股 锁定 | 21.86 | 23.85 | 472 | 10,317 .92 | 11,257 .20 | - |
| 68853 5 | 华海 诚科 | 2023-0 3-28 | 6 个月 | 新股 锁定 | 35.00 | 51.23 | 161 | 5,635. 00 | 8,248. 03 | - |
| 68855 2 | 航天 南湖 | 2023-0 5-08 | 6 个月 | 新股 锁定 | 21.17 | 23.50 | 594 | 12,574 .98 | 13,959 .00 | - |
| 68856 2 | 航天 软件 | 2023-0 5-15 | 6 个月 | 新股 锁定 | 12.68 | 22.31 | 726 | 9,205. 68 | 16,197 .06 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|----------|----------|--------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| 688581 | 安杰思 | 2023-05-12 | 6 个月 | 新股锁定 | 125.80 | 118.03 | 107 | 13,460.60 | 12,629.21 | - |
| 688593 | 新相微 | 2023-05-25 | 6 个月 | 新股锁定 | 11.18 | 14.59 | 959 | 10,721.62 | 13,991.81 | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023-06-30 | 1 个月内(含) | 新股未上市 | 55.00 | 55.00 | 1,251 | 68,805.00 | 68,805.00 | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023-06-30 | 6 个月 | 新股未上市并锁定 | 55.00 | 55.00 | 140 | 7,700.00 | 7,700.00 | - |
| 688631 | 莱斯信息 | 2023-06-19 | 6 个月 | 新股锁定 | 25.28 | 29.87 | 336 | 8,494.08 | 10,036.32 | - |

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 | 受限期 | 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 |
|--------|------|------------|----------|--------|--------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 118036 | 力合转债 | 2023-06-28 | 1 个月内(含) | 老股东配债 | 100.00 | 100.00 | 630 | 63,000.00 | 63,001.24 | - |

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 |
|--------|------|------------|--------|--------|------------|--------|----------|------------|------------|----|
| 601298 | 青岛港 | 2023-06-28 | 重大事项停牌 | 6.97 | 2023-07-03 | 7.40 | 49,342 | 286,915.54 | 343,913.74 | - |

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

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于信用良好的银行，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；在银行间同业市场进行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 2023 年 6 月 30 日，本基金持有除国债、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 0.21%（2022 年 12 月 31 日：0.02%）。

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 2023年6月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 18,300,845.54 | - |
| 合计 | 18,300,845.54 | - |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债。

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 2023年6月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 659,588.57 | - |
| AAA 以下 | 275,906.39 | 215,922.05 |
| 未评级 | - | 43,859,969.84 |
| 合计 | 935,494.96 | 44,075,891.89 |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均能及时变现。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

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上市公司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%。

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。

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、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2023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 | 11,678,044.34 | - | - | - | 11,678,044.34 |
| 结算备付金 | 81,427,350.35 | - | - | - | 81,427,350.35 |
| 存出保证金 | 225,174.22 | - | - | 33,217,576.08 | 33,442,750.30 |
| 交易性金融资产 | 18,300,845.54 | 872,493.72 | 63,001.24 | 301,532,668.08 | 320,769,008.58 |
| 应收清算款 | - | - | - | 1,113,434.93 | 1,113,434.93 |
| 应收申购款 | - | - | - | 61,681.46 | 61,681.46 |
| 资产总计 | 111,631,414.45 | 872,493.72 | 63,001.24 | 335,925,360.55 | 448,492,269.96 |
| 负债 | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | 364,351.80 | 364,351.80 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 2,896,496.58 | 2,896,496.58 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 555,570.30 | 555,570.30 |
| 应付托管费 | - | - | - | 92,595.04 | 92,595.04 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 10,122.18 | 10,122.18 |
| 应交税费 | - | - | - | 23.75 | 23.75 |
| 其他负债 | - | - | - | 872,328.75 | 872,328.75 |
| 负债总计 | - | - | - | 4,791,488.40 | 4,791,488.40 |
| 利率敏感度缺口 | 111,631,414.45 | 872,493.72 | 63,001.24 | 331,133,872.15 | 443,700,781.56 |
| 上年度末 2022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 | 11,409,387.61 | - | - | - | 11,409,387.61 |
| 结算备付金 | 188,182,118.01 | - | - | - | 188,182,118.01 |
| 存出保证金 | 500,501.22 | - | - | 62,759,747.20 | 63,260,248.42 |
| 交易性金融资产 | 43,859,969.84 | 1,086.31 | 214,835.74 | 543,808,508.70 | 587,884,400.59 |
| 买入返售金融资产 | -5,830.13 | - | - | - | -5,830.13 |
| 应收清算款 | - | - | - | 20,797,756.59 | 20,797,756.59 |
| 应收申购款 | - | - | - | 55,751.11 | 55,751.11 |
| 资产总计 | 243,946,146.55 | 1,086.31 | 214,835.74 | 627,421,763.60 | 871,583,832.20 |
| 负债 | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | 1,900,338.13 | 1,900,338.13 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 307,788.83 | 307,788.83 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,169,663.61 | 1,169,663.61 |
| 应付托管费 | - | - | - | 194,943.96 | 194,943.96 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 18,645.19 | 18,645.19 |
| 应交税费 | - | - | - | 538.33 | 538.33 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,264,549.64 | 1,264,549.64 |
| 负债总计 | - | - | - | 4,856,467.69 | 4,856,467.69 |
| 利率敏感度缺口 | 243,946,146.55 | 1,086.31 | 214,835.74 | 622,565,295.91 | 866,727,364.51 |

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 2023年6月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -33,543.03 | -56,604.82 |
| 市场利率下降 25 个基点 | 33,755.47 | 56,855.82 | |

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 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2022 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 | 301,532,668. | 67.96 | 543,808,508.7 | 62.74 |

| | | | | |
|---------------|-----------------------|--------------|-----------------------|--------------|
| | 08 | | 0 | |
| 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 | 301,532,668.08 | 67.96 | 543,808,508.70 | 62.74 |

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(附注 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 2023年6月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| | 1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5% | 1,417,412.71 | 4,862,444.33 |
| | 2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5% | -1,417,412.71 | -4,862,444.33 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023年6月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次 | 300,788,664.35 | 542,271,797.25 |

| | | |
|------|----------------|----------------|
| 第二层次 | 19,156,644.22 | 44,405,779.80 |
| 第三层次 | 823,700.01 | 1,206,823.54 |
| 合计 | 320,769,008.58 | 587,884,400.59 |

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，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，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不会将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2022 年 12 月 31 日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的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。

6.4.15 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 | 301,532,668.08 | 67.23 |
| | 其中：股票 | 301,532,668.08 | 67.23 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 19,236,340.50 | 4.29 |
| | 其中：债券 | 19,236,340.50 | 4.29 |
| | 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 | 93,105,394.69 | 20.76 |
| 8 | 其他各项资产 | 34,617,866.69 | 7.72 |
| 9 | 合计 | 448,492,269.96 | 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 | 142,688.52 | 0.03 |
| B | 采矿业 | 5,411,868.64 | 1.22 |
| C | 制造业 | 194,252,854.74 | 43.78 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 6,189,774.44 | 1.40 |
| E | 建筑业 | 10,377,996.95 | 2.34 |
| F | 批发和零售业 | 6,273,009.87 | 1.41 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,954,002.26 | 0.89 |
| H | 住宿和餐饮业 | 743,692.75 | 0.17 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 28,304,020.44 | 6.38 |
| J | 金融业 | 20,138,867.94 | 4.54 |
| K | 房地产业 | 8,487,183.52 | 1.91 |
| L | 租赁和商务服务业 | 5,350,403.31 | 1.21 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 6,899,436.57 | 1.55 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,006,071.72 | 0.23 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 22,263.90 | 0.01 |
| Q | 卫生和社会工作 | 1,501,148.91 | 0.34 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 2,477,383.60 | 0.56 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 301,532,668.08 | 67.96 |

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 | 3,435 | 5,808,585.00 | 1.31 |
| 2 | 000063 | 中兴通讯 | 98,081 | 4,466,608.74 | 1.01 |
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 19,162 | 4,384,073.98 | 0.99 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 66,406 | 3,912,641.52 | 0.88 |
| 5 | 600919 | 江苏银行 | 445,416 | 3,273,807.60 | 0.74 |
| 6 | 600036 | 招商银行 | 96,787 | 3,170,742.12 | 0.71 |
| 7 | 601668 | 中国建筑 | 523,607 | 3,005,504.18 | 0.68 |
| 8 | 300274 | 阳光电源 | 25,088 | 2,926,013.44 | 0.66 |
| 9 | 000858 | 五粮液 | 16,239 | 2,656,213.23 | 0.60 |
| 10 | 300760 | 迈瑞医疗 | 8,659 | 2,595,968.20 | 0.59 |
| 11 | 300316 | 晶盛机电 | 31,313 | 2,220,091.70 | 0.50 |
| 12 | 600325 | 华发股份 | 223,219 | 2,198,707.15 | 0.50 |
| 13 | 601318 | 中国平安 | 44,822 | 2,079,740.80 | 0.47 |
| 14 | 601058 | 赛轮轮胎 | 180,600 | 2,057,034.00 | 0.46 |
| 15 | 001979 | 招商蛇口 | 153,750 | 2,003,362.50 | 0.45 |
| 16 | 002555 | 三七互娱 | 54,613 | 1,904,901.44 | 0.43 |
| 17 | 002126 | 银轮股份 | 100,076 | 1,771,345.20 | 0.40 |
| 18 | 603444 | 吉比特 | 3,563 | 1,749,824.93 | 0.39 |
| 19 | 600131 | 国网信通 | 85,700 | 1,730,283.00 | 0.39 |
| 20 | 300146 | 汤臣倍健 | 69,963 | 1,677,712.74 | 0.38 |
| 21 | 002371 | 北方华创 | 5,050 | 1,604,132.50 | 0.36 |
| 22 | 002517 | 恺英网络 | 101,400 | 1,596,036.00 | 0.36 |
| 23 | 600566 | 济川药业 | 54,288 | 1,576,523.52 | 0.36 |
| 24 | 600415 | 小商品城 | 183,863 | 1,568,351.39 | 0.35 |
| 25 | 600030 | 中信证券 | 77,638 | 1,535,679.64 | 0.35 |
| 26 | 600803 | 新奥股份 | 80,688 | 1,531,458.24 | 0.35 |
| 27 | 601567 | 三星医疗 | 119,300 | 1,506,759.00 | 0.34 |
| 28 | 002011 | 盾安环境 | 102,600 | 1,418,958.00 | 0.32 |
| 29 | 600941 | 中国移动 | 14,662 | 1,367,964.60 | 0.31 |
| 30 | 603129 | 春风动力 | 8,447 | 1,367,569.30 | 0.31 |
| 31 | 601899 | 紫金矿业 | 117,161 | 1,332,120.57 | 0.30 |
| 32 | 600048 | 保利发展 | 102,089 | 1,330,219.67 | 0.30 |
| 33 | 600426 | 华鲁恒升 | 42,525 | 1,302,540.75 | 0.29 |
| 34 | 002050 | 三花智控 | 42,905 | 1,298,305.30 | 0.29 |
| 35 | 688332 | 中科蓝讯 | 15,461 | 1,293,776.48 | 0.29 |
| 36 | 601211 | 国泰君安 | 91,700 | 1,282,883.00 | 0.29 |
| 37 | 000400 | 许继电气 | 54,704 | 1,260,927.20 | 0.28 |
| 38 | 601377 | 兴业证券 | 201,116 | 1,230,829.92 | 0.28 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 39 | 600572 | 康恩贝 | 177,600 | 1,216,560.00 | 0.27 |
| 40 | 603993 | 洛阳钼业 | 225,538 | 1,202,117.54 | 0.27 |
| 41 | 002318 | 久立特材 | 69,882 | 1,190,090.46 | 0.27 |
| 42 | 002345 | 潮宏基 | 150,200 | 1,180,572.00 | 0.27 |
| 43 | 002705 | 新宝股份 | 65,300 | 1,177,359.00 | 0.27 |
| 44 | 601138 | 工业富联 | 44,500 | 1,121,400.00 | 0.25 |
| 45 | 002154 | 报喜鸟 | 202,663 | 1,118,699.76 | 0.25 |
| 46 | 002027 | 分众传媒 | 160,800 | 1,095,048.00 | 0.25 |
| 47 | 300130 | 新国都 | 38,500 | 1,090,705.00 | 0.25 |
| 48 | 300773 | 拉卡拉 | 62,119 | 1,083,355.36 | 0.24 |
| 49 | 000568 | 泸州老窖 | 5,152 | 1,079,704.64 | 0.24 |
| 50 | 601117 | 中国化学 | 128,043 | 1,060,196.04 | 0.24 |
| 51 | 000338 | 潍柴动力 | 79,800 | 994,308.00 | 0.22 |
| 52 | 300592 | 华凯易佰 | 35,600 | 969,032.00 | 0.22 |
| 53 | 601390 | 中国中铁 | 127,700 | 967,966.00 | 0.22 |
| 54 | 002851 | 麦格米特 | 26,500 | 966,455.00 | 0.22 |
| 55 | 600079 | 人福医药 | 34,538 | 930,453.72 | 0.21 |
| 56 | 603187 | 海容冷链 | 46,414 | 927,815.86 | 0.21 |
| 57 | 600861 | 北京人力 | 39,738 | 921,921.60 | 0.21 |
| 58 | 600511 | 国药股份 | 23,400 | 909,090.00 | 0.20 |
| 59 | 600908 | 无锡银行 | 169,198 | 906,901.28 | 0.20 |
| 60 | 000811 | 冰轮环境 | 57,544 | 906,893.44 | 0.20 |
| 61 | 002063 | 远光软件 | 101,900 | 884,492.00 | 0.20 |
| 62 | 600309 | 万华化学 | 10,039 | 881,825.76 | 0.20 |
| 63 | 000589 | 贵州轮胎 | 156,319 | 875,386.40 | 0.20 |
| 64 | 000988 | 华工科技 | 23,025 | 875,180.25 | 0.20 |
| 65 | 688621 | 阳光诺和 | 14,828 | 872,182.96 | 0.20 |
| 66 | 603801 | 志邦家居 | 25,800 | 851,916.00 | 0.19 |
| 67 | 300770 | 新媒股份 | 18,300 | 839,238.00 | 0.19 |
| 68 | 300887 | 谱尼测试 | 21,038 | 832,684.04 | 0.19 |
| 69 | 600600 | 青岛啤酒 | 8,013 | 830,387.19 | 0.19 |
| 70 | 000933 | 神火股份 | 63,072 | 819,936.00 | 0.18 |
| 71 | 002139 | 拓邦股份 | 62,620 | 817,191.00 | 0.18 |
| 72 | 002984 | 森麒麟 | 25,244 | 794,176.24 | 0.18 |
| 73 | 002727 | 一心堂 | 29,900 | 789,360.00 | 0.18 |
| 74 | 600989 | 宝丰能源 | 62,567 | 788,969.87 | 0.18 |
| 75 | 601398 | 工商银行 | 162,200 | 781,804.00 | 0.18 |
| 76 | 601126 | 四方股份 | 51,200 | 777,728.00 | 0.18 |
| 77 | 600901 | 江苏金租 | 187,505 | 774,395.65 | 0.17 |
| 78 | 000960 | 锡业股份 | 49,700 | 772,835.00 | 0.17 |
| 79 | 601717 | 郑煤机 | 61,803 | 769,447.35 | 0.17 |
| 80 | 300476 | 胜宏科技 | 31,850 | 767,903.50 | 0.17 |
| 81 | 002402 | 和而泰 | 45,024 | 764,507.52 | 0.17 |
| 82 | 002335 | 科华数据 | 21,200 | 762,140.00 | 0.17 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 83 | 000921 | 海信家电 | 28,137 | 758,292.15 | 0.17 |
| 84 | 601689 | 拓普集团 | 9,388 | 757,611.60 | 0.17 |
| 85 | 301061 | 匠心家居 | 20,300 | 750,085.00 | 0.17 |
| 86 | 002987 | 京北方 | 34,010 | 745,499.20 | 0.17 |
| 87 | 600258 | 首旅酒店 | 39,245 | 743,692.75 | 0.17 |
| 88 | 600027 | 华电国际 | 109,800 | 734,562.00 | 0.17 |
| 89 | 688128 | 中国电研 | 28,789 | 734,119.50 | 0.17 |
| 90 | 000733 | 振华科技 | 7,594 | 727,884.90 | 0.16 |
| 91 | 002483 | 润邦股份 | 123,572 | 716,717.60 | 0.16 |
| 92 | 002266 | 浙富控股 | 173,500 | 716,555.00 | 0.16 |
| 93 | 002990 | 盛视科技 | 19,400 | 713,920.00 | 0.16 |
| 94 | 002475 | 立讯精密 | 21,791 | 707,117.95 | 0.16 |
| 95 | 300059 | 东方财富 | 49,772 | 706,762.40 | 0.16 |
| 96 | 603305 | 旭升集团 | 25,126 | 700,261.62 | 0.16 |
| 97 | 603298 | 杭叉集团 | 29,477 | 694,183.35 | 0.16 |
| 98 | 600582 | 天地科技 | 118,600 | 691,438.00 | 0.16 |
| 99 | 300982 | 苏文电能 | 11,400 | 690,384.00 | 0.16 |
| 100 | 600138 | 中青旅 | 55,000 | 688,050.00 | 0.16 |
| 101 | 002073 | 软控股份 | 103,120 | 682,654.40 | 0.15 |
| 102 | 603308 | 应流股份 | 37,300 | 682,590.00 | 0.15 |
| 103 | 688202 | 美迪西 | 8,000 | 682,000.00 | 0.15 |
| 104 | 688239 | 航宇科技 | 9,725 | 680,263.75 | 0.15 |
| 105 | 601369 | 陕鼓动力 | 74,650 | 680,061.50 | 0.15 |
| 106 | 002271 | 东方雨虹 | 24,873 | 678,037.98 | 0.15 |
| 107 | 688589 | 力合微 | 16,642 | 677,995.08 | 0.15 |
| 108 | 688131 | 皓元医药 | 11,778 | 671,110.44 | 0.15 |
| 109 | 300687 | 赛意信息 | 23,900 | 663,942.00 | 0.15 |
| 110 | 600820 | 隧道股份 | 110,435 | 663,714.35 | 0.15 |
| 111 | 002135 | 东南网架 | 102,600 | 662,796.00 | 0.15 |
| 112 | 600835 | 上海机电 | 38,100 | 654,558.00 | 0.15 |
| 113 | 688626 | 翔宇医疗 | 14,153 | 644,103.03 | 0.15 |
| 114 | 600970 | 中材国际 | 50,513 | 644,040.75 | 0.15 |
| 115 | 688508 | 芯朋微 | 11,050 | 640,789.50 | 0.14 |
| 116 | 600885 | 宏发股份 | 20,111 | 640,535.35 | 0.14 |
| 117 | 002179 | 中航光电 | 14,035 | 636,487.25 | 0.14 |
| 118 | 603043 | 广州酒家 | 22,500 | 635,850.00 | 0.14 |
| 119 | 601877 | 正泰电器 | 22,991 | 635,701.15 | 0.14 |
| 120 | 601137 | 博威合金 | 40,823 | 635,205.88 | 0.14 |
| 121 | 600109 | 国金证券 | 72,344 | 627,222.48 | 0.14 |
| 122 | 603882 | 金城医学 | 8,300 | 626,650.00 | 0.14 |
| 123 | 002594 | 比亚迪 | 2,421 | 625,271.67 | 0.14 |
| 124 | 601601 | 中国太保 | 23,913 | 621,259.74 | 0.14 |
| 125 | 600710 | 苏美达 | 71,800 | 614,608.00 | 0.14 |
| 126 | 688385 | 复旦微电 | 12,239 | 613,173.90 | 0.14 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 127 | 002444 | 巨星科技 | 27,732 | 606,776.16 | 0.14 |
| 128 | 600004 | 白云机场 | 42,097 | 603,670.98 | 0.14 |
| 129 | 300183 | 东软载波 | 35,700 | 589,407.00 | 0.13 |
| 130 | 600185 | 格力地产 | 85,600 | 587,216.00 | 0.13 |
| 131 | 002367 | 康力电梯 | 64,000 | 584,320.00 | 0.13 |
| 132 | 601975 | 招商南油 | 204,000 | 583,440.00 | 0.13 |
| 133 | 600198 | 大唐电信 | 84,600 | 579,510.00 | 0.13 |
| 134 | 603530 | 神马电力 | 37,000 | 575,350.00 | 0.13 |
| 135 | 603927 | 中科软 | 14,900 | 574,544.00 | 0.13 |
| 136 | 601838 | 成都银行 | 46,866 | 572,233.86 | 0.13 |
| 137 | 300015 | 爱尔眼科 | 30,831 | 571,915.05 | 0.13 |
| 138 | 603345 | 安井食品 | 3,863 | 567,088.40 | 0.13 |
| 139 | 603338 | 浙江鼎力 | 10,100 | 565,701.00 | 0.13 |
| 140 | 300118 | 东方日升 | 22,057 | 565,320.91 | 0.13 |
| 141 | 002410 | 广联达 | 17,100 | 555,579.00 | 0.13 |
| 142 | 300533 | 冰川网络 | 11,000 | 549,560.00 | 0.12 |
| 143 | 300627 | 华测导航 | 16,901 | 548,775.47 | 0.12 |
| 144 | 002463 | 沪电股份 | 25,650 | 537,111.00 | 0.12 |
| 145 | 002415 | 海康威视 | 16,182 | 535,786.02 | 0.12 |
| 146 | 600267 | 海正药业 | 46,600 | 530,308.00 | 0.12 |
| 147 | 002384 | 东山精密 | 20,475 | 530,302.50 | 0.12 |
| 148 | 600028 | 中国石化 | 83,165 | 528,929.40 | 0.12 |
| 149 | 601700 | 风范股份 | 99,400 | 527,814.00 | 0.12 |
| 150 | 000028 | 国药一致 | 12,050 | 525,500.50 | 0.12 |
| 151 | 688389 | 普门科技 | 22,261 | 522,910.89 | 0.12 |
| 152 | 300223 | 北京君正 | 5,900 | 521,029.00 | 0.12 |
| 153 | 603667 | 五洲新春 | 34,934 | 519,817.92 | 0.12 |
| 154 | 002867 | 周大生 | 29,177 | 518,767.06 | 0.12 |
| 155 | 688100 | 威胜信息 | 17,252 | 514,282.12 | 0.12 |
| 156 | 300014 | 亿纬锂能 | 8,400 | 508,200.00 | 0.11 |
| 157 | 603118 | 共进股份 | 37,900 | 503,691.00 | 0.11 |
| 158 | 300494 | 盛天网络 | 20,304 | 503,336.16 | 0.11 |
| 159 | 601186 | 中国铁建 | 51,014 | 502,487.90 | 0.11 |
| 160 | 600064 | 南京高科 | 76,000 | 502,360.00 | 0.11 |
| 161 | 601857 | 中国石油 | 67,014 | 500,594.58 | 0.11 |
| 162 | 688161 | 威高骨科 | 11,500 | 498,065.00 | 0.11 |
| 163 | 600612 | 老凤祥 | 7,100 | 496,148.00 | 0.11 |
| 164 | 000922 | 佳电股份 | 37,038 | 487,420.08 | 0.11 |
| 165 | 603986 | 兆易创新 | 4,522 | 480,462.50 | 0.11 |
| 166 | 002651 | 利君股份 | 61,300 | 476,301.00 | 0.11 |
| 167 | 688559 | 海目星 | 10,100 | 474,801.00 | 0.11 |
| 168 | 002737 | 葵花药业 | 19,500 | 474,630.00 | 0.11 |
| 169 | 600809 | 山西汾酒 | 2,561 | 473,964.27 | 0.11 |
| 170 | 600570 | 恒生电子 | 10,700 | 473,903.00 | 0.11 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 171 | 601012 | 隆基绿能 | 16,495 | 472,911.65 | 0.11 |
| 172 | 600496 | 精工钢构 | 126,225 | 470,819.25 | 0.11 |
| 173 | 603508 | 思维列控 | 27,500 | 468,875.00 | 0.11 |
| 174 | 002461 | 珠江啤酒 | 53,181 | 468,524.61 | 0.11 |
| 175 | 002635 | 安洁科技 | 33,800 | 466,440.00 | 0.11 |
| 176 | 688499 | 利元亨 | 7,340 | 466,236.80 | 0.11 |
| 177 | 601000 | 唐山港 | 131,800 | 465,254.00 | 0.10 |
| 178 | 002907 | 华森制药 | 30,500 | 464,210.00 | 0.10 |
| 179 | 603212 | 赛伍技术 | 22,300 | 464,063.00 | 0.10 |
| 180 | 600690 | 海尔智家 | 19,700 | 462,556.00 | 0.10 |
| 181 | 002158 | 汉钟精机 | 18,500 | 461,760.00 | 0.10 |
| 182 | 002239 | 奥特佳 | 172,900 | 461,643.00 | 0.10 |
| 183 | 300206 | 理邦仪器 | 30,600 | 461,448.00 | 0.10 |
| 184 | 605009 | 豪悦护理 | 9,600 | 460,800.00 | 0.10 |
| 185 | 300408 | 三环集团 | 15,575 | 457,126.25 | 0.10 |
| 186 | 300866 | 安克创新 | 5,200 | 455,000.00 | 0.10 |
| 187 | 002469 | 三维化学 | 73,400 | 451,410.00 | 0.10 |
| 188 | 000002 | 万科A | 32,100 | 450,042.00 | 0.10 |
| 189 | 002389 | 航天彩虹 | 20,200 | 448,642.00 | 0.10 |
| 190 | 300587 | 天铁股份 | 57,700 | 444,290.00 | 0.10 |
| 191 | 600248 | 陕建股份 | 92,894 | 443,104.38 | 0.10 |
| 192 | 000725 | 京东方A | 107,644 | 440,263.96 | 0.10 |
| 193 | 688680 | 海优新材 | 3,600 | 438,552.00 | 0.10 |
| 194 | 000032 | 深桑达A | 13,300 | 437,570.00 | 0.10 |
| 195 | 300416 | 苏试试验 | 20,269 | 436,999.64 | 0.10 |
| 196 | 000030 | 富奥股份 | 86,700 | 436,968.00 | 0.10 |
| 197 | 600557 | 康缘药业 | 15,800 | 433,868.00 | 0.10 |
| 198 | 688123 | 聚辰股份 | 8,060 | 432,983.20 | 0.10 |
| 199 | 603889 | 新澳股份 | 57,500 | 431,825.00 | 0.10 |
| 200 | 002405 | 四维图新 | 36,800 | 426,144.00 | 0.10 |
| 201 | 002244 | 滨江集团 | 48,219 | 425,291.58 | 0.10 |
| 202 | 300347 | 泰格医药 | 6,554 | 422,995.16 | 0.10 |
| 203 | 002138 | 顺络电子 | 17,382 | 415,603.62 | 0.09 |
| 204 | 300502 | 新易盛 | 6,100 | 414,617.00 | 0.09 |
| 205 | 600850 | 电科数字 | 17,500 | 412,825.00 | 0.09 |
| 206 | 002518 | 科士达 | 10,300 | 412,103.00 | 0.09 |
| 207 | 300487 | 蓝晓科技 | 6,552 | 408,975.84 | 0.09 |
| 208 | 003029 | 吉大正元 | 12,600 | 408,870.00 | 0.09 |
| 209 | 688556 | 高测股份 | 7,665 | 407,318.10 | 0.09 |
| 210 | 605133 | 嵘泰股份 | 11,700 | 406,692.00 | 0.09 |
| 211 | 003006 | 百亚股份 | 23,344 | 403,384.32 | 0.09 |
| 212 | 601288 | 农业银行 | 114,102 | 402,780.06 | 0.09 |
| 213 | 300327 | 中颖电子 | 14,400 | 402,624.00 | 0.09 |
| 214 | 300532 | 今天国际 | 19,400 | 398,864.00 | 0.09 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 215 | 300938 | 信测标准 | 9,100 | 398,580.00 | 0.09 |
| 216 | 688376 | 美埃科技 | 10,049 | 396,835.01 | 0.09 |
| 217 | 003035 | 南网能源 | 55,700 | 396,584.00 | 0.09 |
| 218 | 002194 | 武汉凡谷 | 36,200 | 395,666.00 | 0.09 |
| 219 | 300203 | 聚光科技 | 19,500 | 395,265.00 | 0.09 |
| 220 | 603279 | 景津装备 | 12,600 | 395,136.00 | 0.09 |
| 221 | 002242 | 九阳股份 | 26,400 | 394,680.00 | 0.09 |
| 222 | 002611 | 东方精工 | 68,400 | 392,616.00 | 0.09 |
| 223 | 300358 | 楚天科技 | 26,269 | 392,196.17 | 0.09 |
| 224 | 002075 | 沙钢股份 | 97,800 | 392,178.00 | 0.09 |
| 225 | 000928 | 中钢国际 | 40,600 | 391,790.00 | 0.09 |
| 226 | 600900 | 长江电力 | 17,721 | 390,925.26 | 0.09 |
| 227 | 601800 | 中国交建 | 35,700 | 389,487.00 | 0.09 |
| 228 | 002046 | 国机精工 | 30,500 | 389,180.00 | 0.09 |
| 229 | 300377 | 赢时胜 | 47,900 | 387,990.00 | 0.09 |
| 230 | 300351 | 永贵电器 | 23,600 | 387,748.00 | 0.09 |
| 231 | 603699 | 纽威股份 | 26,044 | 387,534.72 | 0.09 |
| 232 | 603035 | 常熟汽饰 | 19,900 | 386,657.00 | 0.09 |
| 233 | 002270 | 华明装备 | 35,300 | 386,535.00 | 0.09 |
| 234 | 605167 | 利柏特 | 39,800 | 385,264.00 | 0.09 |
| 235 | 002859 | 洁美科技 | 13,900 | 385,030.00 | 0.09 |
| 236 | 002636 | 金安国纪 | 41,700 | 384,891.00 | 0.09 |
| 237 | 688588 | 凌志软件 | 24,693 | 383,976.15 | 0.09 |
| 238 | 600458 | 时代新材 | 31,900 | 382,481.00 | 0.09 |
| 239 | 001696 | 宗申动力 | 53,900 | 381,612.00 | 0.09 |
| 240 | 002454 | 松芝股份 | 45,000 | 381,150.00 | 0.09 |
| 241 | 688019 | 安集科技 | 2,309 | 380,592.47 | 0.09 |
| 242 | 300124 | 汇川技术 | 5,918 | 379,994.78 | 0.09 |
| 243 | 002170 | 芭田股份 | 55,300 | 379,911.00 | 0.09 |
| 244 | 688660 | 电气风电 | 68,200 | 379,874.00 | 0.09 |
| 245 | 600184 | 光电股份 | 28,900 | 379,457.00 | 0.09 |
| 246 | 300820 | 英杰电气 | 4,600 | 378,948.00 | 0.09 |
| 247 | 601702 | 华峰铝业 | 27,600 | 377,568.00 | 0.09 |
| 248 | 603259 | 药明康德 | 6,059 | 377,536.29 | 0.09 |
| 249 | 000932 | 华菱钢铁 | 79,049 | 377,063.73 | 0.08 |
| 250 | 688037 | 芯源微 | 2,199 | 375,919.05 | 0.08 |
| 251 | 000938 | 紫光股份 | 11,787 | 375,415.95 | 0.08 |
| 252 | 300395 | 菲利华 | 7,600 | 373,920.00 | 0.08 |
| 253 | 002674 | 兴业科技 | 30,200 | 372,970.00 | 0.08 |
| 254 | 600223 | 福瑞达 | 36,100 | 370,386.00 | 0.08 |
| 255 | 300993 | 玉马遮阳 | 32,300 | 369,835.00 | 0.08 |
| 256 | 688009 | 中国通号 | 63,636 | 369,088.80 | 0.08 |
| 257 | 600862 | 中航高科 | 14,563 | 368,589.53 | 0.08 |
| 258 | 300628 | 亿联网络 | 10,500 | 368,235.00 | 0.08 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 259 | 300908 | 仲景食品 | 8,100 | 367,335.00 | 0.08 |
| 260 | 002533 | 金杯电工 | 45,000 | 367,200.00 | 0.08 |
| 261 | 300133 | 华策影视 | 51,740 | 366,836.60 | 0.08 |
| 262 | 601225 | 陕西煤业 | 20,100 | 365,619.00 | 0.08 |
| 263 | 605020 | 永和股份 | 14,160 | 365,469.60 | 0.08 |
| 264 | 600933 | 爱柯迪 | 15,670 | 364,954.30 | 0.08 |
| 265 | 002068 | 黑猫股份 | 30,700 | 364,409.00 | 0.08 |
| 266 | 601728 | 中国电信 | 64,721 | 364,379.23 | 0.08 |
| 267 | 002334 | 英威腾 | 28,300 | 360,542.00 | 0.08 |
| 268 | 601333 | 广深铁路 | 90,900 | 359,964.00 | 0.08 |
| 269 | 002929 | 润建股份 | 8,280 | 359,434.80 | 0.08 |
| 270 | 600009 | 上海机场 | 7,912 | 359,363.04 | 0.08 |
| 271 | 300406 | 九强生物 | 15,400 | 359,282.00 | 0.08 |
| 272 | 600060 | 海信视像 | 14,513 | 359,196.75 | 0.08 |
| 273 | 002878 | 元隆雅图 | 20,200 | 358,348.00 | 0.08 |
| 274 | 601766 | 中国中车 | 54,800 | 356,200.00 | 0.08 |
| 275 | 300109 | 新开源 | 14,300 | 355,641.00 | 0.08 |
| 276 | 603690 | 至纯科技 | 10,200 | 355,368.00 | 0.08 |
| 277 | 603507 | 振江股份 | 9,800 | 355,348.00 | 0.08 |
| 278 | 002051 | 中工国际 | 29,700 | 354,321.00 | 0.08 |
| 279 | 600674 | 川投能源 | 23,518 | 353,945.90 | 0.08 |
| 280 | 300308 | 中际旭创 | 2,400 | 353,880.00 | 0.08 |
| 281 | 000883 | 湖北能源 | 77,500 | 353,400.00 | 0.08 |
| 282 | 600422 | 昆药集团 | 17,000 | 352,240.00 | 0.08 |
| 283 | 600285 | 羚锐制药 | 21,800 | 350,108.00 | 0.08 |
| 284 | 002014 | 永新股份 | 40,200 | 348,936.00 | 0.08 |
| 285 | 300031 | 宝通科技 | 14,100 | 348,552.00 | 0.08 |
| 286 | 601869 | 长飞光纤 | 9,400 | 347,894.00 | 0.08 |
| 287 | 300291 | 百纳千成 | 49,200 | 346,368.00 | 0.08 |
| 288 | 002605 | 姚记科技 | 7,450 | 345,903.50 | 0.08 |
| 289 | 002965 | 祥鑫科技 | 6,200 | 345,216.00 | 0.08 |
| 290 | 601298 | 青岛港 | 49,342 | 343,913.74 | 0.08 |
| 291 | 300607 | 拓斯达 | 22,800 | 342,684.00 | 0.08 |
| 292 | 600276 | 恒瑞医药 | 7,100 | 340,090.00 | 0.08 |
| 293 | 002966 | 苏州银行 | 51,900 | 339,945.00 | 0.08 |
| 294 | 300856 | 科思股份 | 4,300 | 338,711.00 | 0.08 |
| 295 | 000690 | 宝新能源 | 48,217 | 338,483.34 | 0.08 |
| 296 | 603806 | 福斯特 | 9,100 | 338,429.00 | 0.08 |
| 297 | 600977 | 中国电影 | 24,000 | 337,200.00 | 0.08 |
| 298 | 605368 | 蓝天燃气 | 34,860 | 333,610.20 | 0.08 |
| 299 | 002815 | 崇达技术 | 26,711 | 332,551.95 | 0.07 |
| 300 | 002648 | 卫星化学 | 22,219 | 332,396.24 | 0.07 |
| 301 | 300068 | 南都电源 | 17,100 | 331,056.00 | 0.07 |
| 302 | 000997 | 新大陆 | 17,500 | 330,750.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 303 | 600720 | 祁连山 | 29,081 | 330,650.97 | 0.07 |
| 304 | 600531 | 豫光金铅 | 52,100 | 328,230.00 | 0.07 |
| 305 | 603018 | 华设集团 | 37,500 | 328,125.00 | 0.07 |
| 306 | 600283 | 钱江水利 | 22,500 | 327,375.00 | 0.07 |
| 307 | 300634 | 彩讯股份 | 12,400 | 327,360.00 | 0.07 |
| 308 | 603008 | 喜临门 | 13,000 | 327,340.00 | 0.07 |
| 309 | 300065 | 海兰信 | 26,400 | 327,096.00 | 0.07 |
| 310 | 301367 | 怡和嘉业 | 2,200 | 326,348.00 | 0.07 |
| 311 | 603348 | 文灿股份 | 7,400 | 324,194.00 | 0.07 |
| 312 | 002583 | 海能达 | 55,700 | 323,617.00 | 0.07 |
| 313 | 002434 | 万里扬 | 36,100 | 323,095.00 | 0.07 |
| 314 | 000791 | 甘肃能源 | 61,500 | 321,645.00 | 0.07 |
| 315 | 301195 | 北路智控 | 6,900 | 321,264.00 | 0.07 |
| 316 | 688425 | 铁建重工 | 66,722 | 320,932.82 | 0.07 |
| 317 | 002062 | 宏润建设 | 59,000 | 319,190.00 | 0.07 |
| 318 | 002467 | 二六三 | 64,200 | 319,074.00 | 0.07 |
| 319 | 688526 | 科前生物 | 13,400 | 318,786.00 | 0.07 |
| 320 | 600619 | 海立股份 | 49,100 | 318,659.00 | 0.07 |
| 321 | 002832 | 比音勒芬 | 8,962 | 317,344.42 | 0.07 |
| 322 | 688110 | 东芯股份 | 8,779 | 316,921.90 | 0.07 |
| 323 | 002690 | 美亚光电 | 12,300 | 316,725.00 | 0.07 |
| 324 | 300860 | 锋尚文化 | 5,700 | 316,008.00 | 0.07 |
| 325 | 002382 | 蓝帆医疗 | 43,800 | 314,484.00 | 0.07 |
| 326 | 300590 | 移为通信 | 25,700 | 314,054.00 | 0.07 |
| 327 | 605338 | 巴比食品 | 12,400 | 313,100.00 | 0.07 |
| 328 | 300653 | 正海生物 | 9,100 | 312,949.00 | 0.07 |
| 329 | 002236 | 大华股份 | 15,800 | 312,050.00 | 0.07 |
| 330 | 002106 | 莱宝高科 | 36,700 | 311,950.00 | 0.07 |
| 331 | 002176 | 江特电机 | 26,100 | 311,112.00 | 0.07 |
| 332 | 002790 | 瑞尔特 | 32,200 | 309,120.00 | 0.07 |
| 333 | 000821 | 京山轻机 | 15,065 | 308,229.90 | 0.07 |
| 334 | 300525 | 博思软件 | 20,040 | 307,413.60 | 0.07 |
| 335 | 002738 | 中矿资源 | 6,020 | 306,658.80 | 0.07 |
| 336 | 300470 | 中密控股 | 6,600 | 305,052.00 | 0.07 |
| 337 | 300679 | 电连技术 | 9,200 | 304,060.00 | 0.07 |
| 338 | 002035 | 华帝股份 | 42,753 | 303,546.30 | 0.07 |
| 339 | 600996 | 贵广网络 | 30,841 | 302,858.62 | 0.07 |
| 340 | 600373 | 中文传媒 | 22,700 | 302,364.00 | 0.07 |
| 341 | 688116 | 天奈科技 | 6,600 | 301,950.00 | 0.07 |
| 342 | 002311 | 海大集团 | 6,428 | 301,087.52 | 0.07 |
| 343 | 603938 | 三孚股份 | 15,200 | 300,808.00 | 0.07 |
| 344 | 300725 | 药石科技 | 6,200 | 300,266.00 | 0.07 |
| 345 | 002049 | 紫光国微 | 3,220 | 300,265.00 | 0.07 |
| 346 | 603799 | 华友钴业 | 6,537 | 300,113.67 | 0.07 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 347 | 000596 | 古井贡酒 | 1,212 | 299,824.56 | 0.07 |
| 348 | 605377 | 华旺科技 | 16,600 | 299,630.00 | 0.07 |
| 349 | 688301 | 奕瑞科技 | 1,060 | 299,375.80 | 0.07 |
| 350 | 600562 | 国睿科技 | 18,478 | 299,343.60 | 0.07 |
| 351 | 300655 | 晶瑞电材 | 15,000 | 298,650.00 | 0.07 |
| 352 | 002376 | 新北洋 | 36,900 | 297,783.00 | 0.07 |
| 353 | 300777 | 中简科技 | 6,300 | 297,738.00 | 0.07 |
| 354 | 688257 | 新锐股份 | 11,183 | 296,461.33 | 0.07 |
| 355 | 300803 | 指南针 | 6,100 | 296,399.00 | 0.07 |
| 356 | 688396 | 华润微 | 5,653 | 296,273.73 | 0.07 |
| 357 | 000517 | 荣安地产 | 96,700 | 294,935.00 | 0.07 |
| 358 | 688390 | 固德威 | 1,765 | 294,507.90 | 0.07 |
| 359 | 002664 | 信质集团 | 20,900 | 294,272.00 | 0.07 |
| 360 | 300662 | 科锐国际 | 8,300 | 293,571.00 | 0.07 |
| 361 | 600066 | 宇通客车 | 19,900 | 293,326.00 | 0.07 |
| 362 | 002130 | 沃尔核材 | 36,100 | 293,132.00 | 0.07 |
| 363 | 300035 | 中科电气 | 24,300 | 292,086.00 | 0.07 |
| 364 | 688596 | 正帆科技 | 6,739 | 291,798.70 | 0.07 |
| 365 | 600559 | 老白干酒 | 11,900 | 291,669.00 | 0.07 |
| 366 | 300433 | 蓝思科技 | 24,800 | 291,648.00 | 0.07 |
| 367 | 688330 | 宏力达 | 8,300 | 291,164.00 | 0.07 |
| 368 | 003000 | 劲仔食品 | 23,122 | 291,105.98 | 0.07 |
| 369 | 300768 | 迪普科技 | 17,400 | 288,318.00 | 0.06 |
| 370 | 603877 | 太平鸟 | 11,400 | 288,192.00 | 0.06 |
| 371 | 688356 | 键凯科技 | 2,700 | 287,685.00 | 0.06 |
| 372 | 603866 | 桃李面包 | 28,400 | 287,408.00 | 0.06 |
| 373 | 300699 | 光威复材 | 9,300 | 286,905.00 | 0.06 |
| 374 | 300451 | 创业慧康 | 34,200 | 286,596.00 | 0.06 |
| 375 | 601222 | 林洋能源 | 34,966 | 286,371.54 | 0.06 |
| 376 | 600597 | 光明乳业 | 27,500 | 286,000.00 | 0.06 |
| 377 | 688059 | 华锐精密 | 3,400 | 284,750.00 | 0.06 |
| 378 | 600176 | 中国巨石 | 20,097 | 284,573.52 | 0.06 |
| 379 | 603758 | 秦安股份 | 26,600 | 283,024.00 | 0.06 |
| 380 | 603589 | 口子窖 | 5,700 | 281,295.00 | 0.06 |
| 381 | 603681 | 永冠新材 | 19,500 | 278,460.00 | 0.06 |
| 382 | 000559 | 万向钱潮 | 49,800 | 271,410.00 | 0.06 |
| 383 | 000683 | 远兴能源 | 37,603 | 270,365.57 | 0.06 |
| 384 | 000990 | 诚志股份 | 35,200 | 268,224.00 | 0.06 |
| 385 | 600587 | 新华医疗 | 7,590 | 268,154.70 | 0.06 |
| 386 | 000058 | 深赛格 | 43,200 | 266,976.00 | 0.06 |
| 387 | 002283 | 天润工业 | 41,500 | 266,430.00 | 0.06 |
| 388 | 000550 | 江铃汽车 | 19,200 | 265,728.00 | 0.06 |
| 389 | 688698 | 伟创电气 | 6,643 | 265,587.14 | 0.06 |
| 390 | 300792 | 壹网壹创 | 9,600 | 264,672.00 | 0.06 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 391 | 002142 | 宁波银行 | 10,456 | 264,536.80 | 0.06 |
| 392 | 300685 | 艾德生物 | 10,900 | 264,434.00 | 0.06 |
| 393 | 688617 | 惠泰医疗 | 700 | 261,625.00 | 0.06 |
| 394 | 002180 | 纳思达 | 7,610 | 260,642.50 | 0.06 |
| 395 | 002572 | 索菲亚 | 14,920 | 259,906.40 | 0.06 |
| 396 | 603123 | 翠微股份 | 26,600 | 259,084.00 | 0.06 |
| 397 | 688233 | 神工股份 | 8,200 | 258,956.00 | 0.06 |
| 398 | 300767 | 震安科技 | 10,100 | 256,136.00 | 0.06 |
| 399 | 002508 | 老板电器 | 10,100 | 255,429.00 | 0.06 |
| 400 | 600755 | 厦门国贸 | 32,969 | 255,180.06 | 0.06 |
| 401 | 000729 | 燕京啤酒 | 20,400 | 254,388.00 | 0.06 |
| 402 | 300019 | 硅宝科技 | 14,911 | 254,232.55 | 0.06 |
| 403 | 601888 | 中国中免 | 2,294 | 253,555.82 | 0.06 |
| 404 | 000739 | 普洛药业 | 14,200 | 251,908.00 | 0.06 |
| 405 | 300438 | 鹏辉能源 | 5,200 | 249,808.00 | 0.06 |
| 406 | 600765 | 中航重机 | 9,393 | 249,008.43 | 0.06 |
| 407 | 601872 | 招商轮船 | 43,000 | 248,970.00 | 0.06 |
| 408 | 601208 | 东材科技 | 19,600 | 248,920.00 | 0.06 |
| 409 | 300379 | 东方通 | 12,100 | 248,897.00 | 0.06 |
| 410 | 002941 | 新疆交建 | 16,000 | 247,680.00 | 0.06 |
| 411 | 300012 | 华测检测 | 12,700 | 247,650.00 | 0.06 |
| 412 | 002918 | 蒙娜丽莎 | 16,000 | 247,040.00 | 0.06 |
| 413 | 300850 | 新强联 | 6,600 | 246,708.00 | 0.06 |
| 414 | 601636 | 旗滨集团 | 28,100 | 242,222.00 | 0.05 |
| 415 | 002064 | 华峰化学 | 35,072 | 240,593.92 | 0.05 |
| 416 | 300951 | 博硕科技 | 4,400 | 240,372.00 | 0.05 |
| 417 | 688575 | 亚辉龙 | 13,000 | 239,850.00 | 0.05 |
| 418 | 600497 | 驰宏锌锗 | 47,563 | 238,766.26 | 0.05 |
| 419 | 002932 | 明德生物 | 9,200 | 238,188.00 | 0.05 |
| 420 | 000156 | 华数传媒 | 27,300 | 237,510.00 | 0.05 |
| 421 | 300232 | 洲明科技 | 25,982 | 237,475.48 | 0.05 |
| 422 | 002540 | 亚太科技 | 40,300 | 232,934.00 | 0.05 |
| 423 | 603309 | 维力医疗 | 14,969 | 231,570.43 | 0.05 |
| 424 | 600741 | 华域汽车 | 12,518 | 231,082.28 | 0.05 |
| 425 | 002541 | 鸿路钢构 | 7,984 | 230,019.04 | 0.05 |
| 426 | 300251 | 光线传媒 | 28,300 | 228,947.00 | 0.05 |
| 427 | 600219 | 南山铝业 | 75,500 | 228,010.00 | 0.05 |
| 428 | 605499 | 东鹏饮料 | 1,300 | 224,770.00 | 0.05 |
| 429 | 603486 | 科沃斯 | 2,869 | 223,122.13 | 0.05 |
| 430 | 603369 | 今世缘 | 4,209 | 222,235.20 | 0.05 |
| 431 | 688345 | 博力威 | 5,970 | 221,546.70 | 0.05 |
| 432 | 603300 | 华铁应急 | 40,548 | 220,986.60 | 0.05 |
| 433 | 002243 | 力合科创 | 25,900 | 220,409.00 | 0.05 |
| 434 | 002698 | 博实股份 | 12,588 | 220,164.12 | 0.05 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 435 | 002304 | 洋河股份 | 1,674 | 219,879.90 | 0.05 |
| 436 | 600104 | 上汽集团 | 15,500 | 219,635.00 | 0.05 |
| 437 | 600990 | 四创电子 | 6,900 | 218,316.00 | 0.05 |
| 438 | 300811 | 铂科新材 | 3,600 | 213,984.00 | 0.05 |
| 439 | 002430 | 杭氧股份 | 6,196 | 212,894.56 | 0.05 |
| 440 | 300996 | 普联软件 | 6,900 | 211,830.00 | 0.05 |
| 441 | 601231 | 环旭电子 | 14,076 | 210,576.96 | 0.05 |
| 442 | 688002 | 睿创微纳 | 4,700 | 210,560.00 | 0.05 |
| 443 | 000708 | 中信特钢 | 13,273 | 210,244.32 | 0.05 |
| 444 | 002466 | 天齐锂业 | 3,000 | 209,730.00 | 0.05 |
| 445 | 601818 | 光大银行 | 68,300 | 209,681.00 | 0.05 |
| 446 | 601328 | 交通银行 | 36,000 | 208,800.00 | 0.05 |
| 447 | 000801 | 四川九洲 | 28,300 | 206,590.00 | 0.05 |
| 448 | 601088 | 中国神华 | 6,700 | 206,025.00 | 0.05 |
| 449 | 688133 | 泰坦科技 | 2,400 | 204,456.00 | 0.05 |
| 450 | 300759 | 康龙化成 | 5,200 | 199,056.00 | 0.04 |
| 451 | 301179 | 泽宇智能 | 5,800 | 195,460.00 | 0.04 |
| 452 | 000524 | 岭南控股 | 18,200 | 194,922.00 | 0.04 |
| 453 | 688560 | 明冠新材 | 7,000 | 194,530.00 | 0.04 |
| 454 | 002675 | 东诚药业 | 13,200 | 194,172.00 | 0.04 |
| 455 | 300853 | 申昊科技 | 5,400 | 189,540.00 | 0.04 |
| 456 | 688489 | 三未信安 | 2,953 | 186,777.25 | 0.04 |
| 457 | 002487 | 大金重工 | 6,016 | 185,533.44 | 0.04 |
| 458 | 688196 | 卓越新能 | 4,000 | 185,000.00 | 0.04 |
| 459 | 002643 | 万润股份 | 10,618 | 184,859.38 | 0.04 |
| 460 | 603208 | 江山欧派 | 5,070 | 184,649.40 | 0.04 |
| 461 | 002841 | 视源股份 | 2,729 | 182,406.36 | 0.04 |
| 462 | 600031 | 三一重工 | 10,932 | 181,799.16 | 0.04 |
| 463 | 001965 | 招商公路 | 18,847 | 180,931.20 | 0.04 |
| 464 | 002597 | 金禾实业 | 7,600 | 179,360.00 | 0.04 |
| 465 | 002439 | 启明星辰 | 6,000 | 178,560.00 | 0.04 |
| 466 | 300314 | 戴维医疗 | 8,400 | 177,576.00 | 0.04 |
| 467 | 000818 | 航锦科技 | 5,300 | 176,861.00 | 0.04 |
| 468 | 000543 | 皖能电力 | 26,700 | 176,220.00 | 0.04 |
| 469 | 688399 | 硕世生物 | 3,189 | 176,032.80 | 0.04 |
| 470 | 600057 | 厦门象屿 | 20,100 | 174,870.00 | 0.04 |
| 471 | 600510 | 黑牡丹 | 28,700 | 174,209.00 | 0.04 |
| 472 | 688599 | 天合光能 | 4,087 | 174,147.07 | 0.04 |
| 473 | 603050 | 科林电气 | 10,800 | 173,988.00 | 0.04 |
| 474 | 002900 | 哈三联 | 13,000 | 173,810.00 | 0.04 |
| 475 | 603466 | 风语筑 | 12,500 | 173,750.00 | 0.04 |
| 476 | 601166 | 兴业银行 | 11,100 | 173,715.00 | 0.04 |
| 477 | 600089 | 特变电工 | 7,788 | 173,594.52 | 0.04 |
| 478 | 002956 | 西麦食品 | 11,100 | 173,493.00 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 479 | 300077 | 国民技术 | 13,000 | 172,900.00 | 0.04 |
| 480 | 300267 | 尔康制药 | 53,500 | 172,805.00 | 0.04 |
| 481 | 603719 | 良品铺子 | 6,900 | 172,569.00 | 0.04 |
| 482 | 002171 | 楚江新材 | 24,200 | 172,304.00 | 0.04 |
| 483 | 300827 | 上能电气 | 4,778 | 172,246.90 | 0.04 |
| 484 | 600398 | 海澜之家 | 25,032 | 172,220.16 | 0.04 |
| 485 | 603053 | 成都燃气 | 17,100 | 172,197.00 | 0.04 |
| 486 | 300111 | 向日葵 | 55,900 | 172,172.00 | 0.04 |
| 487 | 603290 | 斯达半导 | 800 | 172,160.00 | 0.04 |
| 488 | 300080 | 易成新能 | 33,800 | 172,042.00 | 0.04 |
| 489 | 000034 | 神州数码 | 6,469 | 172,010.71 | 0.04 |
| 490 | 605090 | 九丰能源 | 7,700 | 171,941.00 | 0.04 |
| 491 | 002678 | 珠江钢琴 | 30,000 | 171,900.00 | 0.04 |
| 492 | 688030 | 山石网科 | 8,000 | 171,440.00 | 0.04 |
| 493 | 603027 | 千禾味业 | 8,100 | 171,072.00 | 0.04 |
| 494 | 002449 | 国星光电 | 19,200 | 170,688.00 | 0.04 |
| 495 | 600995 | 南网储能 | 15,500 | 170,655.00 | 0.04 |
| 496 | 600682 | 南京新百 | 21,300 | 170,613.00 | 0.04 |
| 497 | 003040 | 楚天龙 | 9,400 | 170,516.00 | 0.04 |
| 498 | 603776 | 永安行 | 11,800 | 169,920.00 | 0.04 |
| 499 | 002544 | 普天科技 | 7,400 | 169,460.00 | 0.04 |
| 500 | 300459 | 汤姆猫 | 26,000 | 168,740.00 | 0.04 |
| 501 | 300098 | 高新兴 | 46,200 | 168,630.00 | 0.04 |
| 502 | 603103 | 横店影视 | 10,000 | 168,400.00 | 0.04 |
| 503 | 600395 | 盘江股份 | 24,100 | 167,495.00 | 0.04 |
| 504 | 002352 | 顺丰控股 | 3,705 | 167,058.45 | 0.04 |
| 505 | 300009 | 安科生物 | 16,700 | 167,000.00 | 0.04 |
| 506 | 002015 | 协鑫能科 | 12,300 | 165,189.00 | 0.04 |
| 507 | 600125 | 铁龙物流 | 27,300 | 164,892.00 | 0.04 |
| 508 | 603786 | 科博达 | 2,500 | 164,250.00 | 0.04 |
| 509 | 688400 | 凌云光 | 5,348 | 163,007.04 | 0.04 |
| 510 | 301208 | 中亦科技 | 2,925 | 161,840.25 | 0.04 |
| 511 | 300442 | 润泽科技 | 5,200 | 159,952.00 | 0.04 |
| 512 | 688225 | 亚信安全 | 7,600 | 159,220.00 | 0.04 |
| 513 | 002782 | 可立克 | 10,400 | 159,016.00 | 0.04 |
| 514 | 603595 | 东尼电子 | 3,700 | 158,434.00 | 0.04 |
| 515 | 002745 | 木林森 | 17,200 | 158,240.00 | 0.04 |
| 516 | 605168 | 三人行 | 1,825 | 156,840.50 | 0.04 |
| 517 | 688080 | 映翰通 | 3,189 | 155,942.10 | 0.04 |
| 518 | 000570 | 苏常柴 A | 27,900 | 155,403.00 | 0.04 |
| 519 | 300369 | 绿盟科技 | 12,553 | 155,280.61 | 0.03 |
| 520 | 688033 | 天宜上佳 | 8,100 | 154,872.00 | 0.03 |
| 521 | 603236 | 移远通信 | 2,660 | 153,508.60 | 0.03 |
| 522 | 603689 | 皖天然气 | 17,500 | 153,475.00 | 0.03 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 523 | 300976 | 达瑞电子 | 3,000 | 152,100.00 | 0.03 |
| 524 | 688022 | 瀚川智能 | 4,200 | 151,746.00 | 0.03 |
| 525 | 600120 | 浙江东方 | 39,500 | 151,285.00 | 0.03 |
| 526 | 002489 | 浙江永强 | 37,200 | 150,660.00 | 0.03 |
| 527 | 002314 | 南山控股 | 45,400 | 149,820.00 | 0.03 |
| 528 | 300384 | 三联虹普 | 8,761 | 148,849.39 | 0.03 |
| 529 | 603138 | 海量数据 | 7,800 | 148,512.00 | 0.03 |
| 530 | 600363 | 联创光电 | 4,000 | 148,400.00 | 0.03 |
| 531 | 000967 | 盈峰环境 | 29,200 | 147,460.00 | 0.03 |
| 532 | 002233 | 塔牌集团 | 19,100 | 147,452.00 | 0.03 |
| 533 | 600887 | 伊利股份 | 5,204 | 147,377.28 | 0.03 |
| 534 | 603596 | 伯特利 | 1,857 | 147,185.82 | 0.03 |
| 535 | 002361 | 神剑股份 | 36,300 | 147,015.00 | 0.03 |
| 536 | 300941 | 创识科技 | 7,200 | 146,448.00 | 0.03 |
| 537 | 002969 | 嘉美包装 | 37,300 | 145,843.00 | 0.03 |
| 538 | 002895 | 川恒股份 | 7,400 | 145,780.00 | 0.03 |
| 539 | 600782 | 新钢股份 | 39,106 | 145,083.26 | 0.03 |
| 540 | 600583 | 海油工程 | 24,800 | 145,080.00 | 0.03 |
| 541 | 002724 | 海洋王 | 16,700 | 144,956.00 | 0.03 |
| 542 | 600338 | 西藏珠峰 | 7,900 | 144,254.00 | 0.03 |
| 543 | 600197 | 伊力特 | 5,300 | 144,001.00 | 0.03 |
| 544 | 600502 | 安徽建工 | 27,200 | 143,616.00 | 0.03 |
| 545 | 301327 | 华宝新能 | 1,800 | 142,398.00 | 0.03 |
| 546 | 002124 | 天邦食品 | 31,300 | 142,102.00 | 0.03 |
| 547 | 002952 | 亚世光电 | 8,000 | 141,840.00 | 0.03 |
| 548 | 688007 | 光峰科技 | 6,800 | 141,780.00 | 0.03 |
| 549 | 000055 | 方大集团 | 28,600 | 141,570.00 | 0.03 |
| 550 | 002044 | 美年健康 | 19,900 | 141,489.00 | 0.03 |
| 551 | 000603 | 盛达资源 | 11,700 | 141,453.00 | 0.03 |
| 552 | 600633 | 浙数文化 | 8,700 | 141,027.00 | 0.03 |
| 553 | 002317 | 众生药业 | 8,300 | 141,017.00 | 0.03 |
| 554 | 000528 | 柳工 | 17,800 | 140,620.00 | 0.03 |
| 555 | 002322 | 理工能科 | 13,500 | 140,400.00 | 0.03 |
| 556 | 688711 | 宏微科技 | 2,400 | 140,016.00 | 0.03 |
| 557 | 688696 | 极米科技 | 1,000 | 139,390.00 | 0.03 |
| 558 | 605111 | 新洁能 | 3,200 | 139,264.00 | 0.03 |
| 559 | 688512 | 慧智微 | 6,776 | 139,097.12 | 0.03 |
| 560 | 600483 | 福能股份 | 12,000 | 138,600.00 | 0.03 |
| 561 | 002333 | 罗普斯金 | 22,900 | 138,545.00 | 0.03 |
| 562 | 002364 | 中恒电气 | 16,500 | 138,435.00 | 0.03 |
| 563 | 301239 | 普瑞眼科 | 1,400 | 137,312.00 | 0.03 |
| 564 | 300439 | 美康生物 | 12,100 | 136,851.00 | 0.03 |
| 565 | 000555 | 神州信息 | 11,100 | 136,530.00 | 0.03 |
| 566 | 002539 | 云图控股 | 15,200 | 136,496.00 | 0.03 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|--------|------------|------|
| 567 | 688299 | 长阳科技 | 8,700 | 136,329.00 | 0.03 |
| 568 | 600750 | 江中药业 | 6,200 | 135,966.00 | 0.03 |
| 569 | 300129 | 泰胜风能 | 14,171 | 135,899.89 | 0.03 |
| 570 | 301363 | 美好医疗 | 3,080 | 135,489.20 | 0.03 |
| 571 | 300894 | 火星人 | 5,300 | 135,362.00 | 0.03 |
| 572 | 300294 | 博雅生物 | 3,700 | 134,236.00 | 0.03 |
| 573 | 600167 | 联美控股 | 19,250 | 134,172.50 | 0.03 |
| 574 | 000417 | 合肥百货 | 28,600 | 133,848.00 | 0.03 |
| 575 | 300896 | 爱美客 | 300 | 133,485.00 | 0.03 |
| 576 | 601939 | 建设银行 | 21,300 | 133,338.00 | 0.03 |
| 577 | 688091 | 上海谊众 | 1,800 | 132,534.00 | 0.03 |
| 578 | 300666 | 江丰电子 | 1,900 | 129,124.00 | 0.03 |
| 579 | 002129 | TCL 中环 | 3,875 | 128,650.00 | 0.03 |
| 580 | 600742 | 一汽富维 | 15,700 | 128,583.00 | 0.03 |
| 581 | 301090 | 华润材料 | 10,100 | 127,462.00 | 0.03 |
| 582 | 301039 | 中集车辆 | 9,600 | 127,008.00 | 0.03 |
| 583 | 688639 | 华恒生物 | 1,400 | 126,672.00 | 0.03 |
| 584 | 002938 | 鹏鼎控股 | 5,200 | 126,308.00 | 0.03 |
| 585 | 300181 | 佐力药业 | 10,300 | 125,763.00 | 0.03 |
| 586 | 300633 | 开立医疗 | 2,300 | 125,350.00 | 0.03 |
| 587 | 688276 | 百克生物 | 2,000 | 125,200.00 | 0.03 |
| 588 | 688798 | 艾为电子 | 2,100 | 124,215.00 | 0.03 |
| 589 | 688050 | 爱博医疗 | 600 | 123,198.00 | 0.03 |
| 590 | 688707 | 振华新材 | 4,000 | 123,160.00 | 0.03 |
| 591 | 301207 | 华兰疫苗 | 3,700 | 123,062.00 | 0.03 |
| 592 | 002312 | 川发龙蟒 | 15,100 | 122,763.00 | 0.03 |
| 593 | 300683 | 海特生物 | 3,200 | 122,592.00 | 0.03 |
| 594 | 688185 | 康希诺 | 1,500 | 122,250.00 | 0.03 |
| 595 | 300034 | 钢研高纳 | 3,100 | 122,109.00 | 0.03 |
| 596 | 601001 | 晋控煤业 | 13,000 | 121,680.00 | 0.03 |
| 597 | 688595 | 芯海科技 | 3,800 | 121,524.00 | 0.03 |
| 598 | 300289 | 利德曼 | 21,700 | 121,520.00 | 0.03 |
| 599 | 300160 | 秀强股份 | 18,700 | 121,363.00 | 0.03 |
| 600 | 000951 | 中国重汽 | 7,200 | 121,320.00 | 0.03 |
| 601 | 600777 | 新潮能源 | 47,900 | 121,187.00 | 0.03 |
| 602 | 002996 | 顺博合金 | 10,000 | 121,000.00 | 0.03 |
| 603 | 000627 | 天茂集团 | 40,200 | 120,600.00 | 0.03 |
| 604 | 300177 | 中海达 | 17,800 | 120,506.00 | 0.03 |
| 605 | 002980 | 华盛昌 | 3,600 | 120,456.00 | 0.03 |
| 606 | 601963 | 重庆银行 | 15,200 | 120,232.00 | 0.03 |
| 607 | 000582 | 北部湾港 | 15,800 | 120,080.00 | 0.03 |
| 608 | 688598 | 金博股份 | 700 | 120,050.00 | 0.03 |
| 609 | 600323 | 瀚蓝环境 | 6,300 | 119,259.00 | 0.03 |
| 610 | 300496 | 中科创达 | 1,233 | 118,799.55 | 0.03 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 611 | 300719 | 安达维尔 | 8,400 | 118,608.00 | 0.03 |
| 612 | 600420 | 国药现代 | 10,500 | 118,545.00 | 0.03 |
| 613 | 688366 | 昊海生科 | 1,400 | 117,908.00 | 0.03 |
| 614 | 600872 | 中炬高新 | 3,200 | 117,728.00 | 0.03 |
| 615 | 001269 | 欧晶科技 | 1,600 | 117,648.00 | 0.03 |
| 616 | 603505 | 金石资源 | 5,032 | 117,497.20 | 0.03 |
| 617 | 002617 | 露笑科技 | 14,900 | 117,412.00 | 0.03 |
| 618 | 301292 | 海科新源 | 5,824 | 116,421.76 | 0.03 |
| 619 | 300647 | 超频三 | 16,200 | 116,316.00 | 0.03 |
| 620 | 600855 | 航天长峰 | 8,800 | 115,896.00 | 0.03 |
| 621 | 603713 | 密尔克卫 | 1,300 | 115,817.00 | 0.03 |
| 622 | 301200 | 大族数控 | 2,900 | 115,652.00 | 0.03 |
| 623 | 002516 | 旷达科技 | 23,800 | 115,192.00 | 0.03 |
| 624 | 688676 | 金盘科技 | 3,800 | 115,102.00 | 0.03 |
| 625 | 002346 | 柘中股份 | 9,200 | 114,448.00 | 0.03 |
| 626 | 000881 | 中广核技 | 13,900 | 114,397.00 | 0.03 |
| 627 | 600635 | 大众公用 | 34,400 | 114,208.00 | 0.03 |
| 628 | 603421 | 鼎信通讯 | 10,900 | 113,905.00 | 0.03 |
| 629 | 605365 | 立达信 | 7,600 | 113,848.00 | 0.03 |
| 630 | 600897 | 厦门空港 | 5,500 | 113,795.00 | 0.03 |
| 631 | 688084 | 晶品特装 | 1,300 | 112,931.00 | 0.03 |
| 632 | 600211 | 西藏药业 | 1,900 | 112,860.00 | 0.03 |
| 633 | 002424 | 贵州百灵 | 12,400 | 111,352.00 | 0.03 |
| 634 | 300390 | 天华新能 | 3,100 | 110,980.00 | 0.03 |
| 635 | 688152 | 麒麟信安 | 1,200 | 110,736.00 | 0.02 |
| 636 | 603937 | 丽岛新材 | 9,500 | 110,105.00 | 0.02 |
| 637 | 003028 | 振邦智能 | 2,600 | 108,706.00 | 0.02 |
| 638 | 002498 | 汉缆股份 | 27,000 | 108,270.00 | 0.02 |
| 639 | 002267 | 陕天然气 | 13,600 | 107,712.00 | 0.02 |
| 640 | 301177 | 迪阿股份 | 2,800 | 107,604.00 | 0.02 |
| 641 | 600588 | 用友网络 | 5,200 | 106,600.00 | 0.02 |
| 642 | 601688 | 华泰证券 | 7,682 | 105,781.14 | 0.02 |
| 643 | 300443 | 金雷股份 | 2,950 | 104,577.50 | 0.02 |
| 644 | 301488 | 豪恩汽电 | 2,618 | 104,144.04 | 0.02 |
| 645 | 002061 | 浙江交科 | 23,200 | 103,472.00 | 0.02 |
| 646 | 301236 | 软通动力 | 3,800 | 103,398.00 | 0.02 |
| 647 | 601966 | 玲珑轮胎 | 4,640 | 103,100.80 | 0.02 |
| 648 | 600745 | 闻泰科技 | 2,100 | 102,690.00 | 0.02 |
| 649 | 000019 | 深粮控股 | 13,800 | 102,396.00 | 0.02 |
| 650 | 688078 | 龙软科技 | 1,985 | 102,326.75 | 0.02 |
| 651 | 300673 | 佩蒂股份 | 7,300 | 102,200.00 | 0.02 |
| 652 | 000045 | 深纺织 A | 9,200 | 101,200.00 | 0.02 |
| 653 | 605116 | 奥锐特 | 4,000 | 101,120.00 | 0.02 |
| 654 | 600380 | 健康元 | 7,899 | 100,396.29 | 0.02 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 655 | 600055 | 万东医疗 | 4,800 | 99,984.00 | 0.02 |
| 656 | 600037 | 歌华有线 | 12,000 | 99,720.00 | 0.02 |
| 657 | 600713 | 南京医药 | 18,300 | 98,271.00 | 0.02 |
| 658 | 002421 | 达实智能 | 27,600 | 97,152.00 | 0.02 |
| 659 | 002511 | 中顺洁柔 | 8,700 | 97,005.00 | 0.02 |
| 660 | 603529 | 爱玛科技 | 3,000 | 96,660.00 | 0.02 |
| 661 | 600277 | 亿利洁能 | 29,200 | 94,608.00 | 0.02 |
| 662 | 600660 | 福耀玻璃 | 2,600 | 93,210.00 | 0.02 |
| 663 | 300003 | 乐普医疗 | 4,100 | 92,701.00 | 0.02 |
| 664 | 300674 | 宇信科技 | 5,200 | 91,936.00 | 0.02 |
| 665 | 300740 | 水羊股份 | 5,900 | 91,450.00 | 0.02 |
| 666 | 002601 | 龙佰集团 | 5,500 | 90,750.00 | 0.02 |
| 667 | 300079 | 数码视讯 | 14,600 | 89,060.00 | 0.02 |
| 668 | 000059 | 华锦股份 | 14,100 | 88,689.00 | 0.02 |
| 669 | 688568 | 中科星图 | 1,100 | 88,638.00 | 0.02 |
| 670 | 603501 | 韦尔股份 | 900 | 88,236.00 | 0.02 |
| 671 | 600717 | 天津港 | 19,800 | 87,714.00 | 0.02 |
| 672 | 300263 | 隆华科技 | 10,500 | 87,360.00 | 0.02 |
| 673 | 300088 | 长信科技 | 14,400 | 86,832.00 | 0.02 |
| 674 | 600436 | 片仔癀 | 300 | 85,908.00 | 0.02 |
| 675 | 688073 | 毕得医药 | 1,200 | 84,936.00 | 0.02 |
| 676 | 300102 | 乾照光电 | 12,600 | 82,908.00 | 0.02 |
| 677 | 000919 | 金陵药业 | 10,500 | 82,110.00 | 0.02 |
| 678 | 603288 | 海天味业 | 1,700 | 79,645.00 | 0.02 |
| 679 | 688278 | 特宝生物 | 1,800 | 79,038.00 | 0.02 |
| 680 | 301202 | 朗威股份 | 3,060 | 79,009.20 | 0.02 |
| 681 | 002400 | 省广集团 | 16,400 | 78,884.00 | 0.02 |
| 682 | 300601 | 康泰生物 | 3,100 | 78,709.00 | 0.02 |
| 683 | 688307 | 中润光学 | 2,455 | 77,897.15 | 0.02 |
| 684 | 688603 | 天承科技 | 1,391 | 76,505.00 | 0.02 |
| 685 | 002003 | 伟星股份 | 7,900 | 73,944.00 | 0.02 |
| 686 | 301261 | 恒工精密 | 1,973 | 72,803.70 | 0.02 |
| 687 | 301129 | 瑞纳智能 | 900 | 66,303.00 | 0.01 |
| 688 | 300661 | 圣邦股份 | 800 | 65,704.00 | 0.01 |
| 689 | 002527 | 新时达 | 3,584 | 48,742.40 | 0.01 |
| 690 | 688249 | 晶合集成 | 2,604 | 47,028.24 | 0.01 |
| 691 | 301358 | 湖南裕能 | 1,092 | 46,835.88 | 0.01 |
| 692 | 301260 | 格力博 | 1,773 | 41,895.99 | 0.01 |
| 693 | 688355 | 明志科技 | 1,152 | 35,043.84 | 0.01 |
| 694 | 688516 | 奥特维 | 183 | 34,477.20 | 0.01 |
| 695 | 301301 | 川宁生物 | 3,574 | 32,023.04 | 0.01 |
| 696 | 688122 | 西部超导 | 560 | 31,208.80 | 0.01 |
| 697 | 688472 | 阿特斯 | 1,809 | 30,825.36 | 0.01 |
| 698 | 002192 | 融捷股份 | 459 | 30,674.97 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 699 | 603556 | 海兴电力 | 1,200 | 30,288.00 | 0.01 |
| 700 | 603056 | 德邦股份 | 1,910 | 29,452.20 | 0.01 |
| 701 | 000552 | 甘肃能化 | 8,786 | 29,257.38 | 0.01 |
| 702 | 002385 | 大北农 | 4,432 | 29,251.20 | 0.01 |
| 703 | 688361 | 中科飞测 | 449 | 29,036.83 | 0.01 |
| 704 | 300331 | 苏大维格 | 1,070 | 27,948.40 | 0.01 |
| 705 | 600699 | 均胜电子 | 1,528 | 26,953.92 | 0.01 |
| 706 | 688469 | 中芯集成 | 4,865 | 26,319.65 | 0.01 |
| 707 | 600161 | 天坛生物 | 917 | 24,896.55 | 0.01 |
| 708 | 002543 | 万和电气 | 3,056 | 24,172.96 | 0.01 |
| 709 | 601992 | 金隅集团 | 11,002 | 23,984.36 | 0.01 |
| 710 | 301293 | 三博脑科 | 333 | 23,782.86 | 0.01 |
| 711 | 002045 | 国光电器 | 1,471 | 23,624.26 | 0.01 |
| 712 | 300806 | 斯迪克 | 1,257 | 23,531.04 | 0.01 |
| 713 | 600580 | 卧龙电驱 | 1,605 | 23,449.05 | 0.01 |
| 714 | 601128 | 常熟银行 | 3,394 | 23,147.08 | 0.01 |
| 715 | 601696 | 中银证券 | 2,140 | 22,812.40 | 0.01 |
| 716 | 600475 | 华光环能 | 1,919 | 22,797.72 | 0.01 |
| 717 | 002607 | 中公教育 | 4,737 | 22,263.90 | 0.01 |
| 718 | 301080 | 百普赛斯 | 350 | 21,987.00 | 0.00 |
| 719 | 000825 | 太钢不锈 | 5,654 | 21,880.98 | 0.00 |
| 720 | 300401 | 花园生物 | 1,871 | 21,741.02 | 0.00 |
| 721 | 600409 | 三友化工 | 3,973 | 21,652.85 | 0.00 |
| 722 | 688484 | 南芯科技 | 582 | 21,365.22 | 0.00 |
| 723 | 688378 | 奥来德 | 423 | 20,896.20 | 0.00 |
| 724 | 002955 | 鸿合科技 | 884 | 20,818.20 | 0.00 |
| 725 | 603876 | 鼎胜新材 | 1,030 | 19,765.70 | 0.00 |
| 726 | 600859 | 王府井 | 994 | 19,671.26 | 0.00 |
| 727 | 301291 | 明阳电气 | 614 | 19,052.42 | 0.00 |
| 728 | 002978 | 安宁股份 | 587 | 18,848.57 | 0.00 |
| 729 | 600419 | 天润乳业 | 1,137 | 18,442.14 | 0.00 |
| 730 | 688352 | 硕中科技 | 1,507 | 18,189.49 | 0.00 |
| 731 | 301096 | 百诚医药 | 300 | 18,183.00 | 0.00 |
| 732 | 000533 | 顺钠股份 | 4,202 | 17,858.50 | 0.00 |
| 733 | 688363 | 华熙生物 | 200 | 17,832.00 | 0.00 |
| 734 | 688146 | 中船特气 | 454 | 17,311.02 | 0.00 |
| 735 | 000999 | 华润三九 | 282 | 17,106.12 | 0.00 |
| 736 | 688458 | 美芯晟 | 188 | 17,062.88 | 0.00 |
| 737 | 688478 | 晶升股份 | 402 | 17,032.74 | 0.00 |
| 738 | 300925 | 法本信息 | 1,200 | 16,956.00 | 0.00 |
| 739 | 688016 | 心脉医疗 | 94 | 16,908.72 | 0.00 |
| 740 | 002056 | 横店东磁 | 922 | 16,789.62 | 0.00 |
| 741 | 688562 | 航天软件 | 726 | 16,197.06 | 0.00 |
| 742 | 001287 | 中电港 | 762 | 16,017.24 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 743 | 603688 | 石英股份 | 134 | 15,254.56 | 0.00 |
| 744 | 301419 | 阿莱德 | 330 | 14,470.50 | 0.00 |
| 745 | 688226 | 威腾电气 | 660 | 14,401.20 | 0.00 |
| 746 | 002078 | 太阳纸业 | 1,347 | 14,399.43 | 0.00 |
| 747 | 688593 | 新相微 | 959 | 13,991.81 | 0.00 |
| 748 | 301439 | 泓淋电力 | 826 | 13,959.40 | 0.00 |
| 749 | 688552 | 航天南湖 | 594 | 13,959.00 | 0.00 |
| 750 | 301387 | 光大同创 | 307 | 13,925.52 | 0.00 |
| 751 | 301210 | 金杨股份 | 281 | 13,816.77 | 0.00 |
| 752 | 688686 | 奥普特 | 84 | 13,816.32 | 0.00 |
| 753 | 603987 | 康德莱 | 1,056 | 13,643.52 | 0.00 |
| 754 | 301382 | 蜂助手 | 408 | 13,398.72 | 0.00 |
| 755 | 600299 | 安迪苏 | 1,681 | 13,397.57 | 0.00 |
| 756 | 301320 | 豪江智能 | 642 | 13,238.04 | 0.00 |
| 757 | 688433 | 华曙高科 | 418 | 13,167.00 | 0.00 |
| 758 | 000066 | 中国长城 | 917 | 12,682.11 | 0.00 |
| 759 | 688581 | 安杰思 | 107 | 12,629.21 | 0.00 |
| 760 | 301360 | 荣旗科技 | 134 | 12,408.40 | 0.00 |
| 761 | 300596 | 利安隆 | 301 | 12,241.67 | 0.00 |
| 762 | 601061 | 中信金属 | 1,604 | 12,158.32 | 0.00 |
| 763 | 002197 | 证通电子 | 1,146 | 12,078.84 | 0.00 |
| 764 | 002254 | 泰和新材 | 478 | 11,696.66 | 0.00 |
| 765 | 301315 | 威士顿 | 226 | 11,553.12 | 0.00 |
| 766 | 688523 | 航天环宇 | 472 | 11,257.20 | 0.00 |
| 767 | 301141 | 中科磁业 | 262 | 11,184.78 | 0.00 |
| 768 | 688036 | 传音控股 | 76 | 11,172.00 | 0.00 |
| 769 | 301225 | 恒勃股份 | 333 | 11,075.58 | 0.00 |
| 770 | 000065 | 北方国际 | 702 | 10,544.04 | 0.00 |
| 771 | 000893 | 亚钾国际 | 459 | 10,529.46 | 0.00 |
| 772 | 301345 | 涛涛车业 | 216 | 10,074.24 | 0.00 |
| 773 | 688631 | 莱斯信息 | 336 | 10,036.32 | 0.00 |
| 774 | 301232 | 飞沃科技 | 165 | 9,639.30 | 0.00 |
| 775 | 601021 | 春秋航空 | 167 | 9,597.49 | 0.00 |
| 776 | 688333 | 铂力特 | 90 | 9,516.60 | 0.00 |
| 777 | 301376 | 致欧科技 | 420 | 9,454.20 | 0.00 |
| 778 | 601686 | 友发集团 | 1,376 | 9,411.84 | 0.00 |
| 779 | 603033 | 三维股份 | 459 | 9,340.65 | 0.00 |
| 780 | 301357 | 北方长龙 | 190 | 9,194.10 | 0.00 |
| 781 | 301386 | 未来电器 | 378 | 8,992.62 | 0.00 |
| 782 | 301323 | 新莱福 | 228 | 8,974.08 | 0.00 |
| 783 | 688429 | 时创能源 | 346 | 8,833.38 | 0.00 |
| 784 | 301373 | 凌玮科技 | 277 | 8,822.45 | 0.00 |
| 785 | 301170 | 锡南科技 | 250 | 8,732.50 | 0.00 |
| 786 | 002649 | 博彦科技 | 612 | 8,647.56 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 787 | 600298 | 安琪酵母 | 230 | 8,328.30 | 0.00 |
| 788 | 688535 | 华海诚科 | 161 | 8,248.03 | 0.00 |
| 789 | 301157 | 华塑科技 | 150 | 7,939.50 | 0.00 |
| 790 | 000963 | 华东医药 | 182 | 7,893.34 | 0.00 |
| 791 | 003007 | 直真科技 | 306 | 7,891.74 | 0.00 |
| 792 | 688268 | 华特气体 | 95 | 7,669.35 | 0.00 |
| 793 | 601952 | 苏垦农发 | 612 | 7,123.68 | 0.00 |
| 794 | 603898 | 好莱客 | 726 | 7,056.72 | 0.00 |
| 795 | 301337 | 亚华电子 | 232 | 7,045.84 | 0.00 |
| 796 | 301428 | 世纪恒通 | 229 | 7,007.40 | 0.00 |
| 797 | 688369 | 致远互联 | 119 | 6,580.70 | 0.00 |
| 798 | 300738 | 奥飞数据 | 642 | 6,548.40 | 0.00 |
| 799 | 000768 | 中航西飞 | 230 | 6,152.50 | 0.00 |
| 800 | 001380 | 华纬科技 | 170 | 5,232.60 | 0.00 |
| 801 | 300188 | 美亚柏科 | 234 | 4,864.86 | 0.00 |
| 802 | 603125 | 常青科技 | 160 | 3,924.80 | 0.00 |
| 803 | 688200 | 华峰测控 | 25 | 3,825.00 | 0.00 |
| 804 | 002446 | 盛路通信 | 402 | 3,798.90 | 0.00 |
| 805 | 002897 | 意华股份 | 82 | 3,794.96 | 0.00 |
| 806 | 600760 | 中航沈飞 | 78 | 3,510.00 | 0.00 |
| 807 | 688550 | 瑞联新材 | 85 | 3,366.00 | 0.00 |
| 808 | 002975 | 博杰股份 | 76 | 3,316.64 | 0.00 |
| 809 | 688003 | 天准科技 | 69 | 3,079.47 | 0.00 |
| 810 | 600584 | 长电科技 | 98 | 3,054.66 | 0.00 |
| 811 | 600546 | 山煤国际 | 197 | 2,850.59 | 0.00 |
| 812 | 603258 | 电魂网络 | 62 | 2,635.62 | 0.00 |
| 813 | 301227 | 森鹰窗业 | 95 | 2,634.35 | 0.00 |
| 814 | 688558 | 国盛智科 | 68 | 2,431.68 | 0.00 |
| 815 | 603137 | 恒尚节能 | 139 | 2,375.51 | 0.00 |
| 816 | 300357 | 我武生物 | 70 | 2,354.10 | 0.00 |
| 817 | 002085 | 万丰奥威 | 334 | 2,314.62 | 0.00 |
| 818 | 001367 | 海森药业 | 55 | 2,171.40 | 0.00 |
| 819 | 688099 | 晶晨股份 | 24 | 2,023.68 | 0.00 |
| 820 | 603172 | 万丰股份 | 122 | 1,967.86 | 0.00 |
| 821 | 601607 | 上海医药 | 87 | 1,949.67 | 0.00 |
| 822 | 603368 | 柳药集团 | 78 | 1,927.38 | 0.00 |
| 823 | 603613 | 国联股份 | 49 | 1,809.57 | 0.00 |
| 824 | 300724 | 捷佳伟创 | 16 | 1,797.60 | 0.00 |
| 825 | 300481 | 濮阳惠成 | 78 | 1,603.68 | 0.00 |
| 826 | 300979 | 华利集团 | 32 | 1,559.68 | 0.00 |
| 827 | 688586 | 江航装备 | 98 | 1,363.18 | 0.00 |
| 828 | 601677 | 明泰铝业 | 98 | 1,360.24 | 0.00 |
| 829 | 002908 | 德生科技 | 85 | 1,314.95 | 0.00 |
| 830 | 002373 | 千方科技 | 89 | 1,213.96 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|----|----------|------|
| 831 | 600926 | 杭州银行 | 96 | 1,128.00 | 0.00 |
| 832 | 688232 | 新点软件 | 17 | 914.77 | 0.00 |
| 833 | 000831 | 中国稀土 | 28 | 828.80 | 0.00 |
| 834 | 603867 | 新化股份 | 20 | 810.00 | 0.00 |
| 835 | 300900 | 广联航空 | 28 | 806.68 | 0.00 |
| 836 | 603738 | 泰晶科技 | 40 | 664.40 | 0.00 |
| 837 | 002968 | 新大正 | 42 | 634.62 | 0.00 |
| 838 | 600528 | 中铁工业 | 61 | 602.68 | 0.00 |
| 839 | 600598 | 北大荒 | 44 | 586.52 | 0.00 |
| 840 | 600143 | 金发科技 | 54 | 471.42 | 0.00 |
| 841 | 600909 | 华安证券 | 91 | 424.97 | 0.00 |
| 842 | 603966 | 法兰泰克 | 33 | 416.79 | 0.00 |
| 843 | 301297 | 富乐德 | 15 | 337.65 | 0.00 |
| 844 | 000498 | 山东路桥 | 52 | 333.84 | 0.00 |
| 845 | 002216 | 三全食品 | 20 | 311.60 | 0.00 |
| 846 | 000050 | 深天马 A | 32 | 293.76 | 0.00 |
| 847 | 600256 | 广汇能源 | 37 | 253.82 | 0.00 |
| 848 | 601868 | 中国能建 | 94 | 219.96 | 0.00 |
| 849 | 000756 | 新华制药 | 10 | 215.80 | 0.00 |
| 850 | 000012 | 南玻 A | 35 | 208.60 | 0.00 |
| 851 | 000060 | 中金岭南 | 32 | 152.00 | 0.00 |
| 852 | 300793 | 佳禾智能 | 7 | 141.61 | 0.00 |
| 853 | 002396 | 星网锐捷 | 6 | 135.54 | 0.00 |
| 854 | 601006 | 大秦铁路 | 12 | 89.16 | 0.00 |
| 855 | 688159 | 有方科技 | 1 | 39.58 | 0.00 |
| 856 | 600968 | 海油发展 | 5 | 15.35 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 10,038,408.00 | 1.16 |
| 2 | 002304 | 洋河股份 | 5,917,564.00 | 0.68 |
| 3 | 601668 | 中国建筑 | 5,533,733.00 | 0.64 |
| 4 | 000063 | 中兴通讯 | 5,295,030.00 | 0.61 |
| 5 | 600809 | 山西汾酒 | 5,051,772.00 | 0.58 |
| 6 | 600325 | 华发股份 | 4,837,717.00 | 0.56 |
| 7 | 002555 | 三七互娱 | 4,819,586.00 | 0.56 |
| 8 | 300750 | 宁德时代 | 4,713,310.00 | 0.54 |
| 9 | 601377 | 兴业证券 | 4,397,103.30 | 0.51 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 10 | 600519 | 贵州茅台 | 4,207,164.00 | 0.49 |
| 11 | 300118 | 东方日升 | 4,084,167.75 | 0.47 |
| 12 | 603444 | 吉比特 | 4,058,250.00 | 0.47 |
| 13 | 600941 | 中国移动 | 3,856,587.00 | 0.44 |
| 14 | 300682 | 朗新科技 | 3,805,493.00 | 0.44 |
| 15 | 002415 | 海康威视 | 3,738,402.00 | 0.43 |
| 16 | 300274 | 阳光电源 | 3,695,622.00 | 0.43 |
| 17 | 002271 | 东方雨虹 | 3,598,880.00 | 0.42 |
| 18 | 300059 | 东方财富 | 3,501,733.00 | 0.40 |
| 19 | 300751 | 迈为股份 | 3,369,072.00 | 0.39 |
| 20 | 000400 | 许继电气 | 3,281,671.00 | 0.38 |

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 | 601318 | 中国平安 | 18,905,783.88 | 2.18 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 13,898,671.56 | 1.60 |
| 3 | 601888 | 中国中免 | 12,850,146.74 | 1.48 |
| 4 | 300750 | 宁德时代 | 11,082,800.00 | 1.28 |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 10,751,563.00 | 1.24 |
| 6 | 300122 | 智飞生物 | 10,663,146.94 | 1.23 |
| 7 | 600887 | 伊利股份 | 8,398,809.85 | 0.97 |
| 8 | 002271 | 东方雨虹 | 7,524,997.56 | 0.87 |
| 9 | 600036 | 招商银行 | 7,504,466.40 | 0.87 |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 7,427,396.28 | 0.86 |
| 11 | 601688 | 华泰证券 | 6,310,960.60 | 0.73 |
| 12 | 002142 | 宁波银行 | 6,276,029.16 | 0.72 |
| 13 | 600153 | 建发股份 | 6,233,855.00 | 0.72 |
| 14 | 300760 | 迈瑞医疗 | 6,107,510.94 | 0.70 |
| 15 | 600438 | 通威股份 | 6,062,582.35 | 0.70 |
| 16 | 601668 | 中国建筑 | 6,008,708.39 | 0.69 |
| 17 | 300682 | 朗新科技 | 5,777,791.01 | 0.67 |
| 18 | 002304 | 洋河股份 | 5,764,943.43 | 0.67 |
| 19 | 002049 | 紫光国微 | 5,764,101.24 | 0.67 |
| 20 | 600325 | 华发股份 | 5,659,571.52 | 0.65 |

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 | 946,137,922.85 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 1,213,435,160.49 |

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 | 18,300,845.54 | 4.12 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 935,494.96 | 0.21 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 19,236,340.50 | 4.34 |

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 | 019694 | 23 国债 01 | 181,000 | 18,300,845.54 | 4.12 |
| 2 | 110079 | 杭银转债 | 4,230 | 486,512.70 | 0.11 |
| 3 | 127054 | 双箭转债 | 1,650 | 212,905.15 | 0.05 |
| 4 | 113043 | 财通转债 | 1,620 | 173,075.87 | 0.04 |
| 5 | 118036 | 力合转债 | 630 | 63,001.24 | 0.01 |

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 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 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 301,532,668.08 元，占基金资产净值的比例为 67.96%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-260,805,780.00 元，占基金资产净值的比例为-58.78%，空头合约市值占股票资产的比例为-86.49%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为-17,466,325.22 元，公允价值变动损益为 23,516,665.10 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 报告期内本基金投资的江苏银行（600919），因零售业务部和网络金融部均负责基金销售业

务,但未对基金销售产品实行集中统一准入管理,部分基金销售业务人员未取得基金从业资格,存在向普通投资者主动推介风险等级高于其风险承受能力的产品或服务的情况,于 2022 年 12 月 5 日被中国证券监督管理委员会江苏监管局责令改正。因个别债务融资工具未按照发行文件约定开展余额包销,低价包销多期债务融资工具,多期债务融资工具的簿记建档利率区间未在充分询价基础上形成,发行工作程序执行不到位、工作开展不规范等违规行为,于 2023 年 1 月 18 日被中国银行间市场交易商协会予以警告,责令整改。因违反账户管理规定、流通人民币管理规定、人民币反假有关规定、占压财政存款或者资金、违反国库科目设置和使用规定、未按规定履行反洗钱相关义务、对金融产品作出虚假或者引人误解的宣传等共计 9 项违法行为,于 2023 年 2 月 6 日被中国人民银行予以警告,并没收违法所得 42 元,罚款 773.6 万元。

对上述证券的投资决策程序的说明:银行业整体信用水平高。江苏银行为地区中大型银行,业务和组织架构优秀,管理层稳定、企业文化稳健务实进取,整体综合实力强,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招商银行(600036),因违反账户管理规定、违反清算管理规定、违反特约商户实名制管理规定、违反支付机构备付金管理规定、违反人民币反假有关规定、占压财政存款或者资金、违反国库科目设置和使用规定等共计 13 项违法行为,于 2022 年 8 月 31 日被中国人民银行警告,没收违法所得 5.692641 万元,罚款 3423.5 万元。因多期债务融资工具未按照发行文件约定开展余额包销,低价包销多期债务融资工具,债务融资工具承销协议的签订不规范,多期债务融资工具的簿记建档利率区间未在充分询价基础上形成,发行工作程序执行不到位、工作开展不规范等违规行为,于 2023 年 1 月 18 日被中国银行间市场交易商协会予以警告,责令整改。

对上述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。其余八名证券的发行主体本期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 | 33,442,750.30 |
| 2 | 应收清算款 | 1,113,434.93 |
| 3 | 应收股利 | - |

| | | |
|---|-------|---------------|
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 61,681.46 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 34,617,866.69 |

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 | 110079 | 杭银转债 | 486,512.70 | 0.11 |
| 2 | 127054 | 双箭转债 | 212,905.15 | 0.05 |
| 3 | 113043 | 财通转债 | 173,075.87 | 0.04 |

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 | 146,280 | 2,580.19 | 76,735,660.64 | 20.33% | 300,694,048.83 | 79.67% |
| 海富通阿尔法对冲混合 C | 4,501 | 6,354.55 | 7,248,567.94 | 25.34% | 21,353,253.21 | 74.66% |

| | | | | | | |
|----|---------|----------|---------------|--------|----------------|--------|
| 合计 | 150,781 | 2,692.86 | 83,984,228.58 | 20.68% | 322,047,302.04 | 79.32% |
|----|---------|----------|---------------|--------|----------------|--------|

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)。

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 | 1,485,001.68 | 0.3935% |
| | 海富通阿尔法对冲混合 C | 89,607.48 | 0.3133% |
| | 合计 | 1,574,609.16 | 0.3878% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|--------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 海富通阿尔法对冲混合 A | >100 |
| | 海富通阿尔法对冲混合 C | 0 |
| | 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 | 0 |
| | 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，本基金管理人运用自有资金总计 1000.10 万元认购了本基金，其中，发起资金总计人民币 1000 万元，认购费用为人民币 1000 元，符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有不少于 3 年。截至 2017 年 11 月 20 日，发起份额承诺持有期限已经届满。2017 年 12 月公司赎回所有份额。截止报告期末，公司未持有本基金份额。

9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 海富通阿尔法对冲混合 A | 海富通阿尔法对冲混合 C |
|---------------------------------|----------------|--------------|
| 基金合同生效日（2014 年 11 月 20 日）基金份额总额 | 719,877,758.17 | - |

| | | |
|---------------|----------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 743,706,885.57 | 50,755,429.52 |
| 本报告期基金总申购份额 | 36,868,289.53 | 1,360,680.95 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 403,145,465.63 | 23,514,289.32 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 377,429,709.47 | 28,601,821.15 |

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其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 | |
| 国盛证券 | 2 | 449,061,260.17 | 20.87% | 325,544.63 | 22.11% | - |
| 华西证券 | 1 | 439,180,738.24 | 20.42% | 321,173.01 | 21.82% | - |
| 中信证券 | 4 | 251,952,232.95 | 11.71% | 181,735.67 | 12.34% | - |
| 开源证券 | 2 | 189,559,743.15 | 8.81% | 137,883.03 | 9.37% | - |

| | | | | | | |
|--------------|---|----------------|-------|------------|-------|---|
| 银河证券 | 1 | 156,369,781.07 | 7.27% | 81,516.77 | 5.54% | - |
| 天风证券 | 2 | 146,255,417.15 | 6.80% | 106,104.73 | 7.21% | - |
| 国泰君安 | 2 | 131,172,281.93 | 6.10% | 95,930.73 | 6.52% | - |
| 国金证券 | 1 | 104,066,090.83 | 4.84% | 55,286.71 | 3.76% | - |
| 华创证券 | 1 | 99,995,817.79 | 4.65% | 42,128.70 | 2.86% | - |
| 野村东方国际 证券 | 1 | 86,391,878.83 | 4.02% | 62,314.18 | 4.23% | - |
| 上海证券 | 1 | 57,238,226.77 | 2.66% | 41,856.49 | 2.84% | - |
| 申万宏源 | 2 | 20,262,571.33 | 0.94% | 8,536.31 | 0.58% | - |
| 长江证券 | 1 | 19,691,101.83 | 0.92% | 12,234.24 | 0.83% | - |
| 招商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

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 |
| 国盛证券 | 11,027,643.50 | 9.93% | - | - | - | - |
| 华西证券 | 12,502,995.8 | 11.26% | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------------|---------------|--------|---------------|--------|---|---|
| | 9 | | | | | |
| 中信证券 | 210,694.70 | 0.19% | - | - | - | - |
| 开源证券 | 14,112,307.00 | 12.71% | - | - | - | - |
| 银河证券 | 235,074.48 | 0.21% | - | - | - | - |
| 天风证券 | 5,908,260.00 | 5.32% | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 217,788.29 | 0.20% | - | - | - | - |
| 国金证券 | 22,039,877.43 | 19.85% | 30,000,000.00 | 75.00% | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 野村东方国际 证券 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | 44,563,572.74 | 40.14% | 10,000,000.00 | 25.00% | - | - |
| 申万宏源 | 212,673.75 | 0.19% | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |

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终止部分代销机构办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-02-06 |
| 2 | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富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 | 2023-02-08 |
| 3 | 海富通基金管理有限公司关于公司住所变更的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-02-22 |
| 4 | 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 | 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 | 2023-03-02 |
| 5 | 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 | 2023-03-23 |

| | | | |
|----|--|-----------------------------|------------|
| | 新增北京创金启富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 | 网站及中国证监会基金电子披露网站 | |
| 6 | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增新华信通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 | 2023-03-23 |
| 7 | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增兴业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 | 2023-03-30 |
| 8 | 海富通基金管理有限公司关于终止部分代销机构办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-03-30 |
| 9 | 海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告 | 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 | 2023-04-11 |
| 10 | 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 | 2023-05-05 |
| 11 | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海大智慧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 | 2023-05-08 |
| 12 | 海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国工商银行股份有限公司为销售机构的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023-05-18 |
| 13 | 海富通基金管理有限公司关于旗下基金参加兴业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 | 2023-05-19 |

§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 109 只公募基金。截至 2023 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1649 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。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。

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”。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。2022 年 9 月，海富通荣获“IAMAC 推介·2021 年度保险资产管理业最受欢迎投资业务合作机构——最具进取基金公司”。2022 年 11 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

2023 年 3 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获上海证券交易所颁发的“上交所 2022 年度债券旗舰 ETF”。2023 年 6 月，海富通收益增长混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”。

§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)法律法规及中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

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

二〇二三年八月三十一日