

**海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金**  
**2026 年第 1 季度报告**  
**2026 年 3 月 31 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：二〇二六年四月二十二日

## §1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 4 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	海富通阿尔法对冲混合
基金主代码	519062
交易代码	519062
基金运作方式	契约型、发起式、开放式
基金合同生效日	2014 年 11 月 20 日
报告期末基金份额总额	149,746,802.29 份
投资目标	本基金通过灵活的投资策略，捕捉市场中的绝对收益机会，并且采用有效的风险管理措施，降低波动风险的同时，获取稳定的收益。
投资策略	本基金将主要通过阿尔法对冲等绝对收益策略，实现组合的稳定收益。同时本基金也根据市场环境的变化，灵活运用其他绝对收益策略，提高资金利用效率。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。本基金通过多种绝对收益策略剥离市场系统风险，因此与一般的混合型基金相比，本基金的预期风险更小。

基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C
下属两级基金的交易代码	519062	008795
报告期末下属两级基金的份额总额	139,116,647.91 份	10,630,154.38 份

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2026 年 1 月 1 日-2026 年 3 月 31 日)	
	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C
1.本期已实现收益	2,975,893.58	112,648.94
2.本期利润	1,406,643.87	54,067.62
3.加权平均基金份额本期利润	0.0097	0.0044
4.期末基金资产净值	146,003,124.11	10,887,217.84
5.期末基金份额净值	1.0495	1.0242

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

###### 1、海富通阿尔法对冲混合 A：

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

				④		
过去三个月	0.97%	0.30%	0.67%	0.01%	0.30%	0.29%
过去六个月	0.91%	0.25%	1.36%	0.01%	-0.45%	0.24%
过去一年	2.58%	0.25%	2.75%	0.01%	-0.17%	0.24%
过去三年	-2.93%	0.33%	8.49%	0.01%	-11.42%	0.32%
过去五年	-10.60%	0.34%	14.54%	0.01%	-25.14%	0.33%
自基金合同生效起至今	45.28%	0.34%	37.14%	0.01%	8.14%	0.33%

## 2、海富通阿尔法对冲混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.88%	0.30%	0.67%	0.01%	0.21%	0.29%
过去六个月	0.73%	0.25%	1.36%	0.01%	-0.63%	0.24%
过去一年	2.18%	0.25%	2.75%	0.01%	-0.57%	0.24%
过去三年	-4.07%	0.33%	8.49%	0.01%	-12.56%	0.32%
过去五年	-12.39%	0.34%	14.54%	0.01%	-26.93%	0.33%
自基金合同生效起至今	-8.55%	0.35%	18.29%	0.01%	-26.84%	0.34%

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

海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

#### 1. 海富通阿尔法对冲混合 A

(2014 年 11 月 20 日至 2026 年 3 月 31 日)



## 2. 海富通阿尔法对冲混合 C

(2020 年 1 月 22 日至 2026 年 3 月 31 日)



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

## §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李自悟	本基金的基金经理；量化投资部副总监。	2023-04-10	-	17 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，现任量化投资部副总监。2023 年 2 月起任海富通中证 500 增强基金经理。2023 年 2 月至 2025 年 3 月兼任海富通量化先锋股票基金经理。2023 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通中证 2000 增强策略 ETF 基金经理。2024 年 7 月起兼任海富通量化选股混合基金经理。2025 年 3 月起兼任海富通欣益混合基金经理。2025 年 12 月起兼任海富通中证 A500 指数增强基金经理。
杜晓海	本基金的基金经理；	2018-04-09	-	25 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

	<p>总经理助理。</p>			<p>中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监、量化投资部总监，现任海富通基金管理有限公司总经理助理。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 月至 2023 年 10 月兼任海富通富盈混合</p>
--	---------------	--	--	--

					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 月至 2024 年 9 月兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。2023 年 10 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。2024 年 3 月至 2025 年 6 月兼任海富通 ESG 领先股票基金经理。2024 年 6 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 发起联接基金经理。
--	--	--	--	--	---

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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
杜晓海	公募基金	7	4,296,336,968.42	2016/06/22
	私募资产管理计划	2	3,944,788,616.19	2024/11/18
	其他组合	1	395,927,811.88	2019/12/17
	合计	10	8,637,053,396.49	

注：表内任职日期为基金经理加入公司以来首次开始管理各类产品的时间。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率

为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年一季度国内经济平稳开局，结构上外需、基建投资、工业生产和服务消费是亮点。今年是“十五五”开局之年，3 月政府工作报告提出实施更加积极有为的宏观政策，增强政策前瞻性针对性协同性，着力稳就业、稳企业、稳市场、稳预期，推动经济实现质的有效提升和量的合理增长。在宏观政策节奏偏前置背景下，今年我国经济实现“十五五”良好开局，一季度经济保持平稳运行。

海外经济方面，中东地区地缘冲突对全球经济增长预期形成一定拖累。美以伊冲突背景下，原油价格高位波动，部分能源对外依存度较高的国家经济增长承压。同时，在高油价背景下，全球通胀预期升温，美联储、欧央行、英央行等对货币政策态度转向观望或偏鹰派。

从 A 股市场看，一季度市场先扬后抑。年初市场延续上涨行情，但随着中东冲突持续升温，市场高位回落。从行业维度上看，价值板块跑赢成长板块。根据申万一级行业分类，一季度表现靠前的板块是煤炭、石油石化、综合、公用事业、建筑材料，表现靠后的板块是非银金融、商贸零售、美容护理、计算机、房地产。

因子方面，本季度的市场延续了上一季度的风格，估值类因子、成长类因子、分析师因子表现较好，盈利质量、低波、反转表现较差。市值方面，小市值相对占优。报告期内，组合小幅暴露盈利质量、成长等基本面因子，根据公司基本面在盈利质量、景气度和估值匹配的公司中寻找投资机会，同时积极运用深度学习量价模型在低关注股票中挖掘机会。本基金坚持通过多策略并行的方式，力争在风险可控的基础上获取超额收益，并通过股指期货对冲将超额收益转化为绝对收益。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通阿尔法对冲混合 A 净值增长率为 0.97%，同期业绩比较基准收益率为 0.67%。海富通阿尔法对冲混合 C 净值增长率为 0.88%，同期业绩比较基准收益率为 0.67%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

## §5 投资组合报告

## 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	102,175,528.72	63.86
	其中：股票	102,175,528.72	63.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,360,979.99	7.73
	其中：债券	12,360,979.99	7.73
	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	33,622,582.32	21.01
8	其他资产	11,841,684.05	7.40
9	合计	160,000,775.08	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,009,222.30	2.56
C	制造业	75,340,386.42	48.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,212,618.00	1.41
E	建筑业	1,075,673.00	0.69
F	批发和零售业	1,261,673.00	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	1,387,136.72	0.88
H	住宿和餐饮业	28,462.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,291,716.44	3.37
J	金融业	5,148,297.20	3.28

K	房地产业	1,033,973.00	0.66
L	租赁和商务服务业	1,400,426.00	0.89
M	科学研究和技术服务业	2,387,235.64	1.52
N	水利、环境和公共设施管理业	673,320.00	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	647,403.00	0.41
R	文化、体育和娱乐业	277,986.00	0.18
S	综合	-	-
	合计	102,175,528.72	65.13

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	7,880	3,165,396.00	2.02
2	300308	中际旭创	2,500	1,423,525.00	0.91
3	601899	紫金矿业	42,738	1,398,387.36	0.89
4	300502	新易盛	2,444	1,082,300.96	0.69
5	601318	中国平安	16,700	948,226.00	0.60
6	600519	贵州茅台	600	870,000.00	0.55
7	002475	立讯精密	16,120	794,071.20	0.51
8	603259	药明康德	7,800	765,180.00	0.49
9	000100	TCL 科技	160,200	684,054.00	0.44
10	300088	长信科技	101,300	596,657.00	0.38

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,066,372.60	3.23
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）	7,294,607.39	4.65
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,360,979.99	7.88

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019773	25 国债 08	50,000	5,066,372.60	3.23
2	113052	兴业转债	2,700	323,187.04	0.21
3	118034	晶能转债	1,700	206,796.52	0.13
4	118031	天 23 转债	1,200	151,745.42	0.10
5	113640	苏利转债	1,100	151,671.16	0.10

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IM2606	IM2606	-19.00	-28,050,080.00	-2,606,798.09	-

IF2609	IF2609	-5.00	-6,444,900.00	321,840.00	-
IM2609	IM2609	-3.00	-4,298,280.00	429,440.00	-
IC2606	IC2606	-10.00	-14,876,800.00	-89,320.00	-
IF2606	IF2606	-25.00	-32,844,000.00	865,355.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-1,079,483.09
股指期货投资本期收益(元)					-7,814,316.49
股指期货投资本期公允价值变动(元)					5,621,334.05

注：股指期货投资本期收益中已扣除本期股指期货差价收入应缴纳增值税额。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

## 5.11 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 102,175,528.72 元，占基金资产净值的比例为 65.13%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-86,514,060.00 元，占基金资产净值的比例为-55.14%，空头合约市值占股票资产的比例为-84.67%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 2,918,744.99 元，公允价值变动损益为-1,262,381.64 元。

## 5.12 投资组合报告附注

5.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

### 5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	10,531,878.78
2	应收证券清算款	1,277,286.55
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	32,518.72
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	11,841,684.05

### 5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	323,187.04	0.21
2	118034	晶能转债	206,796.52	0.13
3	118031	天 23 转债	151,745.42	0.10
4	113640	苏利转债	151,671.16	0.10
5	123225	翔丰转债	151,667.10	0.10
6	118022	锂科转债	148,710.58	0.09
7	127018	本钢转债	142,901.59	0.09
8	113649	丰山转债	139,453.97	0.09
9	113618	美诺转债	139,193.27	0.09
10	113667	春 23 转债	136,448.38	0.09
11	118024	冠宇转债	133,818.01	0.09
12	127040	国泰转债	133,527.32	0.09

13	123193	海能转债	126,703.70	0.08
14	113654	永 02 转债	123,965.14	0.08
15	127059	永东转 2	118,788.29	0.08
16	123236	家联转债	117,932.27	0.08
17	128125	华阳转债	117,640.96	0.07
18	113042	上银转债	111,283.77	0.07
19	111004	明新转债	109,072.77	0.07
20	127095	广泰转债	109,055.45	0.07
21	123112	万讯转债	108,329.32	0.07
22	127044	蒙娜转债	108,296.56	0.07
23	113632	鹤 21 转债	107,786.08	0.07
24	127034	绿茵转债	107,200.88	0.07
25	123172	漱玉转债	105,265.42	0.07
26	127054	双箭转债	102,962.65	0.07
27	128134	鸿路转债	98,706.19	0.06
28	128129	青农转债	96,687.00	0.06
29	127041	弘亚转债	96,272.88	0.06
30	111000	起帆转债	95,261.37	0.06
31	127030	盛虹转债	95,211.07	0.06
32	128141	旺能转债	91,476.19	0.06
33	113665	汇通转债	91,211.25	0.06
34	113659	莱克转债	90,009.93	0.06
35	113070	渝水转债	88,915.32	0.06
36	127024	盈峰转债	88,675.14	0.06
37	127056	中特转债	87,711.92	0.06
38	113605	大参转债	87,364.03	0.06
39	111005	富春转债	86,566.27	0.06
40	128121	宏川转债	86,051.67	0.05
41	127068	顺博转债	86,032.51	0.05
42	128136	立讯转债	85,612.21	0.05
43	110077	洪城转债	84,263.45	0.05

44	113661	福 22 转债	81,814.44	0.05
45	113644	艾迪转债	80,990.38	0.05
46	127031	洋丰转债	76,638.41	0.05
47	123076	强力转债	76,483.81	0.05
48	110086	精工转债	75,210.58	0.05
49	118003	华兴转债	70,397.63	0.04
50	123054	思特转债	66,249.86	0.04
51	127105	龙星转债	65,806.73	0.04
52	111010	立昂转债	65,801.85	0.04
53	113686	泰瑞转债	64,223.67	0.04
54	113056	重银转债	63,419.66	0.04
55	118004	博瑞转债	63,074.68	0.04
56	127089	晶澳转债	62,518.99	0.04
57	123165	回天转债	62,146.44	0.04
58	127053	豪美转债	60,827.14	0.04
59	110075	南航转债	59,033.22	0.04
60	123158	宙邦转债	51,961.44	0.03
61	113674	华设转债	51,866.68	0.03
62	123109	昌红转债	50,800.00	0.03
63	127102	浙建转债	49,751.02	0.03
64	110085	通 22 转债	48,564.81	0.03
65	113584	家悦转债	44,058.03	0.03
66	123114	三角转债	43,198.23	0.03
67	110073	国投转债	42,868.11	0.03
68	127025	冀东转债	42,233.75	0.03
69	113681	镇洋转债	41,523.92	0.03
70	113631	皖天转债	40,784.43	0.03
71	123149	通裕转债	40,031.10	0.03
72	113655	欧 22 转债	39,745.73	0.03
73	128128	齐翔转 2	38,124.58	0.02
74	127045	牧原转债	38,099.88	0.02

75	118049	汇成转债	37,477.56	0.02
76	113650	博 22 转债	37,245.25	0.02
77	118032	建龙转债	37,073.67	0.02
78	111009	盛泰转债	36,761.01	0.02
79	127027	能化转债	35,820.29	0.02
80	110097	天润转债	28,222.85	0.02
81	123121	帝尔转债	27,145.92	0.02
82	118025	奕瑞转债	27,078.55	0.02
83	118030	睿创转债	25,870.25	0.02
84	127062	垒知转债	25,700.85	0.02
85	123119	康泰转 2	24,997.15	0.02
86	118005	天奈转债	24,942.50	0.02
87	113625	江山转债	24,684.19	0.02
88	118051	皓元转债	20,344.87	0.01

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通阿尔法对冲混 合A	海富通阿尔法对冲混 合C
本报告期期初基金份额总额	155,682,259.44	40,241,101.28
本报告期基金总申购份额	4,878,776.72	451,322.36
减：本报告期基金总赎回份额	21,444,388.25	30,062,269.26
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	139,116,647.91	10,630,154.38

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金募集期间，本基金管理人运用自有资金总计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 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 136 只公募基金。截至 2026 年 3 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 2833 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。2008 年 3 月，海富通获批从事特定客户资产管理业务。2010 年 12 月，海富通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，中国保险监督管理委员会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人。2016 年 12 月，海富通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。

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金的文件

- (二)海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金基金合同
- (三)海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金招募说明书
- (四)海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

## 10.2 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

## 10.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司  
二〇二六年四月二十二日