

海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金
2022 年中期报告
2022 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：二〇二二年八月三十一日

§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 2022 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 2022 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	14
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	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	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	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	60
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	60
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 市场中性策略执行情况	61
7.13 投资组合报告附注	61
§8 基金份额持有人信息	62

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	63
9 开放式基金份额变动	63
§10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	66
§11 影响投资者决策的其他重要信息	67
§12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§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	1,738,654,589.36 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	1,652,244,507.14 份	86,410,082.22 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	95566
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022年1月1日至2022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	-115,592,068.66	-3,110,291.41
本期利润	-104,332,946.73	-1,196,685.82
加权平均基金份额本期利润	-0.0390	-0.0107
本期加权平均净值利润率	-3.39%	-0.94%
本期基金份额净值增长率	-1.55%	-1.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022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	236,377,673.97	11,373,519.50
期末可供分配基金份额利润	0.1431	0.1316
期末基金资产净值	1,921,509,221.12	99,532,937.03
期末基金份额净值	1.1630	1.1519
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022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	60.99%	2.85%

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	1.90%	0.49%	0.22%	0.01%	1.68%	0.48%
过去三个月	1.19%	0.40%	0.68%	0.01%	0.51%	0.39%
过去六个月	-1.55%	0.40%	1.35%	0.01%	-2.90%	0.39%
过去一年	-0.85%	0.38%	2.75%	0.01%	-3.60%	0.37%
过去三年	8.72%	0.35%	8.49%	0.01%	0.23%	0.34%
自基金合同生效起至今	60.99%	0.34%	23.86%	0.01%	37.13%	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	1.87%	0.50%	0.22%	0.01%	1.65%	0.49%
过去三个月	1.10%	0.40%	0.68%	0.01%	0.42%	0.39%
过去六个月	-1.74%	0.40%	1.35%	0.01%	-3.09%	0.39%
过去一年	-1.21%	0.38%	2.75%	0.01%	-3.96%	0.37%
自基金合同生效起至今	2.85%	0.38%	6.84%	0.01%	-3.99%	0.37%

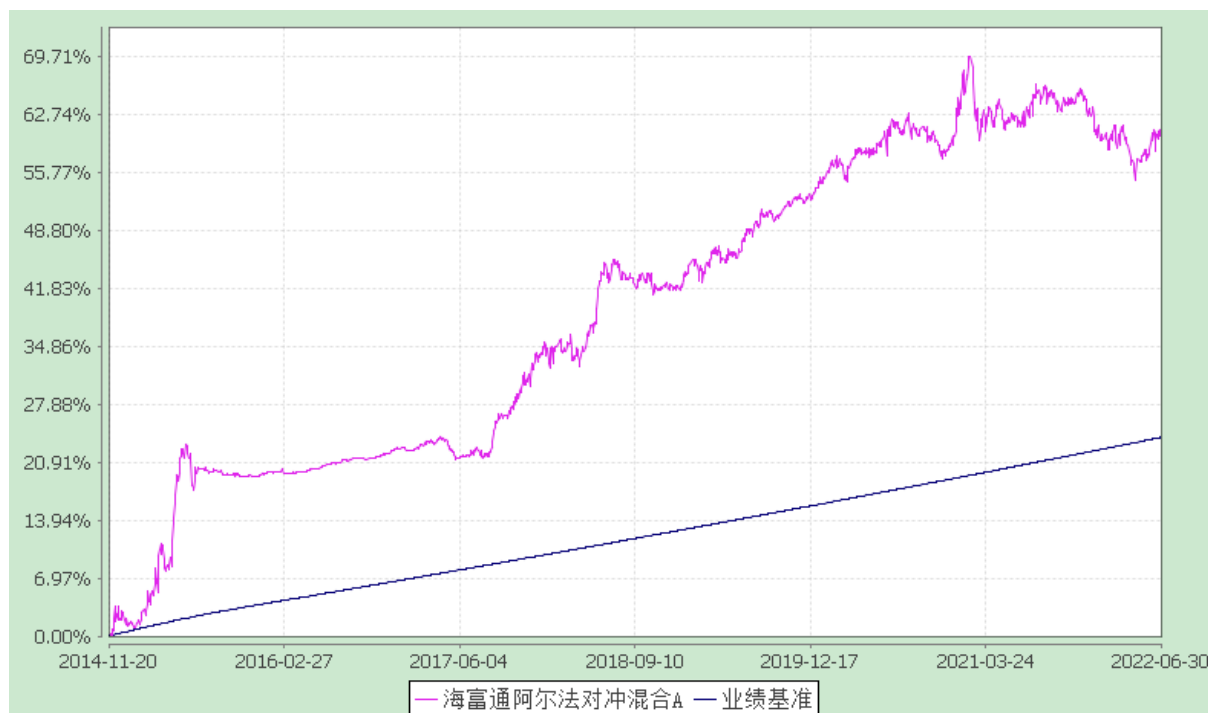
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014 年 11 月 20 日至 2022 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 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 94 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、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币基金、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、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、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、海富通惠鑫混合型证券投资基金、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		
朱斌全	本基金的基金经理	2018-11-30	-	15 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2006 年 8 月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交易员。2007 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，历任交易员、高级交易员、量化分析师、投

					资经理、基金经理助理。2018 年 11 月起任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通富祥混合、海富通沪深 300 增强（原海富通富睿混合）、海富通量化多因子混合及海富通欣益混合的基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通欣享混合、海富通新内需混合的基金经理。
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	-	22 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监，现任海富通基金管理有限公司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 月起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。
--	--	--	--	--	--

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。

3、本公司于 2022 年 8 月 16 日发布公告，自 2022 年 8 月 15 日起，朱斌全先生不再担任本基金的基金经理。

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

2022 年上半年，中美经济与政策周期继续错位。中国面临经济下行压力，叠加疫情的冲击，导致二季度经济出现快速下探，宏观政策迅速转向宽松，推出稳增长一揽子措施。随着疫情受控、政策发力，中国经济在 5、6 月份快速修复。海外方面，在不断的货币宽松刺激下，美国通胀水平持续抬升，俄乌冲突又进一步加剧了本就高企的通胀，同时 4 月受中国疫情冲击全球供应链受到较大影响，种种因素导致大宗商品价格暴涨，美国、欧洲通胀水平持续上升。美联储加息路径不断上修，带来美债收益率的大幅上升，全球资本市场在美联储收紧、俄乌冲突、中国疫情等冲击下出现剧烈波动。

A 股市场整体走势如同 V 字型态势，风格出现明显变化。1 月-4 月底前，逆周期、稳增长、通胀交易的相关资产表现较好，成长、消费风格的资产快速下行。随着 4 月底政治局会议明确稳增长，以及上海疫情初步得到控制、充裕的流动性发挥作用，权益市场出现大幅反弹。市场风格向成长板块明显偏移。上半年 A 股主要指数方面，上证指数下跌 6.63%，沪深 300 下跌 9.22%，中证 800 下跌 9.97%，中小综指下跌 10.77%，创业板指下跌 15.41%。分行业看，周期行业表现相对较好，煤炭上涨 31.38%，交通运输、综合、美容护理和房地产分别下跌 0.71%、1.46%、1.81% 和 2.31%；成长明显落后，电子、计算机、传媒、国防军工和环保分别下跌 24.46%、23.64%、22.25%、20.05% 和 16.42%。

从上半年市场内部的结构看，逆周期的建筑地产和通胀交易的煤炭等大宗商品交相呼应成为市场两条主线。周期主线在一季度演绎得淋漓尽致，尤其在俄乌冲突加剧全球通胀走势的背景下，与此匹配的是相关行业上半年的业绩表现。上游价格的大幅上行部分侵蚀了中下游行业的利润。成长行业内部，高景气的新能源汽车、光伏、风电等反弹幅度明显高于景气度偏弱的半导体、计算机等。消费领域的疫后复苏主线演绎非常充分，包括白酒以及航空、酒店、免税等。市场 1-4 月亏钱效应明显，5、6 月份赚钱效应明显，但前后风格差异明显。整个市场反映出宏观大变局下的产业升级高景气带来的红利，优势产业成为市场配置热点。

回顾上半年的业绩表现，一季度较为平稳，4 月份受到上海疫情的影响，基金经历了一波快速下跌，基金操作主要以控制回撤为主。从 4 月中下旬开始，量化模型开始逐步看多成长板块个股，基金开始超配电力设备、军工、汽车、电子等板块，取得了较为明显的超额收益。随着中证 1000 股指期货上市，量化对冲策略将迎来新的发展机会，可匹配的现货资产扩大到中证 800 指数和中证 1000 指数的所有成分股，在使用量化模型构建投资组合时，选股范围更大，对冲策略更灵活。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通阿尔法对冲混合 A 净值增长率为-1.55%，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 2.90 个百分点。海富通阿尔法对冲混合 C 净值增长率为-1.74%，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 3.09 个百分点。因市场波动较大，股票组合跑输了基准指数。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济复苏态势或依然延续，但幅度可能偏弱。内需、外需均有隐忧，流动性将继续维持在相对宽松的状态。出口与制造业将逐步面临外需下行的压力，地产压力仍需更多的政策智慧解决，消费的恢复继续分化，基建将是确定性最高的支撑领域。货币政策将保持相对宽松的状态，但受制于通胀上行、内外均衡等可能难以更加宽松，但剩余流动性对 A 股依然偏正面。

下半年，回归业绩确定性，从上游到下游，从短久期到长久期。上游原材料价格压力下半年将逐步明显，中下游盈利或将改善。产业趋势变化将是权益市场的主要驱动力。经济结构变化带来的红利较为确定，电动车、光伏、风电、储能、半导体等受益于产业趋势政策导向的行业投资机会，或更加容易把握。

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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	48,595,956.25	25,575,384.21
结算备付金		281,405,061.16	830,031,640.77
存出保证金		145,497,824.14	362,491,571.39
交易性金融资产	6.4.7.2	1,475,989,157.56	3,616,195,928.11
其中：股票投资		1,352,039,745.92	3,390,490,451.30
基金投资		-	-
债券投资		123,949,411.64	225,705,476.81
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	80,000,000.00	-
应收清算款		27,507,336.05	10,072,775.90
应收股利		-	-
应收申购款		202,410.55	184,178.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	2,678,384.91
资产总计		2,059,197,745.71	4,847,229,863.74
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		-	10,000,000.00
应付清算款		7,828,547.61	-
应付赎回款		24,628,279.28	5,283,056.30
应付管理人报酬		2,710,102.06	6,514,514.20
应付托管费		451,683.69	1,085,752.34
应付销售服务费		34,496.01	44,448.90
应付投资顾问费		-	-
应交税费		748.13	17.30
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,501,730.78	5,084,442.33
负债合计		38,155,587.56	28,012,231.37
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,738,654,589.36	4,080,424,362.60

未分配利润	6.4.7.8	282,387,568.79	738,793,269.77
净资产合计		2,021,042,158.15	4,819,217,632.37
负债和净资产总计		2,059,197,745.71	4,847,229,863.74

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.1630 元，C 类基金份额净值 1.1519 元。基金份额总额 1,738,654,589.36 份，其中 A 类基金份额 1,652,244,507.14 份，C 类基金份额 86,410,082.22 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-76,181,731.53	259,859,524.86
1.利息收入		6,943,372.54	21,683,159.24
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,835,914.55	14,338,318.33
债券利息收入		-	6,250,559.13
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		107,457.99	1,094,281.78
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-100,305,904.54	491,150,243.09
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-360,375,085.52	1,024,056,758.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	3,091,673.89	-32,812,376.81
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	246,933,123.81	-535,003,076.00
股利收益	6.4.7.14	10,044,383.28	34,908,937.62
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	13,172,727.52	-259,965,795.21
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	4,008,072.95	6,991,917.74
减：二、营业总支出		29,347,901.02	105,068,877.81
1. 管理人报酬		24,028,878.13	66,919,364.28
2. 托管费		4,004,813.07	11,153,227.29
3. 销售服务费		250,266.24	416,844.35
4. 投资顾问费		-	-

5. 利息支出		21,998.66	7,218.89
其中：卖出回购金融资产支出		21,998.66	7,218.89
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		902,025.35	10,249.83
8. 其他费用	6.4.7.17	139,919.57	26,561,973.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-105,529,632.55	154,790,647.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-105,529,632.55	154,790,647.05
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-105,529,632.55	154,790,647.05

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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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.基金申购款	478,749,664.67	-	69,731,107.12	548,480,771.79
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
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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)	8,996,705,240.48	-	1,415,502,337.74	10,412,207,578.22
二、本期期初净资产(基金净值)	8,996,705,240.48	-	1,415,502,337.74	10,412,207,578.22
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,914,776,301.33	-	-366,593,369.97	-3,281,369,671.30
(一)、综合收益总额	-	-	154,790,647.05	154,790,647.05
(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)	-2,914,776,301.33	-	-521,384,017.02	-3,436,160,318.35
其中：1.基金申购款	1,216,821,071.21	-	215,005,852.21	1,431,826,923.42
2.基金赎回款	-4,131,597,372.54	-	-736,389,869.23	-4,867,987,241.77
(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)	6,081,928,939.15	-	1,048,908,967.77	7,130,837,906.92

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 2022 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况、2022 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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外,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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》。

(a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类:(1)以摊余成本计量的金融资产;(2)以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产;及(3)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下,金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的业务模式及该资

产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

(i) 金融工具的分类影响

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收证券清算款、应收利息和应收申购款，金额分别为人民币 25,575,384.21 元、人民币 830,031,640.77 元、人民币 362,491,571.39 元、人民币 10,072,775.90 元、人民币 2,678,384.91 元和人民币 184,178.45 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收清算款、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为人民币 25,582,101.33 元、人民币 830,730,423.90 元、人民币 362,492,067.49 元、人民币 10,072,775.90 元、人民币 0.00 元和人民币 184,178.46 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为人民币 3,616,195,928.11 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为人民币 3,618,168,316.66 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债，金额分别为人民币 10,000,000.00 元、人民币 5,283,056.30 元、人民币 6,514,514.20 元、人民币 1,085,752.34 元、人民币 44,448.90 元、人民币 4,881,863.00 元和人民币 202,579.33 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债，金额分别为人民币 10,000,000.00 元、人民币 5,283,056.30 元、人民币 6,514,514.20 元、人民币 1,085,752.34 元、人民币 44,448.90 元、人民币 4,881,863.00 元和人民币 202,579.33 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(c)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(d)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	48,595,956.25
等于：本金	48,585,142.79
加：应计利息	10,813.46
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	48,595,956.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,259,068,665.61	-	1,352,039,745.92	92,971,080.31

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	121,501,299.37	2,276,402.51	123,949,411.64	171,709.76
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	121,501,299.37	2,276,402.51	123,949,411.64	171,709.76
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,380,569,964.98	2,276,402.51	1,475,989,157.56	93,142,790.07

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 2022年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-1,181,669,998.10	-	-	-
——股指期货	-1,181,669,998.10	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-1,181,669,998.10	-	-	-

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
IF2209	沪深300股指期货 2209	-820.00	-1,094,011,200.00	16,517,698.10
IF2212	沪深300股指期货 2212	-57.00	-75,821,400.00	-4,680,300.00
合计	-	-	-	11,837,398.10
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	11,837,398.10
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
第 25 页共 69 页

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

单位:人民币元

项目	本期末 2022年6月30日	
	账面余额	其中:买断式逆回购
交易所市场	80,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	80,000,000.00	-

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 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	63,376.83
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,344,134.40
其中:交易所市场	2,344,134.40
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,219.55
合计	2,501,730.78

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 2022年1月1日至2022年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,980,959,175.68	3,980,959,175.68
本期申购	291,866,861.63	291,866,861.63
本期赎回（以“-”号填列）	-2,620,581,530.17	-2,620,581,530.17
本期末	1,652,244,507.14	1,652,244,507.14

海富通阿尔法对冲混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	99,465,186.92	99,465,186.92
本期申购	186,882,803.04	186,882,803.04
本期赎回（以“-”号填列）	-199,937,907.74	-199,937,907.74
本期末	86,410,082.22	86,410,082.22

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	705,247,272.72	16,413,028.37	721,660,301.09
本期利润	-115,592,068.66	11,259,121.93	-104,332,946.73
本期基金份额交易产生的变动数	-353,277,530.09	5,214,889.71	-348,062,640.38
其中：基金申购款	44,286,296.81	650,369.52	44,936,666.33
基金赎回款	-397,563,826.90	4,564,520.19	-392,999,306.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	236,377,673.97	32,887,040.01	269,264,713.98

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	16,673,379.50	459,589.18	17,132,968.68
本期利润	-3,110,291.41	1,913,605.59	-1,196,685.82

本期基金份额交易产生的变动数	-2,189,568.59	-623,859.46	-2,813,428.05
其中：基金申购款	23,289,360.97	1,505,079.82	24,794,440.79
基金赎回款	-25,478,929.56	-2,128,939.28	-27,607,868.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,373,519.50	1,749,335.31	13,122,854.81

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	339,904.63
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	6,481,909.17
其他	14,100.75
合计	6,835,914.55

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	5,703,426,868.63
减：卖出股票成本总额	6,051,136,504.96
减：交易费用	12,665,449.19
买卖股票差价收入	-360,375,085.52

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 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,667,573.73
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,424,100.16
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	3,091,673.89

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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	110,024,682.47
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	107,237,621.25
减：应计利息总额	1,362,842.44
减：交易费用	118.62
买卖债券差价收入	1,424,100.16

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 2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益（税前）	254,645,924.74
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	7,514,398.02
减：交易费用	198,402.91
合计	246,933,123.81

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	10,044,383.28
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	10,044,383.28

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-36,777,927.74
——股票投资	-36,978,981.31
——债券投资	201,053.57
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-

2.衍生工具	49,950,655.26
——权证投资	-
——股指期货	49,950,655.26
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	13,172,727.52

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	3,981,847.18
基金转换费收入	26,225.77
合计	4,008,072.95

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 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	27,100.02
其他费用	600.00
债券托管账户维护费	18,000.00
合计	139,919.57

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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%	2,240,120,695.80	11.89%

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

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	24,028,878.13	66,919,364.28
其中：支付销售机构的客户维护费	4,738,680.37	11,770,507.22

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,004,813.07	11,153,227.29

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		

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

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固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固有资金投资本基金。

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	上年度可比期间

	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021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	48,595,956.25	339,904.63	433,797,300.16	733,937.99

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

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（2022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
300834	星辉环材	2022-01-06	6个月以上	新股锁定	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301112	信邦智能	2022-06-20	6个月以上	新股锁定	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301116	益客食品	2022-01-10	6个月以上	新股锁定	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301117	佳缘科技	2022-01-07	6个月以上	新股锁定	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6个月以上	新股锁定	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301125	腾亚精工	2022-05-27	6个月以上	新股锁定	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6个月以上	新股锁定	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301137	哈焊华通	2022-03-14	6个月以上	新股锁定	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301151	冠龙节能	2022-03-30	6个月以上	新股锁定	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301153	中科江南	2022-05-10	6个月以上	新股锁定	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301158	德石股份	2022-01-07	6个月以上	新股锁定	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301175	中科环保	2022-06-30	6个月以上	新股未上市并锁定	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40	-
301175	中科环保	2022-06-30	1个月内(含)	新股未上市	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6个月以上	新股锁定	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301215	中汽股份	2022-02-28	6个月以上	新股锁定	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301216	万凯新材	2022-03-21	6个月以上	新股锁定	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-
301217	铜冠铜箔	2022-01-20	6个月以上	新股锁定	17.27	14.83	4,284	73,984.68	63,531.72	-
301218	腾远	2022-0	6个月	新股	173.98	87.82	578	55,847	50,759	-

9	钴业	3-10	以上	锁定				.58	.96	
301220	亚香股份	2022-06-15	6个月以上	新股锁定	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301222	浙江恒威	2022-03-02	6个月以上	新股锁定	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301228	实朴检测	2022-01-21	6个月以上	新股锁定	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6个月以上	新股未上市并锁定	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	1个月内(含)	新股未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301235	华康医疗	2022-01-21	6个月以上	新股锁定	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301237	和顺科技	2022-03-16	6个月以上	新股锁定	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301256	华融化学	2022-03-14	6个月以上	新股锁定	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301258	富士莱	2022-03-21	6个月以上	新股锁定	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301263	泰恩康	2022-03-22	6个月以上	新股锁定	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301268	铭利达	2022-03-29	6个月以上	新股锁定	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301279	金道科技	2022-04-06	6个月以上	新股锁定	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
301288	清研环境	2022-04-14	6个月以上	新股锁定	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301298	东利机械	2022-05-27	6个月以上	新股锁定	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
688223	晶科能源	2022-01-19	6个月以上	新股锁定	5.00	14.47	213,000	1,065,000.00	3,082,110.00	-
688251	井松智能	2022-05-27	6个月以上	新股锁定	35.62	36.66	3,392	120,823.04	124,350.72	-
688349	三一重能	2022-06-15	6个月以上	新股锁定	29.80	36.94	32,650	972,970.00	1,206,091.00	-

注：1、根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算，在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金持有的上市公司非公开发行股份，减持

采取集中竞价交易方式或采取大宗交易方式的根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由法规规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

2、[301219]腾远钴业于 2022 年 3 月 10 日中签新股锁定流通受限数量 321 股，成本 55,847.58 元；于 2022 年 5 月 24 日送股，数量 257 股。因此总数量 578 股，总成本 55,847.58 元。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2022 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 2022 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 2022 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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公

司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放于信用良好的银行，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 2022 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 0.04%（2021 年 12 月 31 日：0.11%）。

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	123,059,376.24	220,427,861.50
合计	123,059,376.24	220,427,861.50

注：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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	801,738.23	4,722,500.00
AAA 以下	88,297.17	555,115.31
未评级	-	-
合计	890,035.40	5,277,615.31

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于

流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.26%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	48,595,956.25	-	-	-	48,595,956.25
结算备付金	281,405,061.16	-	-	-	281,405,061.16
存出保证金	145,497,824.14	-	-	-	145,497,824.14
交易性金融资产	123,860,995.47	561.59	87,854.58	1,352,039,745.92	1,475,989,157.56
买入返售金融资产	80,000,000.00	-	-	-	80,000,000.00
应收清算款	-	-	-	27,507,336.05	27,507,336.05
应收申购款	-	-	-	202,410.55	202,410.55
资产总计	679,359,837.02	561.59	87,854.58	1,379,749,492.52	2,059,197,745.71
负债					
应付证券清算款	-	-	-	7,828,547.61	7,828,547.61
应付赎回款	-	-	-	24,628,279.28	24,628,279.28
应付管理人报酬	-	-	-	2,710,102.06	2,710,102.06
应付托管费	-	-	-	451,683.69	451,683.69
应付销售服务费	-	-	-	34,496.01	34,496.01
应交税费	-	-	-	748.13	748.13
其他负债	-	-	-	2,501,730.78	2,501,730.78
负债总计	-	-	-	38,155,587.56	38,155,587.56
利率敏感度缺口	679,359,837.02	561.59	87,854.58	1,341,593,904.96	2,021,042,158.15
上年度末					
2021 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	25,575,384.21	-	-	-	25,575,384.21
结算备付金	830,031,640.77	-	-	-	830,031,640.77
存出保证金	1,102,414.19	-	-	361,389,157.20	362,491,571.39
交易性金融资产	220,427,861.50	978,500.00	4,299,115.31	3,390,490,451.30	3,616,195,928.11
应收清算款	-	-	-	10,072,775.90	10,072,775.90

应收申购款	-	-	-	184,178.45	184,178.45
其他资产	-	-	-	2,678,384.91	2,678,384.91
资产总计	1,077,137,300.67	978,500.00	4,299,115.31	3,764,814,947.76	4,847,229,863.74
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	5,283,056.30	5,283,056.30
应付管理人报酬	-	-	-	6,514,514.20	6,514,514.20
应付托管费	-	-	-	1,085,752.34	1,085,752.34
应付销售服务费	-	-	-	44,448.90	44,448.90
应交税费	-	-	-	17.30	17.30
其他负债	-	-	-	5,084,442.33	5,084,442.33
负债总计	10,000,000.00	-	-	18,012,231.37	28,012,231.37
利率敏感度缺口	1,067,137,300.67	978,500.00	4,299,115.31	3,746,802,716.39	4,819,217,632.37

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-20,790.49	-365,834.58
	市场利率下降 25 个基点	20,865.08	368,068.30

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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	1,352,039,74 5.92	66.90	3,390,490,451 .30	70.35
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	1,352,039,74	66.90	3,390,490,451	70.35
	5.92		.30	

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	12,811,508.07	31,224,654.10
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	-12,811,508.07	-31,224,654.10

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的层次，由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决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	1,347,709,766.16	3,370,116,297.73
第二层次	123,368,122.84	246,079,630.38
第三层次	4,911,268.56	-
合计	1,475,989,157.56	3,616,195,928.11

6.4.14.2.2 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债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不

活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票、债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 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(2021 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买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债,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	1,352,039,745.92	65.66
	其中:股票	1,352,039,745.92	65.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	123,949,411.64	6.02
	其中:债券	123,949,411.64	6.02
	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	80,000,000.00	3.89
	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	330,001,017.41	16.03
8	其他各项资产	173,207,570.74	8.41
9	合计	2,059,197,745.71	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	9,515,065.20	0.47
B	采矿业	29,730,048.88	1.47
C	制造业	886,307,131.10	43.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,940,957.96	1.14
E	建筑业	34,183,465.00	1.69
F	批发和零售业	15,213,984.60	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	23,136,527.62	1.14
H	住宿和餐饮业	181,040.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,987,174.63	0.89
J	金融业	179,834,769.80	8.90
K	房地产业	72,724,935.23	3.60
L	租赁和商务服务业	24,353,757.02	1.21
M	科学研究和技术服务业	26,300,697.19	1.30
N	水利、环境和公共设施管理业	1,156,381.13	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,687,109.56	0.28
R	文化、体育和娱乐业	2,786,701.00	0.14
S	综合	-	-
	合计	1,352,039,745.92	66.90

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	44,350	90,695,750.00	4.49
2	600036	招商银行	1,137,497	48,002,373.40	2.38

3	300750	宁德时代	70,400	37,593,600.00	1.86
4	300059	东方财富	1,448,044	36,780,317.60	1.82
5	002271	东方雨虹	569,941	29,334,863.27	1.45
6	600048	保利发展	1,427,073	24,916,694.58	1.23
7	601888	中国中免	99,111	23,085,925.23	1.14
8	002594	比亚迪	68,600	22,877,414.00	1.13
9	300122	智飞生物	192,922	21,416,271.22	1.06
10	601668	中国建筑	3,553,700	18,905,684.00	0.94
11	000568	泸州老窖	73,394	18,094,556.76	0.90
12	002812	恩捷股份	71,297	17,856,333.65	0.88
13	000858	五粮液	84,400	17,042,892.00	0.84
14	002049	紫光国微	78,400	14,874,048.00	0.74
15	001979	招商蛇口	1,098,373	14,751,149.39	0.73
16	600383	金地集团	1,084,600	14,577,024.00	0.72
17	300373	扬杰科技	194,100	13,829,625.00	0.68
18	601012	隆基绿能	206,818	13,780,283.34	0.68
19	002142	宁波银行	383,734	13,741,514.54	0.68
20	600887	伊利股份	343,823	13,391,905.85	0.66
21	600030	中信证券	618,100	13,388,046.00	0.66
22	600900	长江电力	554,233	12,813,866.96	0.63
23	600809	山西汾酒	39,180	12,725,664.00	0.63
24	603259	药明康德	120,168	12,496,270.32	0.62
25	300363	博腾股份	157,000	12,244,430.00	0.61
26	603659	璞泰来	143,160	12,082,704.00	0.60
27	002244	滨江集团	1,329,000	11,495,850.00	0.57
28	002821	凯莱英	38,400	11,097,600.00	0.55
29	300035	中科电气	385,800	10,783,110.00	0.53
30	300601	康泰生物	238,140	10,759,165.20	0.53
31	600153	建发股份	771,600	10,084,812.00	0.50
32	601211	国泰君安	635,500	9,659,600.00	0.48
33	000333	美的集团	158,943	9,598,567.77	0.47
34	002304	洋河股份	51,900	9,505,485.00	0.47
35	000983	山西焦煤	680,500	9,111,895.00	0.45
36	002714	牧原股份	161,260	8,912,840.20	0.44
37	300438	鹏辉能源	144,200	8,861,090.00	0.44
38	601688	华泰证券	594,600	8,443,320.00	0.42
39	600438	通威股份	140,700	8,422,302.00	0.42
40	600309	万华化学	85,823	8,323,972.77	0.41
41	300124	汇川技术	124,289	8,186,916.43	0.41
42	600176	中国巨石	466,926	8,129,181.66	0.40
43	600563	法拉电子	39,116	8,025,038.56	0.40
44	300763	锦浪科技	37,050	7,891,650.00	0.39
45	300769	德方纳米	18,820	7,691,357.60	0.38
46	603456	九洲药业	140,100	7,243,170.00	0.36

47	002352	顺丰控股	125,500	7,004,155.00	0.35
48	300450	先导智能	110,357	6,972,355.26	0.34
49	600522	中天科技	296,500	6,849,150.00	0.34
50	600009	上海机场	119,500	6,775,650.00	0.34
51	600031	三一重工	350,931	6,688,744.86	0.33
52	601689	拓普集团	95,600	6,541,908.00	0.32
53	300014	亿纬锂能	66,700	6,503,250.00	0.32
54	601838	成都银行	388,000	6,433,040.00	0.32
55	603290	斯达半导	16,600	6,405,940.00	0.32
56	002756	永兴材料	41,900	6,377,599.00	0.32
57	600919	江苏银行	890,300	6,338,936.00	0.31
58	601677	明泰铝业	262,144	6,239,027.20	0.31
59	300347	泰格医药	54,117	6,193,690.65	0.31
60	000776	广发证券	325,500	6,086,850.00	0.30
61	600958	东方证券	591,600	6,040,236.00	0.30
62	002371	北方华创	21,700	6,013,504.00	0.30
63	002460	赣锋锂业	39,950	5,940,565.00	0.29
64	603986	兆易创新	41,363	5,882,232.23	0.29
65	601899	紫金矿业	621,978	5,803,054.74	0.29
66	603198	迎驾贡酒	88,200	5,745,348.00	0.28
67	603392	万泰生物	36,900	5,730,570.00	0.28
68	300760	迈瑞医疗	18,285	5,726,862.00	0.28
69	603078	江化微	195,300	5,579,721.00	0.28
70	601009	南京银行	516,800	5,385,056.00	0.27
71	000596	古井贡酒	21,100	5,267,826.00	0.26
72	600233	圆通速递	249,629	5,089,935.31	0.25
73	688202	美迪西	14,913	5,064,603.93	0.25
74	300751	迈为股份	10,120	4,967,908.00	0.25
75	300268	佳沃食品	163,400	4,861,150.00	0.24
76	002466	天齐锂业	38,800	4,842,240.00	0.24
77	600486	扬农化工	36,200	4,824,736.00	0.24
78	000933	神火股份	367,300	4,804,284.00	0.24
79	300496	中科创达	36,247	4,729,508.56	0.23
80	002129	TCL 中环	78,800	4,640,532.00	0.23
81	600690	海尔智家	168,173	4,618,030.58	0.23
82	600426	华鲁恒升	150,500	4,394,600.00	0.22
83	600863	内蒙华电	1,187,500	4,334,375.00	0.21
84	000932	华菱钢铁	836,100	4,255,749.00	0.21
85	600926	杭州银行	282,497	4,231,805.06	0.21
86	000100	TCL 科技	881,300	4,221,427.00	0.21
87	000786	北新建材	121,006	4,189,227.72	0.21
88	300260	新莱应材	79,700	4,054,339.00	0.20
89	300274	阳光电源	41,200	4,047,900.00	0.20
90	000708	中信特钢	199,096	4,011,784.40	0.20

91	603799	华友钴业	41,942	4,010,494.04	0.20
92	600502	安徽建工	555,500	3,999,600.00	0.20
93	600546	山煤国际	203,500	3,960,110.00	0.20
94	603589	口子窖	67,100	3,932,731.00	0.19
95	300015	爱尔眼科	87,828	3,932,059.56	0.19
96	601155	新城控股	154,400	3,926,392.00	0.19
97	603938	三孚股份	79,040	3,906,947.20	0.19
98	601166	兴业银行	192,954	3,839,784.60	0.19
99	002966	苏州银行	628,200	3,832,020.00	0.19
100	002562	兄弟科技	589,300	3,818,664.00	0.19
101	002738	中矿资源	40,120	3,715,513.20	0.18
102	600392	盛和资源	158,900	3,591,140.00	0.18
103	300661	圣邦股份	19,189	3,492,781.78	0.17
104	300398	飞凯材料	151,700	3,467,862.00	0.17
105	688559	海目星	46,504	3,380,840.80	0.17
106	601658	邮储银行	613,700	3,307,843.00	0.16
107	688111	金山办公	16,719	3,295,649.28	0.16
108	601117	中国化学	349,400	3,287,854.00	0.16
109	600256	广汇能源	302,500	3,188,350.00	0.16
110	600989	宝丰能源	215,100	3,151,215.00	0.16
111	002410	广联达	57,600	3,135,744.00	0.16
112	300666	江丰电子	51,400	3,135,400.00	0.16
113	002241	歌尔股份	92,100	3,094,560.00	0.15
114	688223	晶科能源	213,000	3,082,110.00	0.15
115	688516	奥特维	11,523	3,076,064.85	0.15
116	600566	济川药业	112,700	3,060,932.00	0.15
117	002472	双环传动	96,100	3,059,824.00	0.15
118	300681	英搏尔	52,950	3,058,921.50	0.15
119	300752	隆利科技	124,800	3,052,608.00	0.15
120	600089	特变电工	110,500	3,026,595.00	0.15
121	600491	龙元建设	437,600	2,984,432.00	0.15
122	002311	海大集团	49,603	2,976,676.03	0.15
123	688008	澜起科技	49,089	2,973,811.62	0.15
124	601669	中国电建	370,800	2,918,196.00	0.14
125	688378	奥来德	74,467	2,904,957.67	0.14
126	002459	晶澳科技	36,620	2,889,318.00	0.14
127	603806	福斯特	42,759	2,801,569.68	0.14
128	002475	立讯精密	82,907	2,801,427.53	0.14
129	002001	新和成	122,251	2,788,545.31	0.14
130	000733	振华科技	20,100	2,732,997.00	0.14
131	002539	云图控股	170,800	2,731,092.00	0.14
132	300413	芒果超媒	81,100	2,705,496.00	0.13
133	002865	钧达股份	28,200	2,689,152.00	0.13
134	603668	天马科技	130,800	2,680,092.00	0.13

135	002050	三花智控	96,900	2,662,812.00	0.13
136	601100	恒立液压	43,117	2,661,181.24	0.13
137	688298	东方生物	23,284	2,657,868.60	0.13
138	601919	中远海控	188,940	2,626,266.00	0.13
139	300680	隆盛科技	101,300	2,625,696.00	0.13
140	002196	方正电机	260,300	2,540,528.00	0.13
141	000301	东方盛虹	148,800	2,516,208.00	0.12
142	002759	天际股份	92,200	2,505,996.00	0.12
143	300401	花园生物	143,000	2,479,620.00	0.12
144	002415	海康威视	68,445	2,477,709.00	0.12
145	002585	双星新材	136,100	2,462,049.00	0.12
146	300316	晶盛机电	35,694	2,412,557.46	0.12
147	688016	心脉医疗	12,359	2,407,656.79	0.12
148	000736	中交地产	151,200	2,405,592.00	0.12
149	000408	藏格矿业	71,400	2,351,916.00	0.12
150	600803	新奥股份	120,400	2,238,236.00	0.11
151	601666	平煤股份	161,800	2,198,862.00	0.11
152	603501	韦尔股份	12,603	2,180,697.09	0.11
153	688233	神工股份	38,260	2,150,212.00	0.11
154	603538	美诺华	67,300	2,143,505.00	0.11
155	600406	国电南瑞	77,753	2,099,331.00	0.10
156	002493	荣盛石化	136,200	2,096,118.00	0.10
157	605123	派克新材	14,300	2,012,296.00	0.10
158	601088	中国神华	59,900	1,994,670.00	0.10
159	002867	周大生	128,334	1,993,027.02	0.10
160	300037	新宙邦	37,880	1,990,972.80	0.10
161	002920	德赛西威	13,200	1,953,600.00	0.10
162	601985	中国核电	283,200	1,942,752.00	0.10
163	300896	爱美客	3,200	1,920,032.00	0.10
164	002541	鸿路钢构	56,940	1,901,796.00	0.09
165	002497	雅化集团	58,100	1,896,965.00	0.09
166	300850	新强联	20,902	1,860,905.06	0.09
167	600276	恒瑞医药	48,321	1,792,225.89	0.09
168	603369	今世缘	34,998	1,784,898.00	0.09
169	300196	长海股份	94,300	1,781,327.00	0.09
170	688179	阿拉丁	34,704	1,778,232.96	0.09
171	600893	航发动力	39,009	1,775,299.59	0.09
172	002179	中航光电	27,906	1,767,007.92	0.09
173	603833	欧派家居	11,401	1,717,902.68	0.09
174	002484	江海股份	72,500	1,692,150.00	0.08
175	300390	天华超净	19,100	1,669,340.00	0.08
176	002881	美格智能	51,310	1,644,998.60	0.08
177	002643	万润股份	78,800	1,643,768.00	0.08
178	601225	陕西煤业	77,073	1,632,406.14	0.08

179	603882	金域医学	19,000	1,568,450.00	0.08
180	300223	北京君正	14,200	1,508,750.00	0.07
181	300482	万孚生物	36,700	1,494,057.00	0.07
182	002897	意华股份	33,800	1,490,580.00	0.07
183	601615	明阳智能	43,900	1,483,820.00	0.07
184	000625	长安汽车	85,490	1,480,686.80	0.07
185	300568	星源材质	50,400	1,463,616.00	0.07
186	300820	英杰电气	22,600	1,458,830.00	0.07
187	688556	高测股份	17,598	1,420,158.60	0.07
188	688065	凯赛生物	12,600	1,408,680.00	0.07
189	688037	芯源微	9,700	1,406,209.00	0.07
190	000552	靖远煤电	325,800	1,404,198.00	0.07
191	605111	新洁能	11,140	1,401,523.40	0.07
192	002180	纳思达	26,800	1,356,616.00	0.07
193	002326	永太科技	40,500	1,333,665.00	0.07
194	300861	美畅股份	14,100	1,306,929.00	0.06
195	600366	宁波韵升	102,800	1,295,280.00	0.06
196	002532	天山铝业	197,200	1,287,716.00	0.06
197	688005	容百科技	9,936	1,286,115.84	0.06
198	600765	中航重机	39,900	1,283,982.00	0.06
199	300604	长川科技	28,300	1,277,745.00	0.06
200	002240	盛新锂能	21,100	1,273,596.00	0.06
201	601339	百隆东方	247,600	1,257,808.00	0.06
202	600487	亨通光电	85,502	1,243,199.08	0.06
203	688390	固德威	3,929	1,229,816.29	0.06
204	300777	中简科技	25,400	1,224,280.00	0.06
205	688349	三一重能	32,650	1,206,091.00	0.06
206	603338	浙江鼎力	22,900	1,161,030.00	0.06
207	603297	永新光学	10,300	1,150,613.00	0.06
208	300073	当升科技	12,500	1,129,250.00	0.06
209	688536	思瑞浦	2,000	1,123,180.00	0.06
210	605358	立昂微	16,608	1,119,047.04	0.06
211	603876	鼎胜新材	23,600	1,066,720.00	0.05
212	300138	晨光生物	67,900	1,057,203.00	0.05
213	002080	中材科技	38,400	1,056,000.00	0.05
214	000519	中兵红箭	35,900	1,046,485.00	0.05
215	600938	中国海油	59,600	1,040,020.00	0.05
216	300803	指南针	17,600	1,034,528.00	0.05
217	603067	振华股份	82,200	1,029,966.00	0.05
218	300775	三角防务	21,100	1,015,965.00	0.05
219	002507	涪陵榨菜	29,082	1,003,910.64	0.05
220	300748	金力永磁	26,600	978,880.00	0.05
221	300755	华致酒行	22,200	973,470.00	0.05
222	600582	天地科技	203,300	971,774.00	0.05

223	600905	三峡能源	151,700	954,193.00	0.05
224	000877	天山股份	74,500	916,350.00	0.05
225	603713	密尔克卫	6,700	915,890.00	0.05
226	600481	双良节能	54,100	911,585.00	0.05
227	603568	伟明环保	26,800	894,316.00	0.04
228	601128	常熟银行	113,500	867,140.00	0.04
229	002258	利尔化学	34,700	819,614.00	0.04
230	002906	华阳集团	17,900	811,049.00	0.04
231	600328	中盐化工	34,400	810,120.00	0.04
232	000887	中鼎股份	44,400	809,856.00	0.04
233	300171	东富龙	23,400	793,494.00	0.04
234	688066	航天宏图	10,027	790,127.60	0.04
235	600389	江山股份	12,600	765,198.00	0.04
236	688518	联赢激光	22,176	753,762.24	0.04
237	601318	中国平安	16,100	751,709.00	0.04
238	300759	康龙化成	7,500	714,150.00	0.04
239	601898	中煤能源	66,900	694,422.00	0.03
240	600529	山东药玻	24,300	679,185.00	0.03
241	688303	大全能源	9,852	673,088.64	0.03
242	300638	广和通	25,350	671,521.50	0.03
243	603688	石英股份	4,900	649,789.00	0.03
244	600873	梅花生物	57,200	645,216.00	0.03
245	688356	键凯科技	2,666	644,665.46	0.03
246	000090	天健集团	93,500	644,215.00	0.03
247	000762	西藏矿业	11,500	643,195.00	0.03
248	300911	亿田智能	8,300	637,855.00	0.03
249	000498	山东路桥	65,200	629,832.00	0.03
250	600845	宝信软件	11,500	627,900.00	0.03
251	002003	伟星股份	65,880	625,860.00	0.03
252	600702	舍得酒业	2,900	591,571.00	0.03
253	600782	新钢股份	117,200	590,688.00	0.03
254	603077	和邦生物	137,300	584,898.00	0.03
255	688521	芯原股份	11,723	579,116.20	0.03
256	300776	帝尔激光	3,320	573,696.00	0.03
257	601390	中国中铁	92,800	569,792.00	0.03
258	688099	晶晨股份	5,608	566,408.00	0.03
259	300357	我武生物	10,800	561,924.00	0.03
260	600325	华发股份	69,700	527,629.00	0.03
261	603260	合盛硅业	4,400	519,024.00	0.03
262	000683	远兴能源	48,000	504,480.00	0.02
263	601717	郑煤机	34,800	501,468.00	0.02
264	688122	西部超导	5,405	498,341.00	0.02
265	000810	创维数字	30,100	487,921.00	0.02
266	002430	杭氧股份	15,500	484,530.00	0.02

267	002790	瑞尔特	60,700	475,281.00	0.02
268	000001	平安银行	31,500	471,870.00	0.02
269	002128	电投能源	31,700	453,944.00	0.02
270	688558	国盛智科	12,800	440,192.00	0.02
271	601857	中国石油	82,100	435,130.00	0.02
272	600188	兖矿能源	11,000	434,280.00	0.02
273	002013	中航机电	34,400	424,840.00	0.02
274	601456	国联证券	34,400	422,088.00	0.02
275	300662	科锐国际	8,100	420,309.00	0.02
276	601137	博威合金	23,200	410,640.00	0.02
277	605366	宏柏新材	13,600	405,144.00	0.02
278	002353	杰瑞股份	9,900	398,970.00	0.02
279	603707	健友股份	14,000	394,800.00	0.02
280	603444	吉比特	1,000	388,000.00	0.02
281	002299	圣农发展	20,000	383,600.00	0.02
282	002985	北摩高科	6,500	380,770.00	0.02
283	003022	联泓新科	11,300	375,499.00	0.02
284	600885	宏发股份	8,960	374,976.00	0.02
285	300696	爱乐达	8,420	370,059.00	0.02
286	300130	新国都	29,700	364,122.00	0.02
287	603596	伯特利	4,500	360,810.00	0.02
288	688121	卓然股份	13,970	339,610.70	0.02
289	600096	云天化	9,800	308,504.00	0.02
290	002597	金禾实业	7,000	303,310.00	0.02
291	688167	炬光科技	2,014	299,582.50	0.01
292	688029	南微医学	3,391	295,695.20	0.01
293	002705	新宝股份	13,300	292,467.00	0.01
294	300747	锐科激光	7,500	291,750.00	0.01
294	601021	春秋航空	5,000	291,750.00	0.01
296	605080	浙江自然	4,500	287,505.00	0.01
297	601601	中国太保	12,200	287,066.00	0.01
298	300628	亿联网络	3,700	281,755.00	0.01
299	603993	洛阳钼业	47,400	271,602.00	0.01
300	002027	分众传媒	40,024	269,361.52	0.01
301	603345	安井食品	1,600	268,592.00	0.01
302	002444	巨星科技	14,100	265,644.00	0.01
303	688598	金博股份	896	264,051.20	0.01
304	002557	洽洽食品	4,527	257,722.11	0.01
305	603236	移远通信	1,920	256,627.20	0.01
306	688201	信安世纪	7,578	252,044.28	0.01
307	002801	微光股份	8,300	247,755.00	0.01
308	688050	爱博医疗	1,100	246,620.00	0.01
309	600057	厦门象屿	28,013	246,234.27	0.01
310	688123	聚辰股份	2,304	245,422.08	0.01

311	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.01
312	300832	新产业	5,000	225,550.00	0.01
313	002850	科达利	1,400	222,600.00	0.01
314	300761	立华股份	5,500	218,625.00	0.01
315	002841	视源股份	2,800	210,896.00	0.01
316	600298	安琪酵母	4,300	209,625.00	0.01
317	300699	光威复材	3,400	200,158.00	0.01
318	300244	迪安诊断	6,000	186,600.00	0.01
319	600021	上海电力	18,000	184,500.00	0.01
320	600258	首旅酒店	7,300	181,040.00	0.01
321	600399	抚顺特钢	10,000	179,000.00	0.01
322	603026	石大胜华	1,200	174,420.00	0.01
323	300118	东方日升	5,900	173,047.00	0.01
324	002878	元隆雅图	8,800	169,840.00	0.01
325	002661	克明食品	14,300	162,591.00	0.01
326	600415	小商品城	29,100	162,087.00	0.01
327	600674	川投能源	13,400	159,728.00	0.01
328	600350	山东高速	30,400	159,600.00	0.01
329	601872	招商轮船	27,700	159,552.00	0.01
330	600971	恒源煤电	20,100	158,790.00	0.01
331	301298	东利机械	6,340	158,423.92	0.01
332	600998	九州通	13,300	158,403.00	0.01
333	300636	同和药业	6,600	158,400.00	0.01
334	300285	国瓷材料	4,400	158,048.00	0.01
335	601618	中国中冶	45,100	157,850.00	0.01
336	300872	天阳科技	11,800	157,294.00	0.01
337	600163	中闽能源	18,600	157,170.00	0.01
338	300599	雄塑科技	18,400	156,584.00	0.01
339	600461	洪城环境	19,300	156,137.00	0.01
340	002648	卫星化学	6,000	155,100.00	0.01
341	000728	国元证券	24,800	154,256.00	0.01
342	688012	中微公司	1,300	151,775.00	0.01
343	600480	凌云股份	16,600	147,574.00	0.01
344	002797	第一创业	22,400	143,584.00	0.01
345	002216	三全食品	7,280	142,615.20	0.01
346	600123	兰花科创	8,600	141,470.00	0.01
347	002993	奥海科技	3,400	141,304.00	0.01
348	600559	老白干酒	4,900	140,581.00	0.01
349	600507	方大特钢	20,015	139,904.85	0.01
350	300573	兴齐眼药	900	137,988.00	0.01
351	000630	铜陵有色	40,200	131,052.00	0.01
352	688196	卓越新能	1,700	130,900.00	0.01
353	000567	海德股份	8,700	128,760.00	0.01
354	603348	文灿股份	2,400	128,640.00	0.01

355	300607	拓斯达	9,700	128,234.00	0.01
356	603599	广信股份	4,480	126,112.00	0.01
357	688251	井松智能	3,392	124,350.72	0.01
358	601958	金铂股份	14,000	123,760.00	0.01
359	688389	普门科技	7,000	122,430.00	0.01
360	603906	龙蟠科技	3,300	121,902.00	0.01
361	600641	万业企业	6,100	118,950.00	0.01
362	300447	全信股份	5,800	118,146.00	0.01
363	002294	信立泰	4,200	118,020.00	0.01
364	000739	普洛药业	5,670	117,028.80	0.01
365	002042	华孚时尚	30,800	116,424.00	0.01
366	002815	崇达技术	8,900	114,009.00	0.01
367	001965	招商公路	14,700	112,161.00	0.01
368	003019	宸展光电	4,370	110,298.80	0.01
369	600273	嘉化能源	10,000	108,600.00	0.01
370	000915	华特达因	2,600	107,510.00	0.01
371	601992	金隅集团	38,700	107,199.00	0.01
372	300308	中际旭创	3,400	105,570.00	0.01
373	300596	利安隆	2,300	101,453.00	0.01
374	300639	凯普生物	4,600	98,348.00	0.00
375	002286	保龄宝	8,500	97,325.00	0.00
376	002372	伟星新材	4,000	96,160.00	0.00
377	300121	阳谷华泰	8,300	89,059.00	0.00
378	300712	永福股份	1,500	86,010.00	0.00
379	000719	中原传媒	10,900	81,205.00	0.00
380	600141	兴发集团	1,600	70,384.00	0.00
381	688188	柏楚电子	313	68,872.52	0.00
382	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
383	301217	铜冠铜箔	4,284	63,531.72	0.00
384	601995	中金公司	1,400	62,286.00	0.00
385	603378	亚士创能	5,148	60,025.68	0.00
386	605117	德业股份	200	55,978.00	0.00
387	600588	用友网络	2,463	53,471.73	0.00
388	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
389	000960	锡业股份	2,700	45,279.00	0.00
390	300474	景嘉微	600	41,034.00	0.00
391	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
392	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
393	002043	兔宝宝	2,700	31,320.00	0.00
394	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
395	688006	杭可科技	412	28,864.72	0.00
396	300054	鼎龙股份	1,200	25,404.00	0.00
397	000661	长春高新	107	24,975.94	0.00
398	000703	恒逸石化	2,300	24,173.00	0.00

399	603112	华翔股份	1,600	23,856.00	0.00
400	603960	克来机电	1,131	23,242.05	0.00
401	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
402	300782	卓胜微	160	21,600.00	0.00
403	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
404	002709	天赐材料	340	21,100.40	0.00
405	002233	塔牌集团	2,300	20,355.00	0.00
406	688357	建龙微纳	173	19,452.12	0.00
407	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
408	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
409	600882	妙可蓝多	400	18,720.00	0.00
410	000799	酒鬼酒	100	18,581.00	0.00
411	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
412	603583	捷昌驱动	552	18,431.28	0.00
413	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
414	002223	鱼跃医疗	700	17,962.00	0.00
415	600535	天士力	1,700	17,867.00	0.00
416	688089	嘉必优	543	17,783.25	0.00
417	600703	三安光电	721	17,722.18	0.00
418	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
419	603613	国联股份	191	16,922.60	0.00
420	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
421	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
422	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
423	688368	晶丰明源	90	14,387.40	0.00
424	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
425	603606	东方电缆	182	13,941.20	0.00
426	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
427	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
428	002139	拓邦股份	1,000	12,270.00	0.00
429	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
430	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
431	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
432	688139	海尔生物	153	11,142.99	0.00
433	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
434	300454	深信服	103	10,689.34	0.00
435	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
436	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
437	300226	上海钢联	420	9,513.00	0.00
438	300188	美亚柏科	700	9,436.00	0.00
439	002556	辉隆股份	800	9,360.00	0.00
440	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
441	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
442	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00

443	300969	恒帅股份	100	8,466.00	0.00
444	600446	金证股份	800	8,304.00	0.00
445	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
446	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
447	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
448	600131	国网信通	500	6,725.00	0.00
449	002236	大华股份	400	6,568.00	0.00
450	300232	洲明科技	800	5,216.00	0.00
451	300529	健帆生物	99	5,038.11	0.00
452	688396	华润微	84	4,961.88	0.00
453	002968	新大正	195	4,808.70	0.00
454	002396	星网锐捷	200	4,528.00	0.00
455	300598	诚迈科技	100	4,129.00	0.00
456	600570	恒生电子	90	3,918.60	0.00
457	000513	丽珠集团	102	3,693.42	0.00
458	603678	火炬电子	74	3,463.94	0.00
459	603368	柳药集团	197	3,392.34	0.00
460	600521	华海药业	142	3,223.40	0.00
461	601966	玲珑轮胎	121	3,069.77	0.00
462	603233	大参林	97	3,036.10	0.00
463	002262	恩华药业	200	2,720.00	0.00
464	002568	百润股份	81	2,433.24	0.00
465	300525	博思软件	100	2,145.00	0.00
466	002624	完美世界	140	2,011.80	0.00
467	002636	金安国纪	200	1,806.00	0.00
468	002572	索菲亚	61	1,677.50	0.00
469	600377	宁沪高速	183	1,568.31	0.00
470	000807	云铝股份	138	1,363.44	0.00
471	002511	中顺洁柔	101	1,264.52	0.00
472	600720	祁连山	89	1,103.60	0.00
473	688526	科前生物	38	987.62	0.00
474	000050	深天马 A	95	947.15	0.00
475	002839	张家港行	140	740.60	0.00
476	688388	嘉元科技	8	678.96	0.00
477	000656	金科股份	221	632.06	0.00
478	002602	世纪华通	120	578.40	0.00
479	000961	中南建设	70	213.50	0.00
480	600219	南山铝业	31	114.39	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	77,865,120.19	1.62
2	601688	华泰证券	66,341,872.00	1.38
3	601211	国泰君安	64,289,037.14	1.33
4	600030	中信证券	62,745,732.65	1.30
5	601668	中国建筑	48,114,704.50	1.00
6	300122	智飞生物	40,125,590.08	0.83
7	000858	五 粮 液	39,975,450.00	0.83
8	300274	阳光电源	35,802,422.00	0.74
9	601398	工商银行	33,768,744.00	0.70
10	002714	牧原股份	31,455,583.98	0.65
11	002371	北方华创	31,012,834.00	0.64
12	300760	迈瑞医疗	30,876,310.00	0.64
13	600019	宝钢股份	30,774,324.60	0.64
14	600958	东方证券	30,264,112.48	0.63
15	000001	平安银行	29,486,758.26	0.61
16	000568	泸州老窖	29,230,302.19	0.61
17	300014	亿纬锂能	28,727,860.76	0.60
18	601658	邮储银行	28,193,056.00	0.59
19	601155	新城控股	25,830,292.00	0.54
20	002271	东方雨虹	25,586,077.60	0.53

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	300059	东方财富	105,535,753.09	2.19
2	000858	五 粮 液	86,618,828.37	1.80
3	300750	宁德时代	75,100,507.96	1.56
4	600036	招商银行	74,474,423.41	1.55
5	601688	华泰证券	70,315,478.90	1.46
6	603259	药明康德	69,818,068.26	1.45
7	600030	中信证券	64,052,491.05	1.33
8	000568	泸州老窖	62,174,743.00	1.29
9	002594	比亚迪	58,981,277.30	1.22
10	300014	亿纬锂能	57,862,731.57	1.20
11	600519	贵州茅台	56,635,362.98	1.18
12	002142	宁波银行	55,796,623.18	1.16
13	601166	兴业银行	52,401,468.57	1.09

14	601211	国泰君安	50,326,676.68	1.04
15	300760	迈瑞医疗	48,211,477.00	1.00
16	600438	通威股份	46,698,062.00	0.97
17	300274	阳光电源	43,446,445.00	0.90
18	600958	东方证券	42,000,401.56	0.87
19	601668	中国建筑	40,587,021.00	0.84
20	300122	智飞生物	40,527,373.23	0.84

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	4,049,664,780.89
卖出股票的收入（成交）总额	5,703,426,868.63

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	123,059,376.24	6.09
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）	890,035.40	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	123,949,411.64	6.13

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	019658	21 国债 10	1,207,590	123,059,376.24	6.09
2	132022	20 广版 EB	7,670	801,619.23	0.04
3	113633	科沃转债	380	45,113.62	0.00
4	113641	华友转债	290	39,064.64	0.00
5	118004	博瑞转债	20	2,396.32	0.00

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 1,352,039,745.92 元,占基金资产净值的比例为 66.90%;运用股指期货进行对冲的空头合约市值-1,169,832,600.00 元,占基金资产净值的比例为-57.88%,空头合约市值占股票资产的比例为-86.52%。

本报告期内,本基金执行市场中性策略的投资收益为-90,732,129.24 元,公允价值变动损益为 12,971,673.95 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

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	145,497,824.14
2	应收清算款	27,507,336.05
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	202,410.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	173,207,570.74

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	132022	20 广版 EB	801,619.23	0.04
2	113633	科沃转债	45,113.62	0.00
3	127045	牧原转债	1,161.00	0.00

4	123117	健帆转债	561.59	0.00
---	--------	------	--------	------

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
海富通阿尔法对冲混合 A	163,404	10,111.41	1,206,767,615.28	73.04%	445,476,891.86	26.96%
海富通阿尔法对冲混合 C	5,749	15,030.45	55,513,618.86	64.24%	30,896,463.36	35.76%
合计	169,153	10,278.59	1,262,281,234.14	72.60%	476,373,355.22	27.40%

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	1,535,976.86	0.0930%
	海富通阿尔法对冲混合 C	176,132.02	0.2038%
	合计	1,712,108.88	0.0985%

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	3,980,959,175.68	99,465,186.92
本报告期基金总申购份额	291,866,861.63	186,882,803.04
减：本报告期基金总赎回份额	2,620,581,530.17	199,937,907.74
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,652,244,507.14	86,410,082.22

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	1	1,726,531,848.58	17.73%	917,302.05	15.10%	-
华创证券	1	1,570,863,051.93	16.13%	649,783.14	10.70%	-
海通证券	2	1,304,517,518.53	13.40%	948,700.65	15.62%	-
国泰君安	2	983,702,659.82	10.10%	702,344.52	11.56%	-
华西证券	1	726,160,152.44	7.46%	531,042.22	8.74%	-
天风证券	2	568,463,033.34	5.84%	410,574.67	6.76%	-
开源证券	2	556,800,500.29	5.72%	400,733.09	6.60%	-
国盛证券	2	520,490,458.98	5.35%	380,217.44	6.26%	-
中信证券	2	418,030,948.93	4.29%	305,707.32	5.03%	-
长江证券	1	327,524,769.17	3.36%	200,401.28	3.30%	-
招商证券	2	315,542,208.24	3.24%	227,132.10	3.74%	-
中信建投	2	272,158,341.34	2.79%	171,813.96	2.83%	-
申万宏源	2	229,553,582.47	2.36%	94,416.67	1.55%	-
野村东方国际证券	1	109,748,363.01	1.13%	78,327.23	1.29%	-
银河证券	1	105,383,866.53	1.08%	53,968.49	0.89%	-
中金公司	2	2,207,837.00	0.02%	1,570.47	0.03%	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	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
国金证券	85,283,524.50	78.48%	270,000,000.00	30.72%	-	-
华创证券	221,224.48	0.20%	-	-	-	-
海通证券	-	-	190,000,000.00	21.62%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华西证券	194,894.70	0.18%	199,000,000.00	22.64%	-	-
天风证券	627,320.30	0.58%	50,000,000.00	5.69%	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	19,990,000.00	18.40%	40,000,000.00	4.55%	-	-
中信证券	1,389,343.70	1.28%	100,000,000.00	11.38%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	30,000,000.00	3.41%	-	-
中信建投	957,278.90	0.88%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
野村东方国际 证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

太平洋证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	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	2022-01-04
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万联证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	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	2022-01-06
3	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	2022-01-07
4	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	2022-01-07
5	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-25
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方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	2022-02-14
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中邮证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	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	2022-04-01
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增英大证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	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	2022-05-10
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增财信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	2022-05-24
10	海富通基金管理有限公司关于终止与北京植信基金销售有限公司销售合作关系的公告	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	2022-05-30
11	海富通基金管理有限公司关于调整公募基金产品适当性风险等级划分方法的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2022-06-16

	电子披露网站	
--	--------	--

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022/1/1-2022/2/14,2022/4/19-2022/6/30	841,451,618.59	-	366,672,000.00	474,779,618.59	27.31%

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：

- 1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；
- 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。
- 3、基金合同生效满三年后继续存续的，若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，本基金可能会面临终止基金合同的情形。
- 4、其他可能的风险。

另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

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 2022 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1473 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。

2019 年 3 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金再度被权威媒体《证券时报》授予第十四届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金和 2018 年度绝对收益明星基

金。2019 年 4 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威财经媒体《中国证券报》和《上海证券报》分别评选为第十六届中国基金业金牛奖——三年期开放式混合型持续优胜金牛基金和第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金•灵活配置型基金奖（三年期）。同时，海富通基金管理有限公司荣获《上海证券报》第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金•成长基金管理公司奖。

2020 年 3 月，由《中国证券报》主办的第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金牛进取奖”，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖项。2020 年 7 月，由《上海证券报》主办的第十七届金基金奖名单揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金基金•股票投资回报基金管理公司奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金•偏股混合型基金三年期奖”。

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”。

§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

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

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇二二年八月三十一日