

海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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：二〇二四年八月三十日

§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 2024 年 8 月 29 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 2024 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 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 市场中性策略执行情况	53
7.13 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	55
9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§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	317,855,539.85 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	298,285,735.35 份	19,569,804.50 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（2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-1,016,846.64	-179,958.81
本期利润	3,301,028.41	256,710.80
加权平均基金份额本期利润	0.0097	0.0132
本期加权平均净值利润率	0.91%	1.26%
本期基金份额净值增长率	1.45%	1.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 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	25,563,429.76	1,307,047.00
期末可供分配基金份额利润	0.0857	0.0668
期末基金资产净值	323,849,165.11	20,876,851.50

期末基金份额净值	1.0857	1.0668
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 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	50.29%	-4.75%

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	1.13%	0.29%	0.22%	0.01%	0.91%	0.28%
过去三个月	1.03%	0.32%	0.68%	0.01%	0.35%	0.31%
过去六个月	1.45%	0.48%	1.36%	0.01%	0.09%	0.47%
过去一年	-0.74%	0.36%	2.76%	0.01%	-3.50%	0.35%
过去三年	-7.44%	0.35%	8.49%	0.01%	-15.93%	0.34%
自基金合同生效起至今	50.29%	0.34%	30.78%	0.01%	19.51%	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	1.09%	0.29%	0.22%	0.01%	0.87%	0.28%
过去三个月	0.94%	0.33%	0.68%	0.01%	0.26%	0.32%
过去六个月	1.25%	0.48%	1.36%	0.01%	-0.11%	0.47%
过去一年	-1.14%	0.36%	2.76%	0.01%	-3.90%	0.35%
过去三年	-8.51%	0.35%	8.49%	0.01%	-17.00%	0.34%
自基金合同生效起至今	-4.75%	0.36%	12.80%	0.01%	-17.55%	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 2024 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 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 97 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、海富通稳固收益债券型证券投资基金、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、海富通盈丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金、海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金、海富通产业优选混合型证券投资基金、海富通瑞鑫 30 天持有期债券型证券投资基金、海富通优势驱动混合型证券投资基金、海富通 ESG 领先股票型证券投资基金、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金、海富通红利优选混合型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通数字经济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		
李自悟	本基金的基金经理；量化投	2023-04-10	-	16 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

	资部副总监。				<p>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。2024 年 3 月起兼任海富通中证 2000 增强策略 ETF 基金经理。</p>
杜晓海	本基金的基金经理；公司总经理助理。	2018-04-09	-	24 年	<p>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、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</p>

					<p>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。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 月起兼任海富通 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。</p>
--	--	--	--	--	---

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

国内方面，2024 年上半年国内经济整体维持弱修复状态，实现了实际 GDP 增速 5%，基本完成了目标。从经济运行节奏看，第一季度开局良好，进入第二季度，社融和 M1 增速开始回落，经济增速边际放缓，实际 GDP 同比增长 4.7%。从经济增长动力上看，海外经济向好，国内生产和出口保持强势，有力提振经济增长，而国内地产未显著回暖，居民和企业融资意愿不足，内需消费疲弱，全社会风险偏好较低。从政策思路看，目前国内政策主要集中在供给侧，坚持高质量发展，因地制宜发展新质生产力，这也是我国跨越中等收入陷阱的必由之路。

海外方面，2024 年上半年美国经济在高利率和紧财政下开始走弱，但是经济仍有韧性，降息预期不断延后。6 月美国失业率走高，叠加 CPI 同比也回落，CME 利率期货显示预计美联储 9 月将启动降息。但是，失业率上升更多是源于新增劳动力进入市场，非农就业数据依然超预期，且实际薪资增速依然保持较高增长，最新零售数据也超预期，美国消费依然具有韧性。

从 A 股市场看，本报告期内，价值板块跑赢成长板块，大盘股跑赢小盘。在避险情绪和红利表现强势的背景下，银行、公用事业、煤炭、石化、交运总体上涨。受益于科技创新和出口等原因，电子、通信、家电表现相对靠前。医药、地产链、消费板块由于基本面不佳，整体延续下跌趋势；TMT 板块亦大幅回调。在宏观经济缓慢复苏、市场风格偏向红利价值的前提下，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，同时在因子配置上尽可能兼顾估值与成长。

因子方面，上半年基本面类因子表现较好，包括估值、成长、盈利质量、分析师预期等。反转类因子表现较差，大市值显著占优，对量价模型的表现有负面影响。

组合风格上相对均衡，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。本基金在量化策略上坚持多策略并行，在风险模型上用 Barra 模型控制组合风格暴露，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 1.45%，同期业绩比较基准收益率为 1.36%。海富通阿尔法对冲混合 C 净值增长率为 1.25%，同期业绩比较基准收益率为 1.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从全球经济看，由于美国财政高杠杆、货币高利率的制约，2024 年美国财政刺激力度将边际走弱，美国经济、通胀也将逐步下行。6 月 18 日美国 CBO 在最新财政和经济展望中上调了 2024 年财年预算赤字，受到边际趋松的财政提振，通胀或存在抬升的压力。7 月就业数据超预期走弱，市场降息预期升温，但受飓风等因素影响 7 月就业数据有一定特殊性，未来美联储降息节奏和幅度还需要进一步跟踪。一旦美联储启动降息，这对全球金融市场、各类资产都将产生较为显著的影响，我们面临的外部金融环境有望缓解。

中国经济暂时仍面临着总需求不足、结构调整阵痛的冲击，在这过程中市场信心较为脆弱和不足。目前政策的重心仍主要在供给端，短期而言，在破立并举、先立后破的政策基调下，若未来内需进一步下滑，不排除阶段性向需求端倾斜的可能，这需要进一步跟踪。此外，监管层也在积极呵护市场，下行空间可能有限，这时候更重要的是行业配置。

投资策略上，我们将坚持多策略并行，一方面通过基本面策略跟踪公司的业绩，挖掘估值与成长相匹配、具备投资价值的好公司，另一方面通过深度学习策略在低关注股票中获取超额，力争在风险可控的基础上跑赢市场。另外，本基金也将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。市场风格方面，从增量资金偏好、估值等角度看，小微盘风格的暴露需要谨慎对待。

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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	21,494,796.21	14,616,544.11
结算备付金		55,274,095.51	54,476,240.05
存出保证金		25,563,973.53	27,472,015.32
交易性金融资产	6.4.7.2	245,710,524.16	259,188,849.68
其中：股票投资		234,950,615.29	246,547,929.57
基金投资		-	-
债券投资		10,759,908.87	12,640,920.11
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	-	-
应收清算款		2,415,254.78	1,989,044.64
应收股利		-	-
应收申购款		23,483.95	59,016.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		350,482,128.14	357,801,710.03
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		240,887.92	3,442,481.91
应付赎回款		3,946,896.78	548,370.59
应付管理人报酬		341,241.93	373,982.79
应付托管费		56,873.64	62,330.49
应付销售服务费		6,791.87	7,336.64
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.59	65,658.26
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,163,418.80	1,253,072.06
负债合计		5,756,111.53	5,753,232.74
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	317,855,539.85	329,284,648.08
未分配利润	6.4.7.8	26,870,476.76	22,763,829.21
净资产合计		344,726,016.61	352,048,477.29
负债和净资产总计		350,482,128.14	357,801,710.03

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0857 元，C 类基金份额净值 1.0668 元。

基金份额总额 317,855,539.85 份，其中 A 类基金份额 298,285,735.35 份，C 类基金份额 19,569,804.50 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		6,515,625.62	7,579,965.77
1.利息收入		428,948.68	801,382.93
其中：存款利息收入	6.4.7.9	417,186.49	793,590.66
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		11,762.19	7,792.27
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		995,429.10	-17,137,834.90
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-19,677,894.05	-2,604,511.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	60,649.96	328,490.32
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	16,768,452.10	-18,127,855.56
股利收益	6.4.7.14	3,844,221.09	3,266,042.28
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	4,754,544.66	23,653,771.18
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	336,703.18	262,646.56
减：二、营业总支出		2,957,886.41	5,207,789.72
1. 管理人报酬		2,300,003.01	4,297,872.27
2. 托管费		383,333.80	716,312.05
3. 销售服务费		40,582.05	73,103.43
4. 投资顾问费		-	-

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		119,577.14	29.10
8. 其他费用	6.4.7.17	114,390.41	120,472.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,557,739.21	2,372,176.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,557,739.21	2,372,176.05
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,557,739.21	2,372,176.05

6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	329,284,648.08	-	22,763,829.21	352,048,477.29
二、本期期初净资产	329,284,648.08	-	22,763,829.21	352,048,477.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-11,429,108.23	-	4,106,647.55	-7,322,460.68
（一）、综合收益总额	-	-	3,557,739.21	3,557,739.21
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-11,429,108.23	-	548,908.34	-10,880,199.89
其中：1.基金申购款	106,937,013.02	-	8,665,959.34	115,602,972.36
2.基金赎回款	-118,366,121.25	-	-8,117,051.00	-126,483,172.25
（三）、本期向基金份额持有人分	-	-	-	-

配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
四、本期期末净资产	317,855,539.85	-	26,870,476.76	344,726,016.61
项目	上年度可比期间 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	794,462,315.09	-	72,265,049.42	866,727,364.51
二、本期期初净资产	794,462,315.09	-	72,265,049.42	866,727,364.51
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净资产变动数（净资产减少以“-”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净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	406,031,530.62	-	37,669,250.94	443,700,781.56

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 2024 年 8 月 29 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

本基金财务报表符合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》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 2024 年 6 月 30 日的财务状况、2024 上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	21,494,796.21
等于：本金	21,492,937.77
加：应计利息	1,858.44
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	21,494,796.21

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	237,458,470.13	-	234,950,615.29	-2,507,854.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	160,733.67	10,759,908.87	31,841.99
	银行间市场	-	-	-
	合计	160,733.67	10,759,908.87	31,841.99
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	248,025,803.34	160,733.67	245,710,524.16	-2,476,012.85

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 2024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	-210,993,254.66	-	-	-
——股指期货	-210,993,254.66	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-210,993,254.66	-	-	-

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
IF2409	IF2409	-48.00	-49,299,840.00	1,206,240.00
IM2409	IM2409	-65.00	-62,142,600.00	3,851,380.44
IM2412	IM2412	-10.00	-9,378,000.00	1,299,400.00
IF2412	IF2412	-25.00	-25,665,000.00	523,860.00
IC2409	IC2409	-45.00	-43,876,800.00	3,065,654.22

IC2412	IC2412	-10.00	-9,667,600.00	1,016,880.00
合计	-	-	-	10,963,414.66
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	10,963,414.66
净额	-	-	-	-

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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,188.46
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,070,694.98
其中：交易所市场	1,070,694.98
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,535.36
合计	1,163,418.80

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 2024年1月1日至2024年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	308,964,612.04	308,964,612.04
本期申购	104,758,907.48	104,758,907.48
本期赎回（以“-”号填列）	-115,437,784.17	-115,437,784.17
本期末	298,285,735.35	298,285,735.35

海富通阿尔法对冲混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	20,320,036.04	20,320,036.04
本期申购	2,178,105.54	2,178,105.54
本期赎回（以“-”号填列）	-2,928,337.08	-2,928,337.08
本期末	19,569,804.50	19,569,804.50

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	33,535,976.52	-11,861,177.55	21,674,798.97
本期期初	33,535,976.52	-11,861,177.55	21,674,798.97
本期利润	-1,016,846.64	4,317,875.05	3,301,028.41
本期基金份额交易产生的变动数	-2,474,568.34	3,062,170.72	587,602.38
其中：基金申购款	11,300,575.84	-2,759,193.87	8,541,381.97
基金赎回款	-13,775,144.18	5,821,364.59	-7,953,779.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,044,561.54	-4,481,131.78	25,563,429.76

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	1,851,482.27	-762,452.03	1,089,030.24

本期期初	1,851,482.27	-762,452.03	1,089,030.24
本期利润	-179,958.81	436,669.61	256,710.80
本期基金份额交易产生的变动数	-79,278.67	40,584.63	-38,694.04
其中：基金申购款	205,565.83	-80,988.46	124,577.37
基金赎回款	-284,844.50	121,573.09	-163,271.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,592,244.79	-285,197.79	1,307,047.00

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	52,426.76
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	362,080.11
其他	2,679.62
合计	417,186.49

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	2,286,676,118.52
减：卖出股票成本总额	2,301,770,345.11
减：交易费用	4,583,667.46
买卖股票差价收入	-19,677,894.05

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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	92,224.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-31,574.98
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	60,649.96

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	14,141,794.04
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	13,912,830.51
减：应计利息总额	260,451.42
减：交易费用	87.09
买卖债券差价收入	-31,574.98

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益（税前）	17,837,780.33
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	996,122.74
减：交易费用	73,205.49
合计	16,768,452.10

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,844,221.09
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	3,844,221.09

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-1,289,635.01
——股票投资	-1,337,079.61
——债券投资	47,444.60
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	6,044,179.67
——权证投资	-
——股指期货	6,044,179.67
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	4,754,544.66

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	288,561.78
基金转换费收入	48,141.40
合计	336,703.18

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	11,255.05
其他费用	600.00
债券托管账户维护费	18,000.00
合计	114,390.41

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	43,608,717.83	0.95%	-	-

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 2024年1月1日至2024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	32,285.97	1.03%	32,285.97	3.02%
关联方名称	上年度可比期间 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	-	-	-	-

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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,300,003.01	4,297,872.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	886,038.48	1,473,052.64
应支付基金管理人的净管理费	1,413,964.53	2,824,819.63

注：海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金的管理费率由 1.50% 下调至 1.20%，自 2023 年 8 月 26 日起执行新的管理费率。

2023 年 8 月 26 日之前，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 x1.50%/当年天数。

2023 年 8 月 26 日(含)之后，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 1.20% 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 x1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	383,333.80	716,312.05

注：海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金的托管费率由 0.25% 下调至 0.20%，自 2023 年 8 月 26 日起执行新的托管费率。

2023 年 8 月 26 日之前，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 x0.25%/当年天数。

2023 年 8 月 26 日(含)之后, 支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%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 x0.20%/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 2024年1月1日至2024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	-	3,434.62	3,434.62
海通证券	-	454.29	454.29
海富通	-	1,757.06	1,757.06
合计	-	5,645.97	5,645.97
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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	-	6,883.48	6,883.48
合计	-	11,109.66	11,109.66

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 x0.40%/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	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023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	21,494,796.2 1	52,426.76	11,678,044.3 4	45,985.08

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					
2024年1月1日至2024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	-	-	-	-	-
上年度可比期间					
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

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（2024 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
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新股锁定	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-

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
300630	普利制药	2024-05-06	重大事项未公告	12.35	2024-07-08	9.88	32,300	468,872.64	398,905.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

于 2024 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 2024 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 2024 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 2024 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 0.06%（2023 年 12 月 31 日：无）。

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-

A-1 以下	-	-
未评级	10,562,396.71	12,640,920.11
合计	10,562,396.71	12,640,920.11

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 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	197,512.16	-
未评级	-	-
合计	197,512.16	-

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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%。

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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	21,494,796.21	-	-	-	21,494,796.21
结算备付金	55,274,095.51	-	-	-	55,274,095.51
存出保证金	130,361.93	-	-	25,433,611.60	25,563,973.53
交易性金融资产	10,562,396.71	197,512.16	-	234,950,615.29	245,710,524.16
应收清算款	-	-	-	2,415,254.78	2,415,254.78
应收申购款	-	-	-	23,483.95	23,483.95
资产总计	87,461,650.36	197,512.16	-	262,822,965.62	350,482,128.14
负债					
应付清算款	-	-	-	240,887.92	240,887.92
应付赎回款	-	-	-	3,946,896.78	3,946,896.78
应付管理人报酬	-	-	-	341,241.93	341,241.93
应付托管费	-	-	-	56,873.64	56,873.64
应付销售服务费	-	-	-	6,791.87	6,791.87
应交税费	-	-	-	0.59	0.59
其他负债	-	-	-	1,163,418.80	1,163,418.80
负债总计	-	-	-	5,756,111.53	5,756,111.53
利率敏感度缺口	87,461,650.36	197,512.16	-	257,066,854.09	344,726,016.61
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	14,616,544.11	-	-	-	14,616,544.11
结算备付金	54,476,240.05	-	-	-	54,476,240.05
存出保证金	48,233.62	-	-	27,423,781.70	27,472,015.32
交易性金融资产	12,640,920.11	-	-	246,547,929.57	259,188,849.68
应收清算款	-	-	-	1,989,044.64	1,989,044.64
应收申购款	-	-	-	59,016.23	59,016.23

资产总计	81,781,937.89	-	-	276,019,772.14	357,801,710.03
负债					
应付清算款	-	-	-	3,442,481.91	3,442,481.91
应付赎回款	-	-	-	548,370.59	548,370.59
应付管理人报酬	-	-	-	373,982.79	373,982.79
应付托管费	-	-	-	62,330.49	62,330.49
应付销售服务费	-	-	-	7,336.64	7,336.64
应交税费	-	-	-	65,658.26	65,658.26
其他负债	-	-	-	1,253,072.06	1,253,072.06
负债总计	-	-	-	5,753,232.74	5,753,232.74
利率敏感度缺口	81,781,937.89	-	-	270,266,539.40	352,048,477.29

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-3,674.66	-1,427.39
	市场利率下降 25 个基点	3,700.54	1,431.10

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和股指期货，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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	234,950,615. 29	68.16	246,547,929.5 7	70.03
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	234,950,615. 29	68.16	246,547,929.5 7	70.03

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	-217,136.33	1,069,847.23
2.业绩比较基准下降 5%	217,136.33	-1,069,847.23	

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	234,739,447.73	246,154,394.37
第二层次	10,961,301.71	12,640,920.11
第三层次	9,774.72	393,535.20
合计	245,710,524.16	259,188,849.68

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 2024 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(2023 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	234,950,615.29	67.04
	其中:股票	234,950,615.29	67.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,759,908.87	3.07
	其中:债券	10,759,908.87	3.07
	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	76,768,891.72	21.90
8	其他各项资产	28,002,712.26	7.99
9	合计	350,482,128.14	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	1,277,727.00	0.37
B	采矿业	15,186,744.58	4.41
C	制造业	134,402,898.96	38.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,333,741.00	5.32
E	建筑业	4,542,457.00	1.32
F	批发和零售业	3,380,762.00	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	7,918,831.00	2.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,946,047.00	3.76
J	金融业	27,351,799.26	7.93
K	房地产业	2,261,590.00	0.66
L	租赁和商务服务业	2,490,738.00	0.72
M	科学研究和技术服务业	592,760.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	1,884,806.00	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,263,153.49	0.37
R	文化、体育和娱乐业	405,520.00	0.12
S	综合	711,040.00	0.21
	合计	234,950,615.29	68.16

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	600900	长江电力	101,200	2,926,704.00	0.85
2	300750	宁德时代	15,100	2,718,453.00	0.79
3	600941	中国移动	24,200	2,601,500.00	0.75
4	002001	新和成	123,100	2,363,520.00	0.69
5	600000	浦发银行	274,400	2,258,312.00	0.66
6	300308	中际旭创	14,840	2,046,139.20	0.59

7	601088	中国神华	45,500	2,018,835.00	0.59
8	002252	上海莱士	251,200	1,964,384.00	0.57
9	601328	交通银行	254,200	1,898,874.00	0.55
10	601717	郑煤机	127,900	1,892,920.00	0.55
11	002782	可立克	166,800	1,848,144.00	0.54
12	300031	宝通科技	128,500	1,846,545.00	0.54
13	600458	时代新材	179,600	1,813,960.00	0.53
14	603299	苏盐井神	190,400	1,808,800.00	0.52
15	600480	凌云股份	184,000	1,808,720.00	0.52
16	300502	新易盛	17,100	1,804,905.00	0.52
17	600177	雅戈尔	251,100	1,787,832.00	0.52
18	601668	中国建筑	333,600	1,771,416.00	0.51
19	600901	江苏金租	350,000	1,767,500.00	0.51
20	600346	恒力石化	121,900	1,700,505.00	0.49
21	600663	陆家嘴	191,300	1,687,266.00	0.49
22	603993	洛阳钼业	190,700	1,620,950.00	0.47
23	600008	首创环保	599,200	1,605,856.00	0.47
24	600018	上港集团	273,400	1,580,252.00	0.46
25	601077	渝农商行	307,800	1,545,156.00	0.45
26	600362	江西铜业	64,400	1,524,992.00	0.44
27	601728	中国电信	247,000	1,519,050.00	0.44
28	600219	南山铝业	397,500	1,514,475.00	0.44
29	601009	南京银行	145,600	1,512,784.00	0.44
30	000902	新洋丰	125,900	1,494,433.00	0.43
31	601229	上海银行	202,600	1,470,876.00	0.43
32	300303	聚飞光电	302,500	1,470,150.00	0.43
33	600299	安迪苏	151,500	1,469,550.00	0.43
34	601398	工商银行	256,300	1,460,910.00	0.42
35	300953	震裕科技	26,600	1,441,720.00	0.42
36	000333	美的集团	22,300	1,438,350.00	0.42
37	600674	川投能源	75,300	1,411,875.00	0.41
38	000538	云南白药	27,400	1,401,510.00	0.41
39	600577	精达股份	351,000	1,393,470.00	0.40
40	002128	电投能源	65,100	1,373,610.00	0.40
41	002138	顺络电子	49,800	1,367,508.00	0.40
42	002773	康弘药业	62,900	1,361,785.00	0.40
43	600210	紫江企业	254,000	1,351,280.00	0.39
44	000848	承德露露	171,200	1,345,632.00	0.39
45	002550	千红制药	248,600	1,339,954.00	0.39
46	600582	天地科技	193,900	1,335,971.00	0.39
47	603501	韦尔股份	13,400	1,331,558.00	0.39
48	600618	氯碱化工	151,600	1,331,048.00	0.39
49	600487	亨通光电	84,300	1,329,411.00	0.39
50	600282	南钢股份	265,200	1,320,696.00	0.38

51	600519	贵州茅台	900	1,320,651.00	0.38
52	300433	蓝思科技	71,800	1,310,350.00	0.38
53	300122	智飞生物	46,700	1,309,001.00	0.38
54	300183	东软载波	112,400	1,301,592.00	0.38
55	002267	陕天然气	171,400	1,295,784.00	0.38
56	600755	厦门国贸	180,600	1,294,902.00	0.38
57	002595	豪迈科技	33,500	1,278,695.00	0.37
58	600598	北大荒	102,300	1,277,727.00	0.37
59	601001	晋控煤业	77,300	1,276,996.00	0.37
60	001872	招商港口	66,200	1,274,350.00	0.37
61	601216	君正集团	342,800	1,264,932.00	0.37
62	600033	福建高速	377,300	1,263,955.00	0.37
63	301239	普瑞眼科	35,753	1,263,153.49	0.37
64	002048	宁波华翔	97,600	1,262,944.00	0.37
65	600873	梅花生物	125,400	1,256,508.00	0.36
66	300783	三只松鼠	57,300	1,253,151.00	0.36
67	600642	申能股份	139,800	1,234,434.00	0.36
68	601318	中国平安	29,100	1,203,576.00	0.35
69	000021	深科技	78,600	1,188,432.00	0.34
70	002053	云南能投	98,100	1,186,029.00	0.34
71	002126	银轮股份	67,713	1,178,883.33	0.34
72	600150	中国船舶	28,600	1,164,306.00	0.34
73	002736	国信证券	133,700	1,161,853.00	0.34
74	000552	甘肃能化	332,000	1,152,040.00	0.33
75	601138	工业富联	42,000	1,150,800.00	0.33
76	002545	东方铁塔	164,100	1,117,521.00	0.32
77	002322	理工能科	67,100	1,074,942.00	0.31
78	300073	当升科技	31,300	1,073,903.00	0.31
79	603129	春风动力	7,500	1,067,550.00	0.31
80	601166	兴业银行	59,400	1,046,628.00	0.30
81	600820	隧道股份	159,500	1,041,535.00	0.30
82	002043	兔宝宝	98,900	1,025,593.00	0.30
83	000915	华特达因	33,900	1,022,424.00	0.30
84	600874	创业环保	173,700	970,983.00	0.28
85	601033	永兴股份	59,400	961,686.00	0.28
86	601628	中国人寿	30,600	950,130.00	0.28
87	000921	海信家电	29,282	944,051.68	0.27
88	601311	骆驼股份	117,300	940,746.00	0.27
89	600028	中国石化	148,800	940,416.00	0.27
90	000795	英洛华	167,400	927,396.00	0.27
91	601939	建设银行	125,200	926,480.00	0.27
92	600098	广州发展	144,500	924,800.00	0.27
93	600938	中国海油	27,600	910,800.00	0.26
94	000598	兴蓉环境	121,100	910,672.00	0.26

95	002463	沪电股份	24,800	905,200.00	0.26
96	002078	太阳纸业	64,600	901,170.00	0.26
97	601601	中国太保	31,900	888,734.00	0.26
98	600023	浙能电力	123,500	878,085.00	0.25
99	601899	紫金矿业	49,894	876,637.58	0.25
100	300573	兴齐眼药	5,320	872,480.00	0.25
101	600522	中天科技	51,500	816,275.00	0.24
102	601975	招商南油	226,600	813,494.00	0.24
103	600795	国电电力	134,800	807,452.00	0.23
104	600036	招商银行	23,600	806,884.00	0.23
105	603983	丸美股份	28,800	792,864.00	0.23
106	603733	仙鹤股份	44,600	784,068.00	0.23
107	688776	国光电气	14,084	780,253.60	0.23
108	300383	光环新网	92,300	779,935.00	0.23
109	002978	安宁股份	27,500	766,150.00	0.22
110	600332	白云山	25,900	759,647.00	0.22
111	600323	瀚蓝环境	36,300	758,670.00	0.22
112	600999	招商证券	54,200	753,922.00	0.22
113	600483	福能股份	63,800	743,908.00	0.22
114	601702	华峰铝业	40,100	732,226.00	0.21
115	600803	新奥股份	35,100	730,080.00	0.21
116	002544	普天科技	38,600	721,434.00	0.21
117	002204	大连重工	168,500	719,495.00	0.21
118	600673	东阳光	101,000	711,040.00	0.21
119	002588	史丹利	93,400	703,302.00	0.20
120	002353	杰瑞股份	19,900	698,092.00	0.20
121	601117	中国化学	84,600	697,104.00	0.20
122	603328	依顿电子	88,600	696,396.00	0.20
123	600123	兰花科创	77,400	692,730.00	0.20
124	601169	北京银行	118,300	690,872.00	0.20
125	300973	立高食品	24,400	685,396.00	0.20
126	688348	昱能科技	11,610	684,990.00	0.20
127	000513	丽珠集团	18,400	684,664.00	0.20
128	603583	捷昌驱动	32,800	668,464.00	0.19
129	002635	安洁科技	43,200	667,008.00	0.19
130	600919	江苏银行	88,782	659,650.26	0.19
131	601857	中国石油	63,800	658,416.00	0.19
132	601298	青岛港	68,600	655,816.00	0.19
133	000400	许继电气	19,000	653,790.00	0.19
134	600690	海尔智家	22,900	649,902.00	0.19
135	300088	长信科技	136,900	643,430.00	0.19
136	601963	重庆银行	82,900	642,475.00	0.19
137	603283	赛腾股份	8,400	641,760.00	0.19
138	000338	潍柴动力	38,800	630,112.00	0.18

139	000030	富奥股份	128,100	628,971.00	0.18
140	002003	伟星股份	50,000	627,500.00	0.18
141	600968	海油发展	151,600	624,592.00	0.18
142	688028	沃尔德	37,800	621,054.00	0.18
143	000039	中集集团	66,700	617,642.00	0.18
144	301316	慧博云通	42,000	616,560.00	0.18
145	601288	农业银行	140,400	612,144.00	0.18
146	300805	电声股份	96,200	611,832.00	0.18
147	300279	和晶科技	146,300	610,071.00	0.18
148	002137	实益达	128,100	609,756.00	0.18
149	601658	邮储银行	120,200	609,414.00	0.18
150	300476	胜宏科技	18,600	600,036.00	0.17
151	000017	深中华 A	100,700	599,165.00	0.17
152	688078	龙软科技	25,800	594,174.00	0.17
153	688046	药康生物	58,000	592,760.00	0.17
154	603156	养元饮品	27,800	591,306.00	0.17
155	002429	兆驰股份	122,100	587,301.00	0.17
156	688091	上海谊众	25,800	582,822.00	0.17
157	300760	迈瑞医疗	2,000	581,820.00	0.17
158	600380	健康元	51,500	575,255.00	0.17
159	300360	炬华科技	33,200	564,400.00	0.16
160	300235	方直科技	70,300	563,806.00	0.16
161	000883	湖北能源	93,200	560,132.00	0.16
162	300181	佐力药业	36,800	556,416.00	0.16
163	688093	世华科技	30,372	551,859.24	0.16
164	002273	水晶光电	32,500	551,850.00	0.16
165	600233	圆通速递	35,200	550,880.00	0.16
166	300658	延江股份	128,500	542,270.00	0.16
167	002922	伊戈尔	24,400	533,384.00	0.15
168	603556	海兴电力	11,300	529,179.00	0.15
169	002142	宁波银行	23,800	525,028.00	0.15
170	300153	科泰电源	87,500	520,625.00	0.15
171	688403	汇成股份	61,200	518,976.00	0.15
172	002020	京新药业	49,200	515,124.00	0.15
173	002152	广电运通	49,200	514,632.00	0.15
174	601225	陕西煤业	19,800	510,246.00	0.15
175	601607	上海医药	26,700	510,237.00	0.15
176	300463	迈克生物	44,800	509,824.00	0.15
177	002139	拓邦股份	48,000	509,760.00	0.15
178	000576	甘化科工	84,900	509,400.00	0.15
179	603229	奥翔药业	50,500	507,525.00	0.15
180	002446	盛路通信	89,400	505,110.00	0.15
181	000830	鲁西化工	43,300	501,847.00	0.15
182	600546	山煤国际	34,200	500,004.00	0.15

183	000028	国药一致	15,400	496,342.00	0.14
184	601577	长沙银行	59,500	486,710.00	0.14
185	000543	皖能电力	54,800	484,980.00	0.14
186	300109	新开源	41,500	480,570.00	0.14
187	688187	时代电气	9,700	478,986.00	0.14
188	688533	上声电子	18,500	478,595.00	0.14
189	001286	陕西能源	41,500	478,495.00	0.14
190	600908	无锡银行	89,600	476,672.00	0.14
191	002866	传艺科技	36,700	472,329.00	0.14
192	300173	福能东方	123,000	463,710.00	0.13
193	601918	新集能源	47,100	459,225.00	0.13
194	300274	阳光电源	7,360	456,540.80	0.13
195	301004	嘉益股份	4,900	445,900.00	0.13
196	688737	中自科技	27,500	445,500.00	0.13
197	600926	杭州银行	33,900	442,395.00	0.13
198	002577	雷柏科技	35,500	439,135.00	0.13
199	600886	国投电力	24,000	437,760.00	0.13
200	300470	中密控股	12,900	436,149.00	0.13
201	000636	风华高科	33,300	434,898.00	0.13
202	600916	中国黄金	45,200	434,824.00	0.13
203	600497	驰宏锌锗	80,700	430,938.00	0.13
204	601997	贵阳银行	81,300	428,451.00	0.12
205	000090	天健集团	106,500	428,130.00	0.12
206	600863	内蒙华电	91,900	426,416.00	0.12
207	603008	喜临门	24,300	421,119.00	0.12
208	002371	北方华创	1,300	415,857.00	0.12
209	002027	分众传媒	68,600	415,716.00	0.12
210	002064	华峰化学	56,700	406,539.00	0.12
211	601928	凤凰传媒	37,000	405,520.00	0.12
212	603323	苏农银行	84,000	404,040.00	0.12
213	000157	中联重科	52,100	400,128.00	0.12
214	300630	普利制药	32,300	398,905.00	0.12
215	002233	塔牌集团	54,500	398,395.00	0.12
216	600575	淮河能源	102,400	398,336.00	0.12
217	603871	嘉友国际	22,300	394,487.00	0.11
218	601000	唐山港	83,000	390,100.00	0.11
219	600848	上海临港	41,600	378,976.00	0.11
220	600237	铜峰电子	72,300	377,406.00	0.11
221	603067	振华股份	31,600	368,456.00	0.11
222	301238	瑞泰新材	24,100	360,777.00	0.10
223	605090	九丰能源	12,300	356,700.00	0.10
224	300674	宇信科技	32,100	355,668.00	0.10
225	688371	菲沃泰	34,900	350,396.00	0.10
226	600039	四川路桥	43,600	344,004.00	0.10

227	300628	亿联网络	9,280	341,225.60	0.10
228	002422	科伦药业	11,200	339,696.00	0.10
229	601998	中信银行	50,600	339,020.00	0.10
230	600879	航天电子	43,300	336,441.00	0.10
231	601838	成都银行	22,100	335,699.00	0.10
232	600050	中国联通	69,600	327,120.00	0.09
233	300373	扬杰科技	8,400	326,760.00	0.09
234	002540	亚太科技	61,700	326,393.00	0.09
235	600572	康恩贝	72,900	325,863.00	0.09
236	002851	麦格米特	12,600	325,584.00	0.09
237	300534	陇神戎发	45,800	324,264.00	0.09
238	603611	诺力股份	19,000	323,760.00	0.09
239	300979	华利集团	5,300	322,505.00	0.09
240	300482	万孚生物	13,200	322,080.00	0.09
241	002519	银河电子	65,500	321,605.00	0.09
242	002745	木林森	39,800	320,788.00	0.09
243	688510	航亚科技	17,300	318,493.00	0.09
244	300737	科顺股份	73,600	316,480.00	0.09
245	002034	旺能环境	24,300	316,143.00	0.09
246	300908	仲景食品	11,000	305,580.00	0.09
247	300566	激智科技	21,800	304,982.00	0.09
248	000630	铜陵有色	83,400	301,074.00	0.09
249	002966	苏州银行	38,700	290,250.00	0.08
250	301185	鸥玛软件	20,100	288,033.00	0.08
251	600125	铁龙物流	48,000	286,560.00	0.08
252	600309	万华化学	3,500	283,010.00	0.08
253	000682	东方电子	25,500	281,520.00	0.08
254	688169	石头科技	714	280,316.40	0.08
255	601818	光大银行	86,000	272,620.00	0.08
256	600241	时代万恒	47,900	266,324.00	0.08
257	600776	东方通信	26,700	262,461.00	0.08
258	300982	苏文电能	13,800	260,268.00	0.08
259	002990	盛视科技	12,900	259,677.00	0.08
260	002171	楚江新材	39,200	258,328.00	0.07
261	603279	景津装备	11,900	258,111.00	0.07
262	601028	玉龙股份	20,600	257,500.00	0.07
263	601163	三角轮胎	16,900	257,218.00	0.07
264	600850	电科数字	14,200	257,020.00	0.07
265	002697	红旗连锁	55,100	255,113.00	0.07
266	600887	伊利股份	9,800	253,232.00	0.07
267	601319	中国人保	48,600	250,290.00	0.07
268	688981	中芯国际	5,400	248,940.00	0.07
269	002488	金固股份	56,000	245,840.00	0.07
270	300142	沃森生物	21,100	240,118.00	0.07

271	601985	中国核电	22,100	235,586.00	0.07
272	002831	裕同科技	9,200	235,428.00	0.07
273	000027	深圳能源	32,200	235,060.00	0.07
274	601766	中国中车	31,200	234,312.00	0.07
275	000001	平安银行	23,000	233,450.00	0.07
276	605398	新炬网络	11,300	231,537.00	0.07
277	688553	汇宇制药	18,200	226,044.00	0.07
278	000063	中兴通讯	8,000	223,760.00	0.06
279	002532	天山铝业	27,500	223,025.00	0.06
280	002600	领益智造	31,300	222,856.00	0.06
281	688579	山大地纬	28,300	222,155.00	0.06
282	600269	赣粤高速	42,700	220,759.00	0.06
283	603986	兆易创新	2,300	219,926.00	0.06
284	000651	格力电器	5,500	215,710.00	0.06
285	000100	TCL 科技	49,300	212,976.00	0.06
286	301327	华宝新能	3,600	206,280.00	0.06
287	300596	利安隆	7,600	206,188.00	0.06
288	600660	福耀玻璃	4,300	205,970.00	0.06
289	000858	五粮液	1,600	204,864.00	0.06
290	688332	中科蓝讯	3,320	195,846.80	0.06
291	600048	保利发展	22,300	195,348.00	0.06
292	000923	河钢资源	11,200	192,864.00	0.06
293	300910	瑞丰新材	4,300	187,996.00	0.05
294	603393	新天然气	5,400	187,596.00	0.05
295	600312	平高电气	9,500	184,775.00	0.05
296	002993	奥海科技	4,900	182,280.00	0.05
297	601168	西部矿业	10,100	181,295.00	0.05
298	600426	华鲁恒升	6,800	181,152.00	0.05
299	300627	华测导航	6,000	179,100.00	0.05
300	000887	中鼎股份	14,600	178,704.00	0.05
301	601600	中国铝业	23,300	177,779.00	0.05
302	002475	立讯精密	4,500	176,895.00	0.05
303	601058	赛轮轮胎	12,600	176,400.00	0.05
304	301301	川宁生物	13,800	176,364.00	0.05
305	688401	路维光电	6,712	175,854.40	0.05
306	002096	易普力	14,700	174,930.00	0.05
307	002039	黔源电力	9,900	174,240.00	0.05
308	600710	苏美达	21,300	173,595.00	0.05
309	002938	鹏鼎控股	4,300	170,968.00	0.05
310	300795	米奥会展	9,600	168,288.00	0.05
311	002833	弘亚数控	9,100	165,984.00	0.05
312	600406	国电南瑞	6,600	164,736.00	0.05
313	300349	金卡智能	13,800	164,496.00	0.05
314	301109	军信股份	11,000	164,450.00	0.05

315	601127	赛力斯	1,800	164,016.00	0.05
316	600422	昆药集团	9,100	162,253.00	0.05
317	605319	无锡振华	9,100	161,070.00	0.05
318	300791	仙乐健康	6,370	160,524.00	0.05
319	002311	海大集团	3,400	159,970.00	0.05
320	000933	神火股份	7,863	159,068.49	0.05
321	002130	沃尔核材	10,900	153,908.00	0.04
322	002452	长高电新	18,300	151,524.00	0.04
323	603369	今世缘	3,200	147,840.00	0.04
324	300856	科思股份	4,600	147,246.00	0.04
325	300457	赢合科技	8,200	146,206.00	0.04
326	601689	拓普集团	2,600	139,386.00	0.04
327	601677	明泰铝业	11,700	135,252.00	0.04
328	300130	新国都	7,900	131,456.00	0.04
329	300926	博俊科技	6,120	122,522.40	0.04
330	603699	纽威股份	7,144	122,305.28	0.04
331	300415	伊之密	5,800	120,524.00	0.03
332	600114	东睦股份	7,800	112,242.00	0.03
333	002847	盐津铺子	2,500	106,925.00	0.03
334	300679	电连技术	2,600	104,598.00	0.03
335	300514	友讯达	6,500	98,345.00	0.03
336	002533	金杯电工	9,700	96,515.00	0.03
337	601919	中远海控	5,800	89,842.00	0.03
338	603236	移远通信	1,900	88,787.00	0.03
339	688789	宏华数科	777	83,760.60	0.02
340	603055	台华新材	7,900	80,027.00	0.02
341	002264	新华都	14,900	76,139.00	0.02
342	688408	中信博	553	50,920.24	0.01
343	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
344	688469	芯联集成	2,465	9,761.40	0.00
345	301578	辰奕智能	154	6,093.78	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	600519	贵州茅台	12,855,654.00	3.65
2	002773	康弘药业	9,098,636.00	2.58
3	300319	麦捷科技	8,663,897.60	2.46
4	600900	长江电力	8,320,564.00	2.36

5	601318	中国平安	7,933,807.00	2.25
6	300750	宁德时代	7,739,314.14	2.20
7	601398	工商银行	7,461,956.00	2.12
8	000837	秦川机床	7,018,942.28	1.99
9	301239	普瑞眼科	7,013,906.77	1.99
10	600919	江苏银行	6,462,099.00	1.84
11	601088	中国神华	6,336,876.00	1.80
12	000338	潍柴动力	6,277,065.00	1.78
13	300451	创业慧康	6,146,384.00	1.75
14	002446	盛路通信	6,039,151.00	1.72
15	600577	精达股份	5,864,051.00	1.67
16	603985	恒润股份	5,848,618.00	1.66
17	601169	北京银行	5,777,322.00	1.64
18	601328	交通银行	5,438,906.00	1.54
19	300122	智飞生物	5,396,860.50	1.53
20	300602	飞荣达	5,338,567.90	1.52

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	13,499,756.42	3.83
2	300319	麦捷科技	10,257,104.00	2.91
3	002773	康弘药业	8,190,220.00	2.33
4	601318	中国平安	7,244,027.00	2.06
5	000837	秦川机床	7,170,418.42	2.04
6	600900	长江电力	6,596,560.50	1.87
7	002130	沃尔核材	6,285,170.72	1.79
8	600919	江苏银行	6,272,474.55	1.78
9	601398	工商银行	6,262,298.00	1.78
10	603985	恒润股份	5,982,513.17	1.70
11	300451	创业慧康	5,931,493.00	1.68
12	300602	飞荣达	5,811,513.16	1.65
13	000338	潍柴动力	5,717,855.24	1.62
14	002516	旷达科技	5,579,219.00	1.58
15	603118	共进股份	5,241,720.00	1.49
16	300750	宁德时代	5,235,281.60	1.49
17	002446	盛路通信	5,195,874.00	1.48
18	601169	北京银行	5,167,113.00	1.47
19	600577	精达股份	5,148,075.97	1.46

20	688380	中微半导	5,131,739.88	1.46
----	--------	------	--------------	------

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	2,291,510,110.44
卖出股票的收入（成交）总额	2,286,676,118.52

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	10,562,396.71	3.06
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）	197,512.16	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,759,908.87	3.12

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	019709	23 国债 16	104,000	10,562,396.71	3.06
2	111003	聚合转债	1,640	197,512.16	0.06

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 234,950,615.29 元，占基金资产净值的比例为 68.16%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-200,029,840.00 元，占基金资产净值的比例为-58.03%，空头合约市值占股票资产的比例为-85.14%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 934,779.14 元，公允价值变动损益为 4,707,100.06 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	25,563,973.53
2	应收清算款	2,415,254.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	23,483.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,002,712.26

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	111003	聚合转债	197,512.16	0.06

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	130,255	2,290.01	55,240,965.71	18.52%	243,044,769.64	81.48%
海富通阿尔法对 冲混合 C	3,877	5,047.67	2,038,485.86	10.42%	17,531,318.64	89.58%
合计	134,132	2,369.72	57,279,451.57	18.02%	260,576,088.28	81.98%

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	1,175,601.51	0.3941%
	海富通阿尔法对冲混合 C	137,071.96	0.7004%
	合计	1,312,673.47	0.4130%

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	50~100
	海富通阿尔法对冲混合 C	0
	合计	50~100
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，本基金管理人运用固有资金总计 1000.10 万元认购了本基金，其中，发起资金总计人民币 1000 万元，认购费用为人民币 1000 元，符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有不少于 3 年。截至 2017 年 11 月 20 日，发起份额承诺持有期限已经届满。2017 年 12 月公司赎回所有份额。截止报告期末，公司未持有本基

金份额。

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C
基金合同生效日（2014 年 11 月 20 日）基金份额总额	719,877,758.17	-
本报告期期初基金份额总额	308,964,612.04	20,320,036.04
本报告期基金总申购份额	104,758,907.48	2,178,105.54
减：本报告期基金总赎回份额	115,437,784.17	2,928,337.08
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	298,285,735.35	19,569,804.50

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，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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，本基金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	
中信证券	4	1,654,975,791.87	36.15%	1,201,917.30	38.20%	-
国盛证券	2	1,086,772,631.73	23.74%	806,752.04	25.64%	-
天风证券	2	661,400,588.13	14.45%	490,487.87	15.59%	-
华创证券	1	475,401,495.98	10.38%	207,229.24	6.59%	-
申万宏源	2	262,072,163.77	5.72%	115,673.96	3.68%	-
国泰君安	2	212,691,625.80	4.65%	157,292.61	5.00%	-
招商证券	2	98,505,229.37	2.15%	73,473.95	2.33%	-
华西证券	1	49,413,416.54	1.08%	36,856.66	1.17%	-
海通证券	2	43,608,717.83	0.95%	32,285.97	1.03%	-
野村东方国际证券	1	16,703,040.80	0.36%	12,292.27	0.39%	-
开源证券	2	16,641,527.14	0.36%	12,413.40	0.39%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

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、研究水平和综合服务支持三个部分进行评议，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，经投资部部门内部讨论，形成证券公司交易单元租用意见，并报公司总经理办公会审议。

<2> 核准。在完成对证券公司的评估和审核后，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
中信证券	691,344.47	2.66%	-	-	-	-
国盛证券	499,260.27	1.92%	24,000,000.00	100.00%	-	-
天风证券	986,160.76	3.80%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	23,274,484.00	89.69%	-	-	-	-
海通证券	499,990.00	1.93%	-	-	-	-
野村东方国际 证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

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部分基金新增上海华夏财富投资管理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	2024-04-18

§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 123 只公募基金。截至 2024 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1613 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。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联《上海证券报》颁发的“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，海富通荣获中国保险资产管理业协会颁发的“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《上海证券报》颁发的“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”。2023 年 8 月，海富通荣获《上海证券报》颁发的“上证·中国基金投教创新案例奖”。

§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

二〇二四年八月三十日