海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金
2024 年年度报告
2024 年 12 月 31 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年三月三十一日

§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。本年度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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 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。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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 6
2.1 基金基本情况 6
2.2 基金产品说明 6
2.3 基金管理人和基金托管人 7
2.4 信息披露方式 7
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 8
3.1 主要会计数据和财务指标 8
3.2 基金净值表现 10
3.3 过去三年基金的利润分配情况 13
§4 管理人报告 13
4.1 基金管理人及基金经理情况 13
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 16
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 17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 20
4.9 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 20
§5 托管人报告 20
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 20
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 20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 20
§6 审计报告 21
6.1 审计意见 21
6.2 形成审计意见的基础 21
6.3 其他信息 21
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任 22
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任 22
§7 年度财务报表 23
7.1 资产负债表 23
7.2 利润表 24
7.3 净资产变动表 25
7.4 报表附注 27
§8 投资组合报告 61
8.1 期末基金资产组合情况 61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 61
8.3 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 62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 76

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 93
8.6 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 93
8.7 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 93
8.8 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 93
8.9 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 94
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 94
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 94
8.12 市场中性策略执行情况 94
8.13 投资组合报告附注 94
§9 基金份额持有人信息 95
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 95
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 96
9.3 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 96
§10 开放式基金份额变动 96
§11 重大事件揭示 97
11.1 基金份额持有人大会决议 97
11.2 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 97
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 97
11.4 基金投资策略的改变 97
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 97
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 97
11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 97
11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 97
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 98
11.8 其他重大事件 99
12 影响投资者决策的其他重要信息 100
§13 备查文件目录 101
13.1 备查文件目录 101
13.2 存放地点 101
13.3 查阅方式 101

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	海富通安益对冲混合	
基金主代码	008830	
交易代码	008830	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 1 月 22 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	108,878,396.80 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C
下属分级基金的交易代码	008831	008830
报告期末下属分级基金的份额总额	51,886,365.49 份	56,992,031.31 份

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，灵活应用多种策略对冲投资组合的市场风险，谋求投资组合资产的长期增值。
投资策略	基金主要采用量化对冲等投资策略，在力求有效控制投资风险的前提下，通过全市场选股构建预期收益高于市场回报的投资组合，同时利用股指期货等多种策略对冲投资组合的市场风险。本基金将根据沪深 300 股指期货当月合约与现货指数的差除以股指指数的情况来灵活调整股票资产的配置比例，以求获得不依赖市场整体走向的稳定收益。
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期三年期定期存款基准利率(税后)
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，通过采用量化对冲策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金将投资港股通标的股

	票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	岳冲	方圆
	联系电话	021-38650788	95559
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		40088-40099	95559
传真		021-33830166	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		路颖	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	海富通基金管理有限公司	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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年		2023 年		2022 年	
	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C
本期已实现收益	2,698,617.53	-2,119,296.07	2,641,242.90	2,111,385.57	-6,926,686.22	-3,568,381.54
本期利润	-24,382.47	-5,209,114.16	4,859,147.48	4,735,283.37	-24,884,747.74	-14,007,248.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0005	-0.0347	0.0542	0.0787	-0.0839	-0.0589
本期加权平均净值利润率	-0.05%	-3.29%	5.11%	7.55%	-8.05%	-5.71%
本期基金份额净值增长率	-0.34%	-0.73%	4.59%	4.16%	-3.51%	-3.89%

3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C
期末可供分配利润	3,681,215.83	2,826,866.53	3,852,420.77	2,611,825.31	3,325,089.47	2,816,798.39
期末可供分配基金份额利润	0.0709	0.0496	0.0745	0.0573	0.0273	0.0151
期末基金资产净值	55,567,581.32	59,818,897.84	55,597,117.30	48,198,884.50	124,969,473.03	189,574,630.44
期末基金份额净值	1.0709	1.0496	1.0745	1.0573	1.0273	1.0151
3.1.3 累计期末指标	**2024 年末**		**2023 年末**		**2022 年末**	
	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C
基金份额累计净值增长率	7.09%	4.96%	7.45%	5.73%	2.73%	1.51%

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）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1．海富通安益对冲混合 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
过去三个月	2.72%	0.59%	0.69%	0.01%	2.03%	0.58%
过去六个月	-0.36%	0.52%	1.38%	0.01%	-1.74%	0.51%
过去一年	-0.34%	0.47%	2.76%	0.01%	-3.10%	0.46%
过去三年	0.58%	0.39%	8.49%	0.01%	-7.91%	0.38%
自基金合同生效起至今	7.09%	0.38%	14.37%	0.01%	-7.28%	0.37%

2．海富通安益对冲混合 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
过去三个月	2.62%	0.58%	0.69%	0.01%	1.93%	0.57%
过去六个月	-0.57%	0.51%	1.38%	0.01%	-1.95%	0.50%
过去一年	-0.73%	0.47%	2.76%	0.01%	-3.49%	0.46%
过去三年	-0.62%	0.39%	8.49%	0.01%	-9.11%	0.38%
自基金合同生效起至今	4.96%	0.38%	14.37%	0.01%	-9.41%	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

海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

1．海富通安益对冲混合 A

(2020 年 1 月 22 日至 2024 年 12 月 31 日)

2．海富通安益对冲混合 C

(2020 年 1 月 22 日至 2024 年 12 月 31 日)

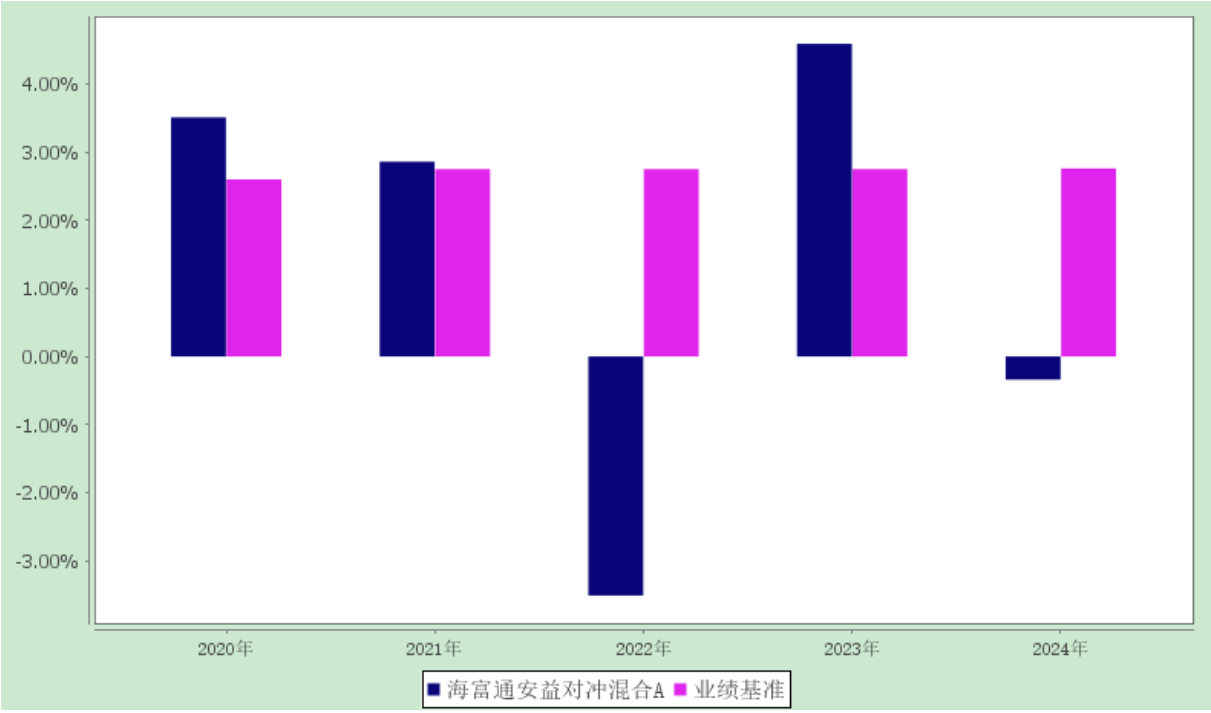
注：本基金合同于 2020 年 1 月 22 日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

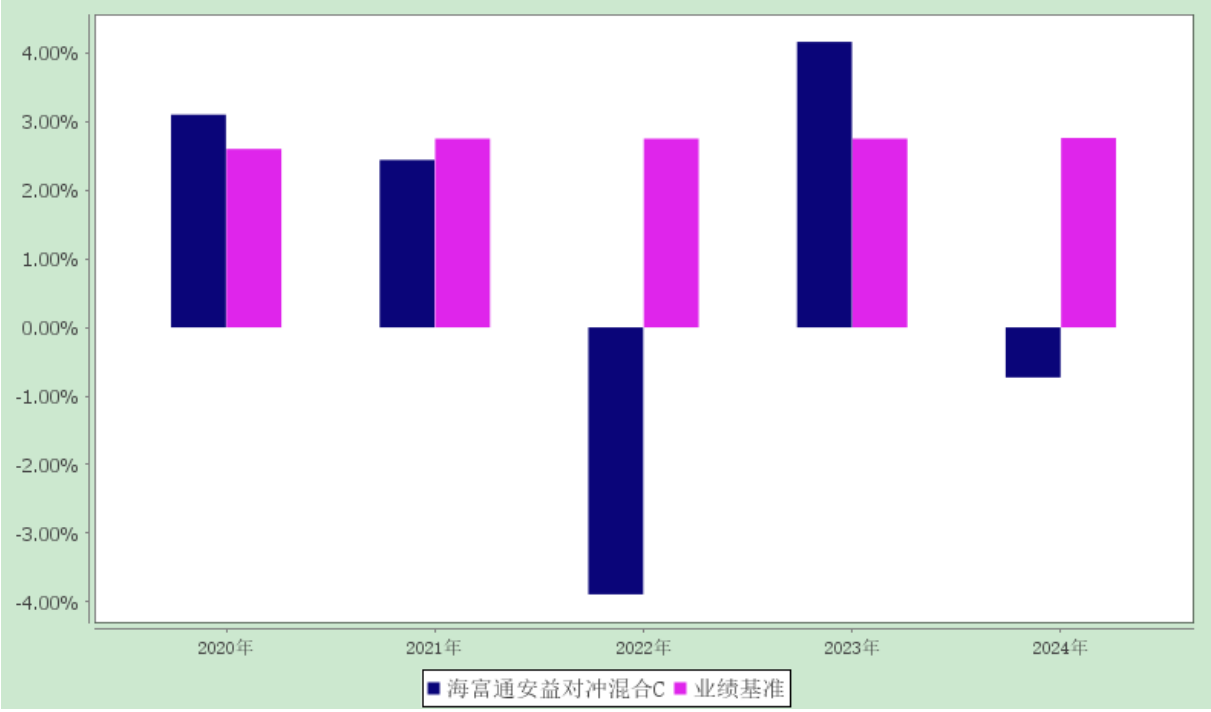
海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

1．海富通安益对冲混合 A



2．海富通安益对冲混合 C



注：图中列示的 2020 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 1 月 22 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、海富通安益对冲混合 A：

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

2、海富通安益对冲混合 C：

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金过去三年未发生利润分配。

§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 12 月 31 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 A100 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）、海富通量化前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、海富通量化选股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	2022-08-15	-	17 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 月至 2022 年 8 月任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019 年 10 月至 2022 年 12 月兼任海富通富祥混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通沪深 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的基金经理。2020 年 10 月至 2022 年 8 月兼任海富通新内需混合基金经理。2022 年 8 月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2022

					年 12 月至 2024 年 4 月兼任海富通量化前锋股票、海富通中证 500 增强基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通中证 2000 增强策略 ETF 基金经理。
孙恂	本基金的基金经理助理	2024-10-11	-	2 年	统计学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Dataline Inc.数据科学家、Freedom Mortgage Inc.数据科学家、摩根大通银行资深数据科学家、支付宝网络技术有限公司风险策略专家。2022 年 5 月加入海富通基金管理有限公司，任量化研究员。2024 年 10 月起兼任海富通安益对冲混合、海富通沪深 300 增强基金经理助理。

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了一级市场和二级市场的所有投资交易管理活动以及公司内部的证券分配，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95%置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占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。

4.3.3 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

2024年，国内经济整体维持弱修复状态，实际GDP同比实现5%增长，高于2022-2023年的复合增速 4.3%。物价也保持相对平稳，全年居民消费价格指数同比上涨 0.2%。从节奏上看，年初经济实现开门红，二季度经济增长开始放缓。但是，随着 9 月 24 日以来一系列宏观政策持续加码，市场信心开始回暖，房地产成交显著放量，居民消费开始好转，股市也震荡走强，最终四季度实际 GDP 实现了 5.4%的增长。

海外经济方面，2024 年美国积极的财政和宽松的货币政策共同支撑其国内经济。随着美国通胀开始降温，9 月美联储启动了降息，年内累计降息 100BP，2024 财年财政赤字率达到了 6.6%，高于 2023 年的 6.2%。在宽松货币政策和积极财政政策下，短期美国经济还难言衰退。此外，特朗普赢得了美国总统大选，需要关注未来中美关系及特朗普对华政策变化。

本报告期内，从行业维度来看，价值板块和成长板块阶段性均有不错表现，整体而言，以红利为代表的价值板块相对占优。全年来看，大市值股票跑赢小市值股票。以食品饮料和医药为代表的消费板块以及地产链板块全年表现较弱，而受益于 AI 技术进步的通信、电子板块表现突出；红利板块全年表现稳健。宏观经济缓慢复苏，市场情绪回暖，成交量维持在万亿以上。

在因子方面，上半年基本面类因子表现较好，价量因子表现较差。下半年发生了较为剧烈的风格反转，基本面因子的超额收益持续回撤，而价量因子则回暖。9 月下旬市场反转后，量化模型的常用因子集体阶段性失效，超额收益也受到负面影响。但这一现象在 11 月后有所缓解，超额收益开始回升。

本基金在风格上保持相对均衡，依据公司基本面的盈利质量、景气度和估值匹配，从中寻找投资机会。同时，本基金积极运用深度学习量价模型，发掘低关注股票中的投资机会。此外，本基金通过多策略并行的方式，以降低单一策略失效的风险。

在风险控制方面，本基金控制各个因子的偏离度，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，我们根据股指期货基差和模型超额的情况，动态调整不同策略单元的权重和权益仓位，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，海富通安益对冲混合 A 净值增长率为-0.34%，同期业绩比较基准收益率为 2.76%。海富通安益对冲混合 C 净值增长率为-0.73%，同期业绩比较基准收益率为 2.76%。

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，2025 年美国财政刺激力度依然不弱，叠加降息周期还没结束，居民和企业部门资产负债表相对健康，短期美国经济还难言衰退。不过，随着特朗普关税、移民、减税等政策落地，美国通胀压力可能会抬升，美联储的降息节奏和幅度可能还存在变数，经济也存在滞胀风险。同时，美国债务上限问题依旧困扰财政政策，下半年国债发行冲击可能导致美债收益率冲高，这对全球金融市场、各类资产都将产生较为显著的影响，未来需要密切跟踪。

从市场方向看，当前中国经济持续修复，随着 924 以来一系列政策出台，官方积极回应市场的关切，市场信心已较大改善，上证指数震荡走高，2024 年第 4 季度 GDP 增速也超预期增长，相关政策对经济有提振作用。在最新中央经济工作会议中，提出了“稳住楼市股市”、“创新金融工具，维护金融市场稳定”等，我们认为国内资本市场风险可控，积极可为。展望未来，我们对 A 股充满信心，将积极跟踪国内政策和经济的变化，把握投资机会。

展望 2025 年，人工智能、机器人、自主可控等科技板块可能迎来较好的投资机会。在用量化模型构建投资组合时，我们将设定一些限制条件，重点关注上述板块中的投资潜力。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024 年，基金管理人监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，通过业务审核、合规检查、系统监控、重点抽查、专项审计等一系列方式开展工作，强化基金运作和公司运营的合规性，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、加强合规管理，持续完善公司的规章制度体系

报告期内，坚持以法律法规和公司制度为依据，对公司和基金运作的各项业务开展提供全面的合规咨询、审核、监测与检查，确保基金运作的合法合规性。根据法律法规、监管政策的变化，结合业务发展及公司管理需要，对公司内控制度体系进行了完善和全

面梳理，新增和修订了多项内部制度和流程，提升了公司的合规管理水平。

二、客观开展内外部内控评估，进一步优化内控措施

根据法规、监管要求并结合风险导向和全覆盖原则，公司继续通过日常业务的定期合规检查、不定期自查等方式，重点关注规章制度的执行情况、第一道防线风险控制的有效性和投资运作与产品合同约定的一致性。同时，对各部门的业务有重点的开展了多项专项检查和内部审计。另外，根据法规和公司管理需要，公司聘请会计师事务所等外部专业机构对公司开展了内部控制评价等方面的审计。通过内外部审计及合规检查，审视法律法规和监管要求的落实情况、监督公司制度流程的执行情况，及时发现存在的问题，并通过加强跨部门的协作沟通，形成合力，认真整改，进一步健全完善了公司的内部控制体系。

三、有效推进反洗钱与反恐怖融资工作

报告期内，结合反洗钱法规及公司业务特点完善了反洗钱制度，组织多场反洗钱培训和宣传活动；基于风险为本的工作思路，继续开展客户信息数据治理工作，稳步推进代销机构分类管理工作，持续优化监测模型，强化可疑交易监控，并按时向中国反洗钱监测分析中心报送相关数据。报告期内，公司根据监管要求完成了各项洗钱固有风险评估及洗钱风险控制措施有效性调查工作，有效管控公司洗钱固有风险敞口。另外，公司加大反洗钱课题研习工作力度，组织反洗钱专兼职人员深入开展相关课题研究和投稿，提升反洗钱工作质效。

四、强化合规文化培训，提升员工的合规及风险意识

本报告期内，为提高公司全员的合规意识，加大了合规培训力度，强化主动合规意识培育。公司进一步加强组织各类合规培训频率，及时对法规、监管精神和公司要求进行宣导，并通过制作合规法务月刊、开展“合规文化宣传月”主题活动等多样化的合规宣传培训方式进一步提高法律法规宣导工作的及时性，丰富合规宣导工作的形式，激发全体员工学习合规内控政策的积极性，营造合规文化浓厚氛围。通过培训，增强了全体员工的合规意识和风险防范意识，提升了员工的主动识别和控制业务风险的积极性和能力。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金财产安全、合规、诚信运作。

4.7 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。

4.8 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，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金报告期内未进行过利润分配，但符合基金合同规定。

4.9 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，基金托管人在海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，海富通基金管理有限公司在海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

毕马威华振审字第 2501876 号

海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了后附的海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表、2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“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编制，公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

该基金管理人海富通基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3)评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4)对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情

况可能导致该基金不能持续经营。

(5)评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）　　中国注册会计师

虞京京　何晨

北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

2025 年 3 月 27 日

§7　年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资　产：			
货币资金	7.4.7.1	236,197.83	4,591,013.92
结算备付金		11,260,676.52	4,962,855.56
存出保证金		9,714,589.47	8,090,727.48
交易性金融资产	7.4.7.2	98,460,820.11	82,321,562.06
其中：股票投资		88,295,616.82	75,185,558.77
基金投资		-	-
债券投资		10,165,203.29	7,136,003.29
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	2,099,972.40	-
应收清算款		1,999,379.73	1,807,439.63
应收股利		-	-
应收申购款		1,438.00	10,464,680.61

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		123,773,074.06	112,238,279.26
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2024 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		5,999,689.87	5,999,477.26
应付清算款		1,222,366.82	1,509,479.05
应付赎回款		494,670.64	63,242.59
应付管理人报酬		133,368.65	130,688.66
应付托管费		22,228.11	21,781.47
应付销售服务费		24,296.06	14,727.32
应付投资顾问费		-	-
应交税费		94.65	50,921.16
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	489,880.10	651,959.95
负债合计		8,386,594.90	8,442,277.46
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	108,878,396.80	97,331,755.72
未分配利润	7.4.7.8	6,508,082.36	6,464,246.08
净资产合计		115,386,479.16	103,796,001.80
负债和净资产总计		123,773,074.06	112,238,279.26

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.0709 元，C 类基金份额净值 1.0496 元。基金份额总额 108,878,396.80 份，其中 A 类基金份额 51,886,365.49 份，C 类基金份额 56,992,031.31 份。

7.2 利润表

会计主体：海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-1,307,235.54	12,705,824.64
1.利息收入		495,030.26	386,529.19

其中：存款利息收入	7.4.7.9	312,281.32	303,889.17
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		182,748.94	82,640.02
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,375,913.20	7,342,124.83
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-3,424,971.25	4,416,203.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	207,011.41	218,029.30
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.12	-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	2,974,397.30	1,468,850.91
股利收益	7.4.7.14	3,619,475.74	1,239,041.19
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-5,812,818.09	4,841,802.38
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	634,639.09	135,368.24
减：二、营业总支出		3,926,261.09	3,111,393.79
1．管理人报酬		2,542,683.11	2,241,168.86
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2．托管费		423,780.52	373,528.19
3．销售服务费		636,037.87	251,082.62
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		41,953.10	31,910.18
其中：卖出回购金融资产支出		41,953.10	31,910.18
6. 信用减值损失		-	-
7．税金及附加		79,276.30	5,741.92
8．其他费用	7.4.7.17	202,530.19	207,962.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**-5,233,496.63**	**9,594,430.85**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**-5,233,496.63**	**9,594,430.85**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-5,233,496.63	9,594,430.85

7.3 净资产变动表

会计主体：海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	97,331,755.72	-	6,464,246.08	103,796,001.80
二、本期期初净资产	97,331,755.72	-	6,464,246.08	103,796,001.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	11,546,641.08	-	43,836.28	11,590,477.36
（一）、综合收益总额	-	-	-5,233,496.63	-5,233,496.63
（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）	11,546,641.08	-	5,277,332.91	16,823,973.99
其中：1.基金申购款	522,982,454.25	-	34,773,502.23	557,755,956.48
2.基金赎回款	-511,435,813.17	-	-29,496,169.32	-540,931,982.49
（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	108,878,396.80	-	6,508,082.36	115,386,479.16
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	308,402,215.61	-	6,141,887.86	314,544,103.47
二、本期期初净资产	308,402,215.61	-	6,141,887.86	314,544,103.47

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-211,070,459.89	-	322,358.22	-210,748,101.67
（一）、综合收益总额	-	-	9,594,430.85	9,594,430.85
（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）	-211,070,459.89	-	-9,272,072.63	-220,342,532.52
其中：1.基金申购款	101,705,970.44	-	4,447,929.12	106,153,899.56
2.基金赎回款	-312,776,430.33	-	-13,720,001.75	-326,496,432.08
（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	97,331,755.72	-	6,464,246.08	103,796,001.80

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金（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[2019]2887 号《关于准予海富通安益对冲策略灵活配置混合型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《海富通安益对冲策略灵活配置混合型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 2,757,795,773.42 元，其中海富通安益对冲混合 A 为人民币 2,359,044,097.42 元，海富通安益对冲混合 C 为人民币 398,751,676.00 元。经向中国证监会备案，《海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 1 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,758,124,517.00 份，

海富通安益对冲混合 A 基金份额总额为 2,359,336,836.26 份基金份额，其中认购资金利息折合 292,738.84 份基金份额，海富通安益对冲混合 C 基金份额总额为 398,787,680.74 份基金份额，其中认购资金利息折合 36,004.74 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围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或注册上市的股票）、港股通标的股票、存托凭证、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可交换债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、股指期货、股票期权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。本基金可参与融资及融券业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 0%-95%；投资银行存款和同业存单合计占比不超过基金资产的 20%；本基金权益类多头头寸价值减去权益类空头头寸价值，占基金资产净值比例范围 0-10%。其中，权益类多头头寸价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。权益空头头寸价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和股票期权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。本基金投资于港股通标的股票的比例范围为股票资产的 0-50%。本基金不受中国证监会 2010 年 4 月 21 日发布的证监会公告【2010】13 号《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第（一）项、第（三）项及第（五）项的限制。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。待基金投资其他品种的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并有效控制风险的前提下，经履行适当程序后，参与该类业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时，基金参与相

应投资品种或业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项，将按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行。本基金的业绩比较基准为：中国人民银行公布的同期三年期定期存款基准利率（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 2025 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金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<年度报告和中期报告>》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。

7.4.3 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 7.4.2 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 12 月 31 日的财务状况、2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a)金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、资产支持证券投资、衍生工具、买入返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b)金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债 (含属于金融负债的衍生工具) 和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a)金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其

变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b)后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失 (包括利息和股利收入) 计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失 (包括利息费用) 计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c)金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和 报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指

对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金各类份额默认的收益分配方式是现金分红；本基金不同份额类别基金份额，其分红方式相互独立、互不影响；投资者不同基金交易账户设置的基金分红方式相互独立、互不影响；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某一类基金份额净值减去该类份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。法律法规或监管机构另有规定的或在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分

部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财税[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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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 号文《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 号文《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》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告 2019 年第 93 号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2014〕81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对证券投资基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联合交易所有限公司（以下简称“香港联交所”）上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

(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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与香港联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(e)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日

活期存款	236,197.83	4,591,013.92
等于：本金	235,724.02	4,590,073.29
加：应计利息	473.81	940.63
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	236,197.83	4,591,013.92

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		90,264,460.33	-	88,295,616.82	-1,968,843.51
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	10,017,900.00	153,603.29	10,165,203.29	-6,300.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	10,017,900.00	153,603.29	10,165,203.29	-6,300.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他		-	-	-	-
合计		100,282,360.33	153,603.29	98,460,820.11	-1,975,143.51
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		74,994,725.68	-	75,185,558.77	190,833.09
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,011,760.00	135,303.29	7,136,003.29	-11,060.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,011,760.00	135,303.29	7,136,003.29	-11,060.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		82,006,485.68	135,303.29	82,321,562.06	179,773.09

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 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 12 月 31 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	-77,086,081.58	-	-	-
——股指期货	-77,086,081.58	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-77,086,081.58	-	-	-

项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日		
	合同/名义	公允价值	备注

	金额	资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-67,593,303.07	-	-	-
——股指期货	-67,593,303.07	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-67,593,303.07	-	-	-

7.4.7.3.2 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
IM2506	IM2506	-1.00	-1,151,280.00	23,200.00
IM2503	IM2503	-67.00	-78,810,760.00	-2,899,158.42
合计	-	-	-	-2,875,958.42
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-2,875,958.42
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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,099,972.40	-
银行间市场	-	-
合计	2,099,972.40	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末其他资产无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.14	1.75
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	324,879.96	481,958.20
其中：交易所市场	324,879.96	481,958.20
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	165,000.00	170,000.00
合计	489,880.10	651,959.95

7.4.7.7 实收基金

海富通安益对冲混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	51,744,696.53	51,744,696.53
本期申购	28,328,857.81	28,328,857.81
本期赎回（以“-”号填列）	-28,187,188.85	-28,187,188.85
本期末	51,886,365.49	51,886,365.49

海富通安益对冲混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	45,587,059.19	45,587,059.19
本期申购	494,653,596.44	494,653,596.44
本期赎回（以“-”号填列）	-483,248,624.32	-483,248,624.32
本期末	56,992,031.31	56,992,031.31

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

海富通安益对冲混合 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	8,396,801.40	-4,544,380.63	3,852,420.77
本期期初	8,396,801.40	-4,544,380.63	3,852,420.77
本期利润	2,698,617.53	-2,723,000.00	-24,382.47
本期基金份额交易产生的变动数	-423,413.32	276,590.85	-146,822.47
其中：基金申购款	4,573,439.79	-2,682,412.39	1,891,027.40
基金赎回款	-4,996,853.11	2,959,003.24	-2,037,849.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,672,005.61	-6,990,789.78	3,681,215.83

海富通安益对冲混合 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	6,584,147.86	-3,972,322.55	2,611,825.31
本期期初	6,584,147.86	-3,972,322.55	2,611,825.31
本期利润	-2,119,296.07	-3,089,818.09	-5,209,114.16
本期基金份额交易产生的变动数	5,949,709.26	-525,553.88	5,424,155.38
其中：基金申购款	76,631,675.79	-43,749,200.96	32,882,474.83

基金赎回款	-70,681,966.53	43,223,647.08	-27,458,319.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,414,561.05	-7,587,694.52	2,826,866.53

7.4.7.9 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12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	57,447.01	61,125.94
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	250,276.13	237,731.61
其他	4,558.18	5,031.62
合计	312,281.32	303,889.17

7.4.7.10 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,597,458,549.84	1,330,713,680.80
减：卖出股票成本总额	2,595,902,874.86	1,323,072,303.89
减：交易费用	4,980,646.23	3,225,173.48
买卖股票差价收入	-3,424,971.25	4,416,203.43

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	221,429.13	159,602.03
债券投资收益——买卖债券（债转股及	-14,417.72	58,427.27

债券到期兑付）差价收入		
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	207,011.41	218,029.30

7.4.7.11.2 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12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	28,424,621.70	12,853,480.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	28,021,490.00	12,590,679.43
减：应计利息总额	417,549.42	203,933.17
减：交易费用	-	440.28
买卖债券差价收入	-14,417.72	58,427.27

7.4.7.12 贵金属投资收益

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股指期货投资收益（税前）	3,745,001.49	1,557,572.05
减:股指期货差价收入应缴纳增值税额	655,153.17	45,366.18
减：交易费用	115,451.02	43,354.96
合计	2,974,397.30	1,468,850.91

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日

股票投资产生的股利收益	3,619,475.74	1,239,041.19
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	3,619,475.74	1,239,041.19

7.4.7.15 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12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
1.交易性金融资产	-2,154,916.60	7,216,334.43
——股票投资	-2,159,676.60	7,206,151.71
——债券投资	4,760.00	10,182.72
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-3,657,901.49	-2,374,532.05
——权证投资	-	-
——股指期货	-3,657,901.49	-2,374,532.05
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	-5,812,818.09	4,841,802.38

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
基金赎回费收入	613,846.73	134,633.79
基金转换费收入	20,792.36	734.45
合计	634,639.09	135,368.24

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
审计费用	45,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	285.00	465.00
证券组合费	45.19	297.02
债券托管账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他费用	1,200.00	1,200.00
合计	202,530.19	207,962.02

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日出具《关于同意国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司并募集配套资金注册、核准国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司、海富通基金管理有限公司变更主要股东及实际控制人、富国基金管理有限公司变更主要股东、海通期货股份有限公司变更主要股东及实际控制人的批复》（证监许可〔2025〕96 号）核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持海富通基金管理有限公司股权亦归属于合并后的国泰君安，即合并后的国泰君安成为海富通基金管理有限公司的主要股东，上海国际集团有限公司成为海富通基金管理有限公司实际控制人。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
交通银行股份有限公司 (“交通银行”)	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

法国巴黎资产管理 BE 控股公司(BNP Paribas Asset Management BE Holding)	基金管理人的股东
上海富诚海富通资产管理有限公司	基金管理人的子公司
海富通基金管理有限公司("海富通")	基金管理人、注册登记机构、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，本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31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	1,029,082,530.23	19.76%	356,295,438.95	14.12%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

7.4.10.1.3 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12月31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	762,280.40	22.99%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的

		比例		比例
海通证券	267,317.73	14.43%	39,887.14	8.28%

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金管理人提供的证券投资研究服务等。

2.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。公司的该类佣金协议符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,542,683.11	2,241,168.86
其中：应支付销售机构的客户维护费	800,926.15	396,921.34
应支付基金管理人的净管理费	1,741,756.96	1,844,247.52

注：海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金的管理费率由 1.5%下调至 1.2%，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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	423,780.52	373,528.19

注：海富通安益对冲策略灵活配置混合型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。

7.4.10.2.3 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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通安益对冲混合A	海富通安益对冲混合C	合计
交通银行	-	3,468.24	3,468.24
海通证券	-	2,297.81	2,297.81
海富通	-	45,597.84	45,597.84
合计	-	51,363.89	51,363.89
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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通安益对冲混合A	海富通安益对冲混合C	合计
交通银行	-	3,721.78	3,721.78
海通证券	-	4,348.12	4,348.12
海富通	-	161,288.34	161,288.34
合计	-	169,358.24	169,358.24

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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C
报告期初持有的基金份额	19,218,738.86	-	49,218,738.86	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	30,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	19,218,738.86	-	19,218,738.86	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比	37.04%	-	37.14%	-

例				

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	236,197.83	57,447.01	4,591,013.92	61,125.94

7.4.10.7 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12月31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12月31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	芯联集成	网下发行	23,666	134,659.54

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发或增发证券而受约束的流通受限证券。

7.4.12.2 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
002252	上海莱士	2024-12-23	重大事项	7.22	2025-01-07	6.93	900	6,694.00	6,498.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 5,999,689.87 元，于 2025 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金，低于股票型基金，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。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。

7.4.13.2 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 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券（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。

7.4.13.2.1 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12月31日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,165,203.29	7,136,003.29
合计	10,165,203.29	7,136,003.29

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分一般为国债、政策性金融债、央票、无第三方评级机构评级的债券。

7.4.13.3 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 7.4.12 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。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	236,197.83	-	-	-	236,197.83
结算备付金	11,260,676.52	-	-	-	11,260,676.52
存出保证金	115,615.83	-	-	9,598,973.64	9,714,589.47
交易性金融资产	10,165,203.29	-	-	88,295,616.82	98,460,820.11
买入返售金融资产	2,099,972.40	-	-	-	2,099,972.40
应收清算款	-	-	-	1,999,379.73	1,999,379.73
应收申购款	-	-	-	1,438.00	1,438.00
资产总计	23,877,665.87	-	-	99,895,408.19	123,773,074.06

负债					
卖出回购金融资产款	5,999,689.87	-	-	-	5,999,689.87
应付清算款	-	-	-	1,222,366.82	1,222,366.82
应付赎回款	-	-	-	494,670.64	494,670.64
应付管理人报酬	-	-	-	133,368.65	133,368.65
应付托管费	-	-	-	22,228.11	22,228.11
应付销售服务费	-	-	-	24,296.06	24,296.06
应交税费	-	-	-	94.65	94.65
其他负债	-	-	-	489,880.10	489,880.10
负债总计	5,999,689.87	-	-	2,386,905.03	8,386,594.90
利率敏感度缺口	17,877,976.00	-	-	97,508,503.16	115,386,479.16
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	4,591,013.92	-	-	-	4,591,013.92
结算备付金	4,962,855.56	-	-	-	4,962,855.56
存出保证金	73,364.28	-	-	8,017,363.20	8,090,727.48
交易性金融资产	7,136,003.29	-	-	75,185,558.77	82,321,562.06
应收清算款	-	-	-	1,807,439.63	1,807,439.63
应收申购款	-	-	-	10,464,680.61	10,464,680.61
资产总计	16,763,237.05	-	-	95,475,042.21	112,238,279.26
负债					
卖出回购金融资产款	5,999,477.26	-	-	-	5,999,477.26
应付清算款	-	-	-	1,509,479.05	1,509,479.05
应付赎回款	-	-	-	63,242.59	63,242.59
应付管理人报酬	-	-	-	130,688.66	130,688.66
应付托管费	-	-	-	21,781.47	21,781.47
应付销售服务费	-	-	-	14,727.32	14,727.32
应交税费	-	-	-	50,921.16	50,921.16
其他负债	-	-	-	651,959.95	651,959.95

负债总计	5,999,477.26	-	-	2,442,800.20	8,442,277.46
利率敏感度缺口	10,763,759.79	-	-	93,032,242.01	103,796,001.80

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。

7.4.13.4.1.2 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12月31日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-4,133.69	-805.78
	市场利率下降 25 个基点	4,146.54	807.88

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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的股票、债券和股指期货，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。

本基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 0%- 95%；投资银行存款和同业存单合计占比不超过基金资产的 20%；本基金权益类多头头寸价值减去权益类空头头寸价值，占基金资产净值比例范围 0-10%。其中，权益类多头头寸价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合 计值。权益空头头寸价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和股票期权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。本基金投资于港股通标的股票的比例范围为股票资产的 0-50%。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。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。此外，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31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	88,295,616.82	76.52	75,185,558.77	72.44
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	88,295,616.82	76.52	75,185,558.77	72.44

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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12月31日	上年度末 2023年12月31日
	1.业绩比较基准上升 5%	61,941.22	60,370.52
	2.业绩比较基准下降 5%	-61,941.22	-60,370.52

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	88,289,118.82	75,185,558.77
第二层次	10,171,701.29	7,136,003.29
第三层次	-	-
合计	98,460,820.11	82,321,562.06

7.4.14.2.2 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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的	-	-	-

利得或损失			
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	777,649.68	777,649.68
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	187,070.59	187,070.59
转出第三层次	-	1,221,328.38	1,221,328.38
当期利得或损失总额	-	256,608.11	256,608.11
其中：计入损益的利得或损失	-	256,608.11	256,608.11
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：于2024年12月31日，本基金未持有第三层次的交易性金融资产（2023年12月31日：同）。于2024年度，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。(2023年度：从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资)。
计入损益的利得或损失计入利润表中的投资收益及公允价值变动损益项目。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(2023 年 12 月 31 日：无)。

7.4.14.4 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、买入返售金融资产、卖出回购金

融资产款和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 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，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	88,295,616.82	71.34
	其中：股票	88,295,616.82	71.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,165,203.29	8.21
	其中：债券	10,165,203.29	8.21
	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	2,099,972.40	1.70
	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	11,496,874.35	9.29
8	其他各项资产	11,715,407.20	9.47
9	合计	123,773,074.06	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	171,579.00	0.15

B	采矿业	1,162,925.75	1.01
C	制造业	55,248,624.52	47.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,343,889.25	2.03
E	建筑业	1,425,752.00	1.24
F	批发和零售业	1,868,957.00	1.62
G	交通运输、仓储和邮政业	2,793,258.56	2.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,983,483.42	8.65
J	金融业	6,188,234.25	5.36
K	房地产业	1,595,387.00	1.38
L	租赁和商务服务业	1,601,875.07	1.39
M	科学研究和技术服务业	1,271,198.00	1.10
N	水利、环境和公共设施管理业	801,322.00	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	582,290.00	0.50
R	文化、体育和娱乐业	1,256,841.00	1.09
S	综合	-	-
	合计	88,295,616.82	76.52

8.2.2 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。

8.3 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	601211	国泰君安	64,700	1,206,655.00	1.05
2	600519	贵州茅台	500	762,000.00	0.66
3	600718	东软集团	68,941	742,494.57	0.64
4	000690	宝新能源	157,300	704,704.00	0.61
5	300627	华测导航	16,800	702,240.00	0.61
6	600320	振华重工	176,600	692,272.00	0.60
7	600572	康恩贝	147,400	686,884.00	0.60

8	600330	天通股份	96,000	681,600.00	0.59
9	300773	拉卡拉	37,200	658,440.00	0.57
10	002498	汉缆股份	194,200	658,338.00	0.57
11	002967	广电计量	39,300	644,520.00	0.56
12	300045	华力创通	30,400	635,056.00	0.55
13	002745	木林森	71,100	619,992.00	0.54
14	600266	城建发展	120,300	613,530.00	0.53
15	603358	华达科技	18,200	607,880.00	0.53
16	601801	皖新传媒	81,900	601,146.00	0.52
17	688586	江航装备	62,700	600,039.00	0.52
18	600648	外高桥	50,200	597,882.00	0.52
19	000881	中广核技	80,700	591,531.00	0.51
20	002003	伟星股份	40,900	579,553.00	0.50
21	002534	西子洁能	51,900	576,609.00	0.50
22	600633	浙数文化	55,000	575,300.00	0.50
23	000062	深圳华强	25,500	571,200.00	0.50
24	603055	台华新材	51,500	570,620.00	0.49
25	300457	赢合科技	29,800	570,372.00	0.49
26	002901	大博医疗	18,400	567,456.00	0.49
27	300143	盈康生命	60,700	558,440.00	0.48
28	002851	麦格米特	9,000	553,140.00	0.48
29	000676	智度股份	65,200	551,592.00	0.48
30	301327	华宝新能	7,100	544,641.00	0.47
31	300083	创世纪	82,900	539,679.00	0.47
32	002807	江阴银行	123,800	538,530.00	0.47
33	301260	格力博	40,500	536,625.00	0.47
34	002726	龙大美食	67,700	536,184.00	0.46
35	301389	隆扬电子	31,900	533,368.00	0.46
36	601975	招商南油	168,000	525,840.00	0.46
37	600210	紫江企业	77,400	511,614.00	0.44
38	300035	中科电气	34,100	509,795.00	0.44
39	601333	广深铁路	148,300	508,669.00	0.44
40	002100	天康生物	77,500	507,625.00	0.44
41	000650	仁和药业	87,200	502,272.00	0.44
42	300123	亚光科技	84,000	487,200.00	0.42
43	300735	光弘科技	17,100	478,629.00	0.41
44	300346	南大光电	12,300	474,657.00	0.41
45	002063	远光软件	82,000	472,320.00	0.41
46	688428	诺诚健华	38,000	466,640.00	0.40
47	600328	中盐化工	58,300	458,821.00	0.40
48	600908	无锡银行	77,200	456,252.00	0.40
49	002446	盛路通信	69,600	455,880.00	0.40
50	600409	三友化工	83,800	452,520.00	0.39
51	000917	电广传媒	64,000	452,480.00	0.39

52	600563	法拉电子	3,700	440,004.00	0.38
53	600388	龙净环保	34,600	437,690.00	0.38
54	300679	电连技术	7,300	435,810.00	0.38
55	000333	美的集团	5,775	434,395.50	0.38
56	600757	长江传媒	44,600	426,822.00	0.37
57	002183	怡亚通	94,900	426,101.00	0.37
58	002511	中顺洁柔	62,100	422,901.00	0.37
59	688106	金宏气体	24,400	415,044.00	0.36
60	601369	陕鼓动力	47,578	413,928.60	0.36
61	600888	新疆众和	57,481	408,115.10	0.35
62	600246	万通发展	54,300	404,535.00	0.35
63	000503	国新健康	36,400	399,672.00	0.35
64	300339	润和软件	7,800	390,234.00	0.34
65	300598	诚迈科技	8,000	387,200.00	0.34
66	688128	中国电研	18,400	386,584.00	0.34
67	301377	鼎泰高科	18,200	384,930.00	0.33
68	600664	哈药股份	92,800	383,264.00	0.33
69	300737	科顺股份	75,300	381,771.00	0.33
70	000552	甘肃能化	137,800	378,950.00	0.33
71	688381	帝奥微	19,500	375,960.00	0.33
72	688161	威高骨科	14,900	375,778.00	0.33
73	603995	甬金股份	20,100	367,629.00	0.32
74	300951	博硕科技	12,200	364,414.00	0.32
75	000528	柳工	30,192	364,115.52	0.32
76	603009	北特科技	9,200	359,536.00	0.31
77	300502	新易盛	3,100	358,298.00	0.31
78	603301	振德医疗	16,122	354,522.78	0.31
79	000567	海德股份	51,700	353,111.00	0.31
80	601318	中国平安	6,700	352,755.00	0.31
81	301339	通行宝	17,300	351,882.00	0.30
82	600866	星湖科技	54,300	351,321.00	0.30
83	002456	欧菲光	29,300	351,014.00	0.30
84	300750	宁德时代	1,300	345,800.00	0.30
85	300121	阳谷华泰	28,600	345,774.00	0.30
86	688037	芯源微	4,100	342,883.00	0.30
87	600036	招商银行	8,675	340,927.50	0.30
88	000875	吉电股份	63,200	332,432.00	0.29
89	688007	光峰科技	22,400	331,296.00	0.29
90	000603	盛达资源	27,500	329,725.00	0.29
91	603093	南华期货	27,700	329,630.00	0.29
92	002261	拓维信息	17,700	324,087.00	0.28
93	688019	安集科技	2,300	320,528.00	0.28
94	300379	东方通	21,200	319,908.00	0.28
95	600602	云赛智联	19,600	310,072.00	0.27

96	603355	莱克电气	13,600	308,040.00	0.27
97	002645	华宏科技	44,100	300,762.00	0.26
98	688517	金冠电气	22,100	299,676.00	0.26
99	688568	中科星图	5,800	295,974.00	0.26
100	600575	淮河能源	73,148	290,397.56	0.25
101	300181	佐力药业	18,900	290,304.00	0.25
102	300827	上能电气	6,600	289,740.00	0.25
103	300674	宇信科技	14,800	288,896.00	0.25
104	603730	岱美股份	32,000	287,680.00	0.25
105	300232	洲明科技	41,600	285,792.00	0.25
106	300583	赛托生物	14,600	285,430.00	0.25
107	300036	超图软件	16,500	280,170.00	0.24
108	300082	奥克股份	44,600	279,642.00	0.24
109	000970	中科三环	26,900	278,953.00	0.24
110	002705	新宝股份	18,100	271,500.00	0.24
111	600662	外服控股	53,301	270,236.07	0.23
112	300327	中颖电子	11,000	269,170.00	0.23
113	003006	百亚股份	11,200	268,688.00	0.23
114	601827	三峰环境	31,200	267,696.00	0.23
115	688232	新点软件	9,200	266,708.00	0.23
116	603323	苏农银行	50,100	265,029.00	0.23
117	300115	长盈精密	16,100	261,464.00	0.23
118	300685	艾德生物	11,300	257,640.00	0.22
119	002475	立讯精密	6,300	256,788.00	0.22
120	300663	科蓝软件	14,700	255,192.00	0.22
121	600929	雪天盐业	45,400	253,786.00	0.22
122	600552	凯盛科技	22,000	251,020.00	0.22
123	002948	青岛银行	62,100	240,948.00	0.21
124	603888	新华网	10,700	239,038.00	0.21
125	600366	宁波韵升	32,300	237,728.00	0.21
126	300119	瑞普生物	12,700	233,299.00	0.20
127	002081	金螳螂	65,000	232,050.00	0.20
128	300409	道氏技术	16,700	227,287.00	0.20
129	002020	京新药业	17,600	225,280.00	0.20
130	301050	雷电微力	4,300	221,794.00	0.19
131	002567	唐人神	43,400	221,340.00	0.19
132	001309	德明利	2,500	218,000.00	0.19
133	300776	帝尔激光	3,400	216,172.00	0.19
134	002011	盾安环境	19,200	207,552.00	0.18
135	002399	海普瑞	19,100	204,179.00	0.18
136	688105	诺唯赞	9,200	203,964.00	0.18
137	300443	金雷股份	10,200	203,184.00	0.18
138	300088	长信科技	30,700	200,778.00	0.17
139	301078	孩子王	17,500	199,150.00	0.17

140	688328	深科达	13,077	195,893.46	0.17
141	002839	张家港行	44,400	194,028.00	0.17
142	301216	万凯新材	19,000	193,800.00	0.17
143	688337	普源精电	4,900	191,100.00	0.17
144	002928	华夏航空	24,500	190,120.00	0.16
145	601677	明泰铝业	15,700	188,871.00	0.16
146	605499	东鹏饮料	735	182,662.20	0.16
147	000869	张裕 A	7,800	180,882.00	0.16
148	300031	宝通科技	9,800	179,536.00	0.16
149	002911	佛燃能源	14,200	179,488.00	0.16
150	600166	福田汽车	71,400	179,214.00	0.16
151	000063	中兴通讯	4,400	177,760.00	0.15
152	002380	科远智慧	9,600	177,408.00	0.15
153	002027	分众传媒	25,200	177,156.00	0.15
154	601899	紫金矿业	11,700	176,904.00	0.15
155	688526	科前生物	12,200	174,338.00	0.15
156	688510	航亚科技	10,000	174,200.00	0.15
157	603105	芯能科技	19,200	172,992.00	0.15
158	605005	合兴股份	10,600	172,780.00	0.15
159	002088	鲁阳节能	13,500	172,665.00	0.15
160	000719	中原传媒	15,100	171,536.00	0.15
161	601886	江河集团	31,500	170,100.00	0.15
162	688026	洁特生物	13,000	166,790.00	0.14
163	603881	数据港	7,300	165,345.00	0.14
164	688148	芳源股份	33,400	165,330.00	0.14
165	600623	华谊集团	23,200	162,400.00	0.14
166	300010	豆神教育	26,100	162,081.00	0.14
167	601390	中国中铁	25,200	161,028.00	0.14
168	688315	诺禾致源	12,800	160,000.00	0.14
169	601877	正泰电器	6,800	159,188.00	0.14
170	002206	海利得	36,800	157,872.00	0.14
171	300757	罗博特科	700	157,724.00	0.14
172	000682	东方电子	14,700	157,437.00	0.14
173	002130	沃尔核材	6,200	156,550.00	0.14
174	688126	沪硅产业	8,300	156,206.00	0.14
175	688268	华特气体	3,400	156,128.00	0.14
176	600048	保利发展	17,500	155,050.00	0.13
177	601778	晶科科技	54,800	154,536.00	0.13
178	600105	永鼎股份	31,100	154,256.00	0.13
179	002611	东方精工	15,800	154,050.00	0.13
180	600456	宝钛股份	5,400	153,630.00	0.13
181	002273	水晶光电	6,900	153,318.00	0.13
182	000951	中国重汽	9,000	152,820.00	0.13
183	301039	中集车辆	16,800	152,040.00	0.13

184	600323	瀚蓝环境	6,400	151,168.00	0.13
185	000651	格力电器	3,325	151,121.25	0.13
186	600887	伊利股份	5,000	150,900.00	0.13
187	603823	百合花	16,200	150,660.00	0.13
188	601288	农业银行	28,200	150,588.00	0.13
189	002415	海康威视	4,900	150,430.00	0.13
190	002389	航天彩虹	8,300	149,815.00	0.13
191	600562	国睿科技	7,400	147,482.00	0.13
192	601528	瑞丰银行	26,000	146,380.00	0.13
193	601766	中国中车	17,300	144,974.00	0.13
194	000948	南天信息	8,600	143,878.00	0.12
195	000035	中国天楹	29,300	142,691.00	0.12
196	600219	南山铝业	36,025	140,857.75	0.12
197	000928	中钢国际	21,600	137,592.00	0.12
198	002968	新大正	14,900	137,229.00	0.12
199	300059	东方财富	5,300	136,846.00	0.12
200	000858	五粮液	950	133,038.00	0.12
201	002428	云南锗业	7,000	132,300.00	0.11
202	300438	鹏辉能源	4,700	132,117.00	0.11
203	601117	中国化学	15,900	131,811.00	0.11
204	000725	京东方 A	29,975	131,590.25	0.11
205	000913	钱江摩托	7,300	131,473.00	0.11
206	600406	国电南瑞	5,200	131,144.00	0.11
207	688176	亚虹医药	19,000	129,010.00	0.11
208	688015	交控科技	6,500	128,895.00	0.11
209	603986	兆易创新	1,200	128,160.00	0.11
210	600273	嘉化能源	16,000	127,520.00	0.11
211	688041	海光信息	850	127,321.50	0.11
212	601888	中国中免	1,900	127,319.00	0.11
213	600900	长江电力	4,300	127,065.00	0.11
214	002126	银轮股份	6,787	127,052.64	0.11
215	300433	蓝思科技	5,800	127,020.00	0.11
216	600850	电科数字	5,300	126,670.00	0.11
217	600305	恒顺醋业	15,700	125,286.00	0.11
218	600459	贵研铂业	9,100	124,943.00	0.11
219	600383	金地集团	28,100	123,078.00	0.11
220	002245	蔚蓝锂芯	11,400	121,866.00	0.11
221	600660	福耀玻璃	1,950	121,680.00	0.11
222	300026	红日药业	31,900	120,901.00	0.10
223	002548	金新农	30,400	120,688.00	0.10
224	600821	金开新能	22,300	120,420.00	0.10
225	688518	联赢激光	7,600	120,384.00	0.10
226	601919	中远海控	7,725	119,737.50	0.10
227	300408	三环集团	3,100	119,381.00	0.10

228	688050	爱博医疗	1,300	118,339.00	0.10
229	300315	掌趣科技	21,400	117,700.00	0.10
230	688660	电气风电	12,900	116,100.00	0.10
231	000902	新洋丰	8,900	116,056.00	0.10
232	300498	温氏股份	6,900	113,919.00	0.10
233	002275	桂林三金	7,500	113,175.00	0.10
234	002594	比亚迪	400	113,064.00	0.10
235	603005	晶方科技	4,000	113,000.00	0.10
236	002142	宁波银行	4,600	111,826.00	0.10
237	601600	中国铝业	15,100	110,985.00	0.10
238	600809	山西汾酒	600	110,526.00	0.10
239	600916	中国黄金	12,700	109,474.00	0.09
240	601101	昊华能源	13,200	108,636.00	0.09
241	000938	紫光股份	3,900	108,537.00	0.09
242	002091	江苏国泰	14,800	108,336.00	0.09
243	601567	三星医疗	3,500	107,660.00	0.09
244	000543	皖能电力	13,600	107,576.00	0.09
245	002180	纳思达	3,700	104,229.00	0.09
246	300253	卫宁健康	14,500	103,820.00	0.09
247	603993	洛阳钼业	15,600	103,740.00	0.09
248	300274	阳光电源	1,400	103,362.00	0.09
249	300034	钢研高纳	6,600	102,960.00	0.09
250	600037	歌华有线	13,800	102,948.00	0.09
251	688122	西部超导	2,400	102,768.00	0.09
252	300570	太辰光	1,400	101,780.00	0.09
253	300762	上海瀚讯	4,800	100,944.00	0.09
254	600475	华光环能	11,200	100,912.00	0.09
255	002236	大华股份	6,200	99,200.00	0.09
256	000012	南玻 A	18,600	98,208.00	0.09
257	601163	三角轮胎	6,500	97,955.00	0.08
258	002371	北方华创	250	97,750.00	0.08
259	688608	恒玄科技	300	97,611.00	0.08
260	601398	工商银行	14,100	97,572.00	0.08
261	000999	华润三九	2,200	97,548.00	0.08
262	600399	抚顺特钢	16,800	97,440.00	0.08
263	603308	应流股份	6,900	97,290.00	0.08
264	002222	福晶科技	3,000	97,200.00	0.08
265	000089	深圳机场	13,800	95,082.00	0.08
266	002668	TCL 智家	7,200	94,464.00	0.08
267	600248	陕建股份	20,900	93,632.00	0.08
268	688116	天奈科技	2,400	93,144.00	0.08
269	601658	邮储银行	16,300	92,584.00	0.08
270	000795	英洛华	9,400	91,462.00	0.08
271	600269	赣粤高速	16,300	91,443.00	0.08

272	000807	云铝股份	6,675	90,312.75	0.08
273	002701	奥瑞金	15,700	89,019.00	0.08
274	300655	晶瑞电材	9,400	87,984.00	0.08
275	300618	寒锐钴业	2,600	87,802.00	0.08
276	000001	平安银行	7,500	87,750.00	0.08
277	688408	中信博	1,200	86,400.00	0.07
278	002416	爱施德	5,300	86,231.00	0.07
279	300002	神州泰岳	7,400	85,766.00	0.07
280	601111	中国国航	10,800	85,428.00	0.07
281	600059	古越龙山	9,600	85,248.00	0.07
282	601107	四川成渝	16,200	84,726.00	0.07
283	000090	天健集团	20,600	84,666.00	0.07
284	000680	山推股份	8,700	84,390.00	0.07
285	300768	迪普科技	4,800	84,000.00	0.07
286	688248	南网科技	2,600	83,434.00	0.07
287	601169	北京银行	13,425	82,563.75	0.07
288	600312	平高电气	4,300	82,560.00	0.07
289	002578	闽发铝业	27,400	81,926.00	0.07
290	600502	安徽建工	17,100	81,738.00	0.07
291	000829	天音控股	6,200	81,716.00	0.07
292	601137	博威合金	4,000	81,200.00	0.07
293	600507	方大特钢	19,900	80,595.00	0.07
294	000036	华联控股	19,500	79,560.00	0.07
295	688389	普门科技	5,300	78,917.00	0.07
296	600372	中航机载	6,400	78,912.00	0.07
297	688078	龙软科技	3,000	78,630.00	0.07
298	000582	北部湾港	9,900	78,012.00	0.07
299	603871	嘉友国际	4,020	77,787.00	0.07
300	688409	富创精密	1,500	77,355.00	0.07
301	002237	恒邦股份	7,600	76,760.00	0.07
302	300463	迈克生物	5,800	76,560.00	0.07
303	600362	江西铜业	3,700	76,368.00	0.07
304	600063	皖维高新	19,000	76,000.00	0.07
305	601728	中国电信	10,500	75,810.00	0.07
306	000895	双汇发展	2,900	75,284.00	0.07
307	601200	上海环境	9,200	75,164.00	0.07
308	002544	普天科技	3,500	75,005.00	0.07
309	603766	隆鑫通用	8,200	74,620.00	0.06
310	601231	环旭电子	4,500	74,250.00	0.06
311	001301	尚太科技	1,082	74,171.10	0.06
312	601319	中国人保	9,650	73,533.00	0.06
313	002139	拓邦股份	5,400	73,494.00	0.06
314	603501	韦尔股份	700	73,087.00	0.06
315	002215	诺普信	6,500	72,995.00	0.06

316	002938	鹏鼎控股	2,000	72,960.00	0.06
317	000776	广发证券	4,500	72,945.00	0.06
318	300054	鼎龙股份	2,800	72,856.00	0.06
319	002837	英维克	1,800	72,720.00	0.06
320	600461	洪城环境	7,300	72,635.00	0.06
321	601601	中国太保	2,100	71,568.00	0.06
322	002539	云图控股	9,100	71,162.00	0.06
323	600941	中国移动	600	70,896.00	0.06
324	600428	中远海特	9,700	70,810.00	0.06
325	600186	莲花控股	12,300	70,110.00	0.06
326	600030	中信证券	2,400	70,008.00	0.06
327	601126	四方股份	4,100	69,536.00	0.06
328	002815	崇达技术	6,800	69,360.00	0.06
329	600420	国药现代	5,800	69,252.00	0.06
330	603288	海天味业	1,500	68,850.00	0.06
331	002635	安洁科技	4,300	68,456.00	0.06
332	300284	苏交科	6,700	68,005.00	0.06
333	603368	柳药集团	3,800	67,868.00	0.06
334	000429	粤高速 A	4,600	67,620.00	0.06
335	600050	中国联通	12,725	67,569.75	0.06
336	300747	锐科激光	3,500	67,060.00	0.06
337	000568	泸州老窖	525	65,730.00	0.06
338	688018	乐鑫科技	301	65,618.00	0.06
339	688052	纳芯微	500	65,150.00	0.06
340	300857	协创数据	600	64,134.00	0.06
341	688596	正帆科技	1,800	63,990.00	0.06
342	002461	珠江啤酒	6,400	63,296.00	0.05
343	600211	西藏药业	1,700	62,798.00	0.05
344	688200	华峰测控	600	62,700.00	0.05
345	000538	云南白药	1,040	62,348.00	0.05
346	601229	上海银行	6,800	62,220.00	0.05
347	688289	圣湘生物	2,700	61,290.00	0.05
348	603638	艾迪精密	3,600	60,804.00	0.05
349	600073	光明肉业	8,700	60,378.00	0.05
350	600015	华夏银行	7,500	60,075.00	0.05
351	002174	游族网络	6,400	59,840.00	0.05
352	600958	东方证券	5,575	58,872.00	0.05
353	601009	南京银行	5,500	58,575.00	0.05
354	600926	杭州银行	4,000	58,440.00	0.05
355	002458	益生股份	6,000	57,660.00	0.05
356	300661	圣邦股份	700	57,246.00	0.05
357	000977	浪潮信息	1,100	57,068.00	0.05
358	000848	承德露露	6,300	56,511.00	0.05
359	600116	三峡水利	8,000	55,920.00	0.05

360	600025	华能水电	5,875	55,871.25	0.05
361	000166	申万宏源	10,400	55,640.00	0.05
362	605333	沪光股份	1,700	55,471.00	0.05
363	603997	继峰股份	4,800	54,960.00	0.05
364	000672	上峰水泥	7,100	54,315.00	0.05
365	600667	太极实业	7,800	53,976.00	0.05
366	600019	宝钢股份	7,700	53,900.00	0.05
367	601998	中信银行	7,700	53,746.00	0.05
368	300738	奥飞数据	3,700	53,650.00	0.05
369	000498	山东路桥	8,900	52,955.00	0.05
370	600782	新钢股份	15,800	52,772.00	0.05
371	002001	新和成	2,400	52,728.00	0.05
372	601311	骆驼股份	6,300	52,227.00	0.05
373	300406	九强生物	3,900	52,104.00	0.05
374	601901	方正证券	6,200	51,646.00	0.04
375	603713	密尔克卫	1,000	51,200.00	0.04
376	300151	昌红科技	3,000	51,000.00	0.04
377	300760	迈瑞医疗	200	51,000.00	0.04
378	688208	道通科技	1,300	50,908.00	0.04
379	600020	中原高速	11,900	50,218.00	0.04
380	600018	上港集团	8,200	50,184.00	0.04
381	600029	南方航空	7,700	49,973.00	0.04
382	688266	泽璟制药	800	49,848.00	0.04
383	601138	工业富联	2,300	49,450.00	0.04
384	000049	德赛电池	2,100	49,371.00	0.04
385	002060	广东建工	13,400	49,044.00	0.04
386	000338	潍柴动力	3,575	48,977.50	0.04
387	601618	中国中冶	14,700	48,510.00	0.04
388	001213	中铁特货	11,600	48,372.00	0.04
389	300415	伊之密	2,400	48,144.00	0.04
390	600874	创业环保	8,000	47,760.00	0.04
391	002434	万里扬	7,700	47,740.00	0.04
392	300496	中科创达	800	47,648.00	0.04
393	300624	万兴科技	750	47,362.50	0.04
394	600196	复星医药	1,900	47,215.00	0.04
395	002555	三七互娱	3,000	46,920.00	0.04
396	600233	圆通速递	3,300	46,827.00	0.04
397	600640	国脉文化	3,900	46,566.00	0.04
398	688789	宏华数科	700	46,466.00	0.04
399	600332	白云山	1,600	45,472.00	0.04
400	600750	江中药业	2,000	45,400.00	0.04
401	601377	兴业证券	7,200	45,072.00	0.04
402	600875	东方电气	2,800	44,492.00	0.04
403	600012	皖通高速	2,500	44,125.00	0.04

404	688109	品茗科技	1,800	44,118.00	0.04
405	600999	招商证券	2,300	44,068.00	0.04
406	601668	中国建筑	7,300	43,800.00	0.04
407	300726	宏达电子	1,400	43,540.00	0.04
408	688100	威胜信息	1,200	43,440.00	0.04
409	605376	博迁新材	1,500	43,425.00	0.04
410	600452	涪陵电力	4,100	43,419.00	0.04
411	601989	中国重工	9,000	43,290.00	0.04
412	688183	生益电子	1,100	43,186.00	0.04
413	002036	联创电子	4,500	42,300.00	0.04
414	300525	博思软件	2,700	42,066.00	0.04
415	002506	协鑫集成	15,700	41,919.00	0.04
416	600893	航发动力	1,000	41,450.00	0.04
417	600163	中闽能源	6,800	41,412.00	0.04
418	002588	史丹利	5,600	41,328.00	0.04
419	300366	创意信息	4,400	40,920.00	0.04
420	600183	生益科技	1,700	40,885.00	0.04
421	301291	明阳电气	900	39,528.00	0.03
422	000876	新希望	4,400	39,512.00	0.03
423	603567	珍宝岛	3,400	39,440.00	0.03
424	603169	兰石重装	7,200	39,240.00	0.03
425	600688	上海石化	12,900	38,958.00	0.03
426	600458	时代新材	3,000	38,430.00	0.03
427	601166	兴业银行	2,000	38,320.00	0.03
428	600161	天坛生物	1,850	37,925.00	0.03
429	688012	中微公司	200	37,832.00	0.03
430	300811	铂科新材	700	37,737.00	0.03
431	300303	聚飞光电	5,500	37,510.00	0.03
432	601669	中国电建	6,800	37,128.00	0.03
433	001872	招商港口	1,800	36,846.00	0.03
434	688190	云路股份	400	36,800.00	0.03
435	601555	东吴证券	4,700	36,660.00	0.03
436	600061	国投资本	4,800	36,096.00	0.03
437	002171	楚江新材	4,400	36,080.00	0.03
438	600595	中孚实业	12,700	35,941.00	0.03
439	603693	江苏新能	3,600	35,460.00	0.03
440	688503	聚和材料	800	35,432.00	0.03
441	603920	世运电路	1,200	35,280.00	0.03
442	600216	浙江医药	2,200	34,892.00	0.03
443	601006	大秦铁路	5,125	34,747.50	0.03
444	601921	浙版传媒	4,400	34,672.00	0.03
445	002706	良信股份	4,500	34,560.00	0.03
446	300428	立中集团	2,100	34,230.00	0.03
447	688083	中望软件	400	34,228.00	0.03

448	002987	京北方	2,400	34,152.00	0.03
449	301297	富乐德	800	34,000.00	0.03
450	603778	国晟科技	11,200	33,936.00	0.03
451	002108	沧州明珠	9,400	33,746.00	0.03
452	300236	上海新阳	900	33,633.00	0.03
453	600710	苏美达	3,600	33,480.00	0.03
454	600138	中青旅	3,300	33,462.00	0.03
455	300702	天宇股份	2,000	33,320.00	0.03
456	300910	瑞丰新材	700	33,313.00	0.03
457	000488	晨鸣纸业	10,900	33,245.00	0.03
458	603259	药明康德	600	33,024.00	0.03
459	000885	城发环境	2,500	32,775.00	0.03
460	603690	至纯科技	1,300	32,643.00	0.03
461	300770	新媒股份	800	32,328.00	0.03
462	002233	塔牌集团	4,200	32,214.00	0.03
463	600639	浦东金桥	2,900	32,190.00	0.03
464	600905	三峡能源	7,300	31,901.00	0.03
465	603609	禾丰股份	3,700	31,894.00	0.03
466	688279	峰岹科技	200	31,540.00	0.03
467	600064	南京高科	4,000	31,080.00	0.03
468	603588	高能环境	5,900	30,916.00	0.03
469	688262	国芯科技	1,100	30,470.00	0.03
470	601868	中国能建	13,000	29,770.00	0.03
471	600548	深高速	2,200	29,656.00	0.03
472	600500	中化国际	7,200	28,944.00	0.03
473	603556	海兴电力	775	28,667.25	0.02
474	603279	景津装备	1,600	28,608.00	0.02
475	600085	同仁堂	700	28,413.00	0.02
476	002468	申通快递	2,800	28,364.00	0.02
477	301087	可孚医疗	800	28,288.00	0.02
478	300166	东方国信	3,000	28,200.00	0.02
479	002034	旺能环境	1,800	27,900.00	0.02
480	600259	广晟有色	1,000	27,810.00	0.02
481	002906	华阳集团	900	27,675.00	0.02
482	300820	英杰电气	500	27,625.00	0.02
483	002773	康弘药业	1,395	27,342.00	0.02
484	603496	恒为科技	1,000	27,180.00	0.02
485	605507	国邦医药	1,300	27,079.00	0.02
486	300705	九典制药	1,500	26,925.00	0.02
487	600587	新华医疗	1,600	26,640.00	0.02
488	600596	新安股份	3,000	26,340.00	0.02
489	000821	京山轻机	2,100	26,145.00	0.02
490	600582	天地科技	4,175	25,801.50	0.02
491	603017	中衡设计	3,200	25,696.00	0.02

492	603267	鸿远电子	700	25,361.00	0.02
493	688187	时代电气	526	25,205.92	0.02
494	688403	汇成股份	2,800	25,088.00	0.02
495	002891	中宠股份	700	24,990.00	0.02
496	601336	新华保险	500	24,850.00	0.02
497	300308	中际旭创	200	24,702.00	0.02
498	600557	康缘药业	1,800	24,516.00	0.02
499	603699	纽威股份	1,100	24,387.00	0.02
500	600787	中储股份	3,800	24,244.00	0.02
501	688366	昊海生科	400	24,232.00	0.02
502	002777	久远银海	1,400	24,108.00	0.02
503	600901	江苏金租	4,600	24,012.00	0.02
504	300015	爱尔眼科	1,800	23,850.00	0.02
505	600262	北方股份	1,300	23,803.00	0.02
506	603100	川仪股份	1,100	23,705.00	0.02
507	600477	杭萧钢构	9,200	23,644.00	0.02
508	002179	中航光电	600	23,580.00	0.02
509	002929	润建股份	700	23,534.00	0.02
510	601952	苏垦农发	2,400	23,496.00	0.02
511	000060	中金岭南	5,000	23,450.00	0.02
512	603733	仙鹤股份	1,100	22,693.00	0.02
513	601900	南方传媒	1,500	22,665.00	0.02
514	688321	微芯生物	1,200	22,296.00	0.02
515	000156	华数传媒	3,000	21,600.00	0.02
516	301155	海力风电	400	21,324.00	0.02
517	002985	北摩高科	900	21,150.00	0.02
518	601890	亚星锚链	2,700	21,033.00	0.02
519	688192	迪哲医药	500	20,735.00	0.02
520	603876	鼎胜新材	2,300	20,355.00	0.02
521	300696	爱乐达	1,300	20,189.00	0.02
522	300446	航天智造	1,200	19,812.00	0.02
523	600961	株冶集团	2,500	19,675.00	0.02
524	600521	华海药业	1,100	19,657.00	0.02
525	000878	云南铜业	1,600	19,504.00	0.02
526	600987	航民股份	2,800	19,432.00	0.02
527	605368	蓝天燃气	1,700	19,431.00	0.02
528	600649	城投控股	4,300	19,135.00	0.02
529	603229	奥翔药业	1,900	18,981.00	0.02
530	688981	中芯国际	200	18,924.00	0.02
531	600223	福瑞达	2,500	18,900.00	0.02
532	000837	秦川机床	2,100	18,837.00	0.02
533	600195	中牧股份	2,800	18,788.00	0.02
534	300393	中来股份	3,000	18,750.00	0.02
535	301047	义翘神州	300	18,555.00	0.02

536	300286	安科瑞	900	18,495.00	0.02
537	600276	恒瑞医药	400	18,360.00	0.02
538	002051	中工国际	2,200	17,952.00	0.02
539	600882	妙可蓝多	1,000	17,900.00	0.02
540	688006	杭可科技	1,000	17,860.00	0.02
541	688631	莱斯信息	200	17,418.00	0.02
542	688326	经纬恒润	200	16,820.00	0.01
543	300226	上海钢联	700	16,009.00	0.01
544	000935	四川双马	1,100	15,928.00	0.01
545	603987	康德莱	2,200	15,796.00	0.01
546	688097	博众精工	600	15,750.00	0.01
547	601882	海天精工	700	15,351.00	0.01
548	300855	图南股份	700	15,344.00	0.01
549	001270	铖昌科技	400	15,240.00	0.01
550	688588	凌志软件	1,102	15,207.60	0.01
551	688206	概伦电子	800	15,128.00	0.01
552	600075	新疆天业	3,400	14,790.00	0.01
553	605599	菜百股份	1,200	13,620.00	0.01
554	601808	中海油服	875	13,343.75	0.01
555	002101	广东鸿图	1,100	13,178.00	0.01
556	002913	奥士康	500	12,055.00	0.01
557	300628	亿联网络	300	11,580.00	0.01
558	688658	悦康药业	800	11,528.00	0.01
559	000792	盐湖股份	700	11,522.00	0.01
560	300926	博俊科技	500	11,005.00	0.01
561	600990	四创电子	500	10,640.00	0.01
562	000157	中联重科	1,400	10,122.00	0.01
563	603132	金徽股份	900	10,107.00	0.01
564	600795	国电电力	2,200	10,076.00	0.01
565	600971	恒源煤电	1,000	9,410.00	0.01
566	002533	金杯电工	900	8,856.00	0.01
567	600115	中国东航	2,200	8,800.00	0.01
568	300373	扬杰科技	200	8,704.00	0.01
569	300285	国瓷材料	500	8,520.00	0.01
570	001308	康冠科技	300	8,250.00	0.01
571	300638	广和通	400	8,060.00	0.01
572	300129	泰胜风能	1,100	7,755.00	0.01
573	603866	桃李面包	1,000	6,600.00	0.01
574	002252	上海莱士	900	6,498.00	0.01
575	605222	起帆电缆	400	6,160.00	0.01
576	688523	航天环宇	300	6,000.00	0.01
577	601208	东材科技	600	4,524.00	0.00
578	601939	建设银行	500	4,395.00	0.00
579	000762	西藏矿业	200	4,300.00	0.00

580	002352	顺丰控股	100	4,030.00	0.00
581	601688	华泰证券	200	3,518.00	0.00
582	003816	中国广核	700	2,891.00	0.00
583	688009	中国通号	426	2,666.76	0.00
584	601222	林洋能源	100	707.00	0.00
585	688506	百利天恒	3	575.19	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	22,182,617.91	21.37
2	601318	中国平安	17,040,975.52	16.42
3	601398	工商银行	14,914,506.00	14.37
4	600036	招商银行	13,288,175.55	12.80
5	600900	长江电力	9,966,640.00	9.60
6	300750	宁德时代	9,756,862.60	9.40
7	601288	农业银行	9,112,693.00	8.78
8	600887	伊利股份	8,505,390.00	8.19
9	600050	中国联通	7,864,289.00	7.58
10	000725	京东方 A	7,273,534.00	7.01
11	600028	中国石化	7,242,375.70	6.98
12	600030	中信证券	7,084,965.45	6.83
13	601728	中国电信	7,070,272.00	6.81
14	601988	中国银行	6,954,077.00	6.70
15	601166	兴业银行	6,778,760.00	6.53
16	600919	江苏银行	6,495,017.00	6.26
17	688235	百济神州	6,210,602.79	5.98
18	601668	中国建筑	6,130,885.42	5.91
19	601138	工业富联	5,885,909.00	5.67
20	600406	国电南瑞	5,767,412.08	5.56
21	601899	紫金矿业	5,494,397.00	5.29
22	600276	恒瑞医药	5,480,532.20	5.28
23	600809	山西汾酒	5,460,449.00	5.26
24	00981	中芯国际	5,423,427.51	5.23
25	600577	精达股份	5,304,894.00	5.11
26	300303	聚飞光电	5,292,597.10	5.10
27	000333	美的集团	5,245,724.00	5.05

28	688161	威高骨科	5,226,635.18	5.04
29	002549	凯美特气	5,212,534.26	5.02
30	002015	协鑫能科	5,129,291.00	4.94
31	600667	太极实业	5,100,293.00	4.91
32	000568	泸州老窖	4,982,517.00	4.80
33	002063	远光软件	4,889,245.00	4.71
34	600690	海尔智家	4,772,668.00	4.60
35	000858	五粮液	4,760,526.00	4.59
36	002585	双星新材	4,733,838.00	4.56
37	601211	国泰君安	4,728,465.00	4.56
38	600491	龙元建设	4,686,929.00	4.52
39	002415	海康威视	4,681,499.00	4.51
40	002815	崇达技术	4,623,967.00	4.45
41	600601	方正科技	4,617,858.00	4.45
42	601677	明泰铝业	4,582,574.86	4.41
43	300476	胜宏科技	4,558,533.00	4.39
44	300408	三环集团	4,528,905.00	4.36
45	002048	宁波华翔	4,515,364.00	4.35
46	600330	天通股份	4,501,122.00	4.34
47	000100	TCL 科技	4,473,746.00	4.31
48	300573	兴齐眼药	4,469,871.20	4.31
49	002219	新里程	4,451,356.00	4.29
50	002475	立讯精密	4,436,653.00	4.27
51	300263	隆华科技	4,411,230.00	4.25
52	603169	兰石重装	4,410,877.00	4.25
53	300593	新雷能	4,378,093.00	4.22
54	300857	协创数据	4,322,117.00	4.16
55	601088	中国神华	4,310,855.00	4.15
56	600999	招商证券	4,283,671.50	4.13
57	300741	华宝股份	4,281,361.00	4.12
58	300587	天铁股份	4,243,086.86	4.09
59	688041	海光信息	4,230,130.93	4.08
60	600366	宁波韵升	4,206,460.00	4.05
61	603132	金徽股份	4,168,002.00	4.02
62	600105	永鼎股份	4,153,808.00	4.00
63	601137	博威合金	4,144,123.00	3.99
64	603123	翠微股份	4,119,389.00	3.97
65	000338	潍柴动力	4,115,906.00	3.97
66	600572	康恩贝	4,057,368.00	3.91
67	300083	创世纪	4,046,998.00	3.90
68	002291	遥望科技	4,038,509.00	3.89
69	688111	金山办公	4,005,193.61	3.86
70	688733	壹石通	3,980,927.76	3.84
71	603489	八方股份	3,910,914.00	3.77

72	002498	汉缆股份	3,893,640.92	3.75
73	002461	珠江啤酒	3,871,052.00	3.73
74	002027	分众传媒	3,864,102.00	3.72
75	688575	亚辉龙	3,860,960.30	3.72
76	000650	仁和药业	3,850,072.00	3.71
77	601989	中国重工	3,847,637.00	3.71
78	603328	依顿电子	3,843,116.00	3.70
79	601766	中国中车	3,807,401.00	3.67
80	688586	江航装备	3,802,300.56	3.66
81	688206	概伦电子	3,801,089.38	3.66
82	601333	广深铁路	3,799,849.27	3.66
83	600372	中航机载	3,792,902.89	3.65
84	300382	斯莱克	3,771,594.00	3.63
85	002851	麦格米特	3,770,836.00	3.63
86	300098	高新兴	3,768,306.54	3.63
87	600770	综艺股份	3,767,083.00	3.63
88	002202	金风科技	3,759,287.00	3.62
89	601600	中国铝业	3,736,624.00	3.60
90	002283	天润工业	3,736,334.00	3.60
91	688617	惠泰医疗	3,732,663.92	3.60
92	300080	易成新能	3,732,388.60	3.60
93	002434	万里扬	3,718,621.00	3.58
94	300887	谱尼测试	3,671,147.39	3.54
95	002745	木林森	3,669,848.00	3.54
96	000651	格力电器	3,640,501.00	3.51
97	688019	安集科技	3,632,638.87	3.50
98	002428	云南锗业	3,625,866.00	3.49
99	000795	英洛华	3,610,552.00	3.48
100	002239	奥特佳	3,607,443.00	3.48
101	300059	东方财富	3,601,518.00	3.47
102	603915	国茂股份	3,569,048.84	3.44
103	002099	海翔药业	3,560,768.00	3.43
104	301268	铭利达	3,531,258.00	3.40
105	002534	西子洁能	3,528,237.00	3.40
106	301015	百洋医药	3,511,686.00	3.38
107	603993	洛阳钼业	3,510,324.00	3.38
108	002555	三七互娱	3,502,460.00	3.37
109	600309	万华化学	3,498,942.00	3.37
110	000776	广发证券	3,496,838.00	3.37
111	000875	吉电股份	3,481,586.00	3.35
112	000528	柳工	3,477,401.00	3.35
113	002782	可立克	3,451,364.50	3.33
114	601857	中国石油	3,450,149.20	3.32
115	300775	三角防务	3,428,549.00	3.30

116	600575	淮河能源	3,426,457.00	3.30
117	002446	盛路通信	3,409,893.60	3.29
118	600795	国电电力	3,393,396.00	3.27
119	600893	航发动力	3,386,202.00	3.26
120	600660	福耀玻璃	3,381,549.00	3.26
121	300170	汉得信息	3,377,125.00	3.25
122	000727	冠捷科技	3,342,355.00	3.22
123	688315	诺禾致源	3,336,033.84	3.21
124	603569	长久物流	3,327,832.05	3.21
125	000560	我爱我家	3,317,328.00	3.20
126	300134	大富科技	3,317,023.00	3.20
127	002456	欧菲光	3,305,972.00	3.19
128	002724	海洋王	3,293,462.00	3.17
129	002038	双鹭药业	3,292,563.00	3.17
130	603005	晶方科技	3,280,624.48	3.16
131	601811	新华文轩	3,279,509.00	3.16
132	300674	宇信科技	3,277,326.68	3.16
133	300457	赢合科技	3,275,870.00	3.16
134	600025	华能水电	3,273,796.00	3.15
135	002594	比亚迪	3,272,086.00	3.15
136	002773	康弘药业	3,268,895.00	3.15
137	002043	兔宝宝	3,258,760.40	3.14
138	600312	平高电气	3,253,867.00	3.13
139	688289	圣湘生物	3,239,128.11	3.12
140	601311	骆驼股份	3,221,514.00	3.10
141	300123	亚光科技	3,215,587.00	3.10
142	000881	中广核技	3,212,316.00	3.09
143	300579	数字认证	3,209,961.00	3.09
144	600012	皖通高速	3,207,197.00	3.09
145	601669	中国电建	3,207,077.00	3.09
146	603105	芯能科技	3,198,483.00	3.08
147	002139	拓邦股份	3,195,446.06	3.08
148	600219	南山铝业	3,194,660.00	3.08
149	002001	新和成	3,181,357.74	3.07
150	002436	兴森科技	3,172,659.00	3.06
151	000837	秦川机床	3,114,449.00	3.00
152	600741	华域汽车	3,097,556.00	2.98
153	600320	振华重工	3,092,729.00	2.98
154	603393	新天然气	3,092,460.40	2.98
155	600718	东软集团	3,073,442.26	2.96
156	601688	华泰证券	3,070,232.00	2.96
157	002987	京北方	3,062,540.20	2.95
158	002519	银河电子	3,057,854.00	2.95
159	002276	万马股份	3,057,514.00	2.95

160	688380	中微半导	3,053,476.20	2.94
161	000950	重药控股	3,041,725.00	2.93
162	000969	安泰科技	3,039,781.00	2.93
163	000035	中国天楹	3,035,669.00	2.92
164	605376	博迁新材	3,025,387.00	2.91
165	300319	麦捷科技	3,012,998.00	2.90
166	603171	税友股份	3,009,718.00	2.90
167	600556	天下秀	3,004,469.00	2.89
168	002489	浙江永强	2,989,404.00	2.88
169	601777	力帆科技	2,987,683.36	2.88
170	300180	华峰超纤	2,985,251.00	2.88
171	600409	三友化工	2,979,574.15	2.87
172	000813	德展健康	2,979,331.00	2.87
173	603888	新华网	2,974,203.00	2.87
174	002697	红旗连锁	2,952,917.00	2.84
175	000682	东方电子	2,950,351.00	2.84
176	600138	中青旅	2,936,527.00	2.83
177	600183	生益科技	2,926,471.00	2.82
178	002068	黑猫股份	2,923,814.00	2.82
179	000503	国新健康	2,907,261.00	2.80
180	688123	聚辰股份	2,894,095.55	2.79
181	600888	新疆众和	2,892,934.98	2.79
182	002020	京新药业	2,890,457.00	2.78
183	002701	奥瑞金	2,870,466.00	2.77
184	002236	大华股份	2,860,532.00	2.76
185	600971	恒源煤电	2,855,424.00	2.75
186	603501	韦尔股份	2,847,923.00	2.74
187	002287	奇正藏药	2,821,244.00	2.72
188	600328	中盐化工	2,807,749.00	2.71
189	002215	诺普信	2,806,172.17	2.70
190	603612	索通发展	2,796,672.00	2.69
191	603283	赛腾股份	2,796,080.00	2.69
192	000921	海信家电	2,789,560.00	2.69
193	605365	立达信	2,778,000.00	2.68
194	002402	和而泰	2,776,421.45	2.67
195	600587	新华医疗	2,772,886.00	2.67
196	603588	高能环境	2,771,774.00	2.67
197	300348	长亮科技	2,769,848.99	2.67
198	600993	马应龙	2,762,950.00	2.66
199	300035	中科电气	2,750,876.00	2.65
200	601816	京沪高铁	2,750,619.00	2.65
201	002003	伟星股份	2,749,428.76	2.65
202	300502	新易盛	2,743,056.00	2.64
203	603766	隆鑫通用	2,741,850.00	2.64

204	600163	中闽能源	2,737,072.00	2.64
205	002273	水晶光电	2,733,781.00	2.63
206	002837	英维克	2,719,145.00	2.62
207	688278	特宝生物	2,718,933.61	2.62
208	000848	承德露露	2,718,594.00	2.62
209	002645	华宏科技	2,716,708.96	2.62
210	301286	侨源股份	2,707,881.44	2.61
211	300773	拉卡拉	2,695,740.00	2.60
212	300369	绿盟科技	2,692,719.00	2.59
213	603259	药明康德	2,677,601.00	2.58
214	601890	亚星锚链	2,673,447.00	2.58
215	688007	光峰科技	2,672,666.47	2.57
216	000600	建投能源	2,666,213.00	2.57
217	600223	福瑞达	2,662,849.75	2.57
218	600266	城建发展	2,649,296.12	2.55
219	300034	钢研高纳	2,647,397.00	2.55
220	002573	清新环境	2,644,008.00	2.55
221	603160	汇顶科技	2,643,823.00	2.55
222	600929	雪天盐业	2,642,961.00	2.55
223	688016	心脉医疗	2,630,506.55	2.53
224	000012	南玻 A	2,627,519.00	2.53
225	300777	中简科技	2,616,741.00	2.52
226	002540	亚太科技	2,606,003.80	2.51
227	300274	阳光电源	2,597,163.80	2.50
228	600566	济川药业	2,595,810.00	2.50
229	688110	东芯股份	2,590,520.27	2.50
230	603938	三孚股份	2,588,784.40	2.49
231	601006	大秦铁路	2,583,375.00	2.49
232	000829	天音控股	2,583,076.00	2.49
233	002937	兴瑞科技	2,582,619.40	2.49
234	600361	创新新材	2,582,543.00	2.49
235	600478	科力远	2,572,368.00	2.48
236	301177	迪阿股份	2,571,886.46	2.48
237	601222	林洋能源	2,571,519.00	2.48
238	605090	九丰能源	2,567,775.00	2.47
239	002034	旺能环境	2,547,201.58	2.45
240	601279	英利汽车	2,545,371.00	2.45
241	002130	沃尔核材	2,544,814.00	2.45
242	688439	振华风光	2,543,955.65	2.45
243	002226	江南化工	2,534,836.00	2.44
244	300140	节能环境	2,527,156.00	2.43
245	600641	万业企业	2,519,193.00	2.43
246	600150	中国船舶	2,514,394.00	2.42
247	601702	华峰铝业	2,507,641.00	2.42

248	600057	厦门象屿	2,506,840.00	2.42
249	002081	金螳螂	2,502,748.00	2.41
250	688232	新点软件	2,488,061.94	2.40
251	688001	华兴源创	2,483,601.29	2.39
252	002544	普天科技	2,478,340.00	2.39
253	002100	天康生物	2,473,120.51	2.38
254	002201	正威新材	2,472,213.00	2.38
255	600104	上汽集团	2,467,002.00	2.38
256	600210	紫江企业	2,463,849.00	2.37
257	300033	同花顺	2,462,117.00	2.37
258	300760	迈瑞医疗	2,459,434.00	2.37
259	000738	航发控制	2,450,684.00	2.36
260	600225	卓朗科技	2,436,308.00	2.35
261	002292	奥飞娱乐	2,434,562.00	2.35
262	688166	博瑞医药	2,426,543.99	2.34
263	002938	鹏鼎控股	2,425,939.00	2.34
264	301087	可孚医疗	2,417,722.00	2.33
265	603013	亚普股份	2,410,618.00	2.32
266	605123	派克新材	2,407,766.00	2.32
267	300308	中际旭创	2,401,714.20	2.31
268	000552	甘肃能化	2,400,513.79	2.31
269	300482	万孚生物	2,390,142.50	2.30
270	301327	华宝新能	2,388,383.40	2.30
271	002149	西部材料	2,388,143.00	2.30
272	002516	旷达科技	2,377,476.00	2.29
273	600780	通宝能源	2,376,130.16	2.29
274	601985	中国核电	2,374,651.00	2.29
275	603025	大豪科技	2,367,058.00	2.28
276	002212	天融信	2,365,647.00	2.28
277	688239	航宇科技	2,365,569.44	2.28
278	601117	中国化学	2,365,140.56	2.28
279	300451	创业慧康	2,360,261.00	2.27
280	601975	招商南油	2,353,008.00	2.27
281	601952	苏垦农发	2,351,368.00	2.27
282	600039	四川路桥	2,338,195.20	2.25
283	300498	温氏股份	2,336,285.00	2.25
284	000166	申万宏源	2,330,647.00	2.25
285	000811	冰轮环境	2,325,383.55	2.24
286	603093	南华期货	2,319,248.00	2.23
287	002866	传艺科技	2,315,209.00	2.23
288	002396	星网锐捷	2,309,516.00	2.23
289	300395	菲利华	2,308,322.00	2.22
290	601390	中国中铁	2,304,886.00	2.22
291	002307	北新路桥	2,302,914.00	2.22

292	002142	宁波银行	2,300,711.30	2.22
293	000016	深康佳 A	2,300,320.00	2.22
294	603699	纽威股份	2,298,857.00	2.21
295	301180	万祥科技	2,288,503.00	2.20
296	603583	捷昌驱动	2,283,161.00	2.20
297	688188	柏楚电子	2,280,607.47	2.20
298	002265	建设工业	2,278,001.00	2.19
299	600562	国睿科技	2,270,419.40	2.19
300	600284	浦东建设	2,267,702.00	2.18
301	002261	拓维信息	2,264,490.00	2.18
302	002275	桂林三金	2,263,916.00	2.18
303	300856	科思股份	2,262,278.00	2.18
304	300811	铂科新材	2,261,858.80	2.18
305	601601	中国太保	2,259,064.00	2.18
306	603055	台华新材	2,253,649.00	2.17
307	603308	应流股份	2,251,634.00	2.17
308	603236	移远通信	2,251,337.00	2.17
309	002895	川恒股份	2,250,380.00	2.17
310	300294	博雅生物	2,250,348.00	2.17
311	603936	博敏电子	2,245,670.00	2.16
312	300696	爱乐达	2,241,826.20	2.16
313	600456	宝钛股份	2,241,284.00	2.16
314	002916	深南电路	2,237,948.00	2.16
315	601099	太平洋	2,227,993.00	2.15
316	688432	有研硅	2,226,065.59	2.14
317	601939	建设银行	2,224,042.00	2.14
318	600905	三峡能源	2,223,005.00	2.14
319	600063	皖维高新	2,209,537.00	2.13
320	002241	歌尔股份	2,207,301.91	2.13
321	002264	新华都	2,207,265.00	2.13
322	600997	开滦股份	2,207,223.00	2.13
323	000902	新洋丰	2,201,407.00	2.12
324	002581	未名医药	2,197,189.00	2.12
325	603298	杭叉集团	2,193,486.00	2.11
326	600248	陕建股份	2,193,039.00	2.11
327	600901	江苏金租	2,192,342.40	2.11
328	002583	海能达	2,190,322.00	2.11
329	01398	工商银行	2,189,166.07	2.11
330	000917	电广传媒	2,188,747.00	2.11
331	002233	塔牌集团	2,183,352.00	2.10
332	300133	华策影视	2,180,265.00	2.10
333	002948	青岛银行	2,177,018.00	2.10
334	605589	圣泉集团	2,169,527.00	2.09
335	600996	贵广网络	2,162,912.00	2.08

336	600502	安徽建工	2,162,656.00	2.08
337	002901	大博医疗	2,160,879.56	2.08
338	300463	迈克生物	2,159,069.00	2.08
339	603256	宏和科技	2,158,981.00	2.08
340	600908	无锡银行	2,156,247.00	2.08
341	603277	银都股份	2,154,540.00	2.08
342	600869	远东股份	2,151,542.00	2.07
343	601319	中国人保	2,132,410.00	2.05
344	002746	仙坛股份	2,132,193.19	2.05
345	600197	伊力特	2,132,075.00	2.05
346	600810	神马股份	2,127,907.20	2.05
347	605338	巴比食品	2,122,965.00	2.05
348	001236	弘业期货	2,120,333.00	2.04
349	300415	伊之密	2,113,945.00	2.04
350	002416	爱施德	2,102,225.00	2.03
351	600588	用友网络	2,101,103.00	2.02
352	601225	陕西煤业	2,097,284.00	2.02
353	000063	中兴通讯	2,097,155.00	2.02
354	002049	紫光国微	2,096,450.00	2.02
355	600195	中牧股份	2,094,466.00	2.02
356	600158	中体产业	2,092,140.00	2.02
357	300315	掌趣科技	2,091,889.00	2.02
358	688321	微芯生物	2,090,823.57	2.01
359	300737	科顺股份	2,087,320.00	2.01
360	002317	众生药业	2,086,943.00	2.01
361	601717	郑煤机	2,082,644.00	2.01
362	688327	云从科技	2,082,165.89	2.01
363	600436	片仔癀	2,078,213.00	2.00
364	600760	中航沈飞	2,077,746.00	2.00

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。

8.4.2 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	22,255,090.00	21.44
2	601318	中国平安	18,016,993.38	17.36
3	601398	工商银行	15,095,087.16	14.54
4	600036	招商银行	13,368,507.35	12.88
5	300750	宁德时代	10,210,296.18	9.84
6	600900	长江电力	10,073,456.09	9.71

7	601288	农业银行	9,158,002.50	8.82
8	600887	伊利股份	8,582,051.95	8.27
9	600050	中国联通	7,991,054.30	7.70
10	600028	中国石化	7,455,531.80	7.18
11	000725	京东方 A	7,449,104.47	7.18
12	600030	中信证券	7,292,170.81	7.03
13	601988	中国银行	7,099,202.60	6.84
14	601728	中国电信	7,075,955.76	6.82
15	601166	兴业银行	6,872,334.81	6.62
16	600919	江苏银行	6,665,720.20	6.42
17	601668	中国建筑	6,315,792.60	6.08
18	688235	百济神州	6,094,519.74	5.87
19	600667	太极实业	5,958,509.66	5.74
20	600406	国电南瑞	5,773,312.76	5.56
21	600276	恒瑞医药	5,739,472.20	5.53
22	601138	工业富联	5,722,883.00	5.51
23	601899	紫金矿业	5,614,165.62	5.41
24	600577	精达股份	5,602,955.79	5.40
25	600809	山西汾酒	5,524,343.40	5.32
26	002015	协鑫能科	5,352,099.00	5.16
27	300303	聚飞光电	5,215,509.82	5.02
28	000333	美的集团	5,152,516.99	4.96
29	300476	胜宏科技	5,093,304.13	4.91
30	300059	东方财富	5,062,868.72	4.88
31	600690	海尔智家	5,042,955.20	4.86
32	00981	中芯国际	5,039,044.18	4.85
33	000568	泸州老窖	4,989,203.60	4.81
34	002549	凯美特气	4,964,320.30	4.78
35	300857	协创数据	4,862,796.04	4.68
36	002815	崇达技术	4,807,475.16	4.63
37	002585	双星新材	4,703,757.50	4.53
38	002415	海康威视	4,694,233.00	4.52
39	000858	五粮液	4,657,738.00	4.49
40	600491	龙元建设	4,653,183.00	4.48
41	000100	TCL 科技	4,589,935.07	4.42
42	300408	三环集团	4,584,366.54	4.42
43	300741	华宝股份	4,548,567.00	4.38
44	600601	方正科技	4,526,885.17	4.36
45	688161	威高骨科	4,508,317.54	4.34
46	600999	招商证券	4,494,650.60	4.33
47	688617	惠泰医疗	4,488,685.24	4.32
48	603328	依顿电子	4,469,653.60	4.31
49	300593	新雷能	4,449,986.12	4.29
50	300263	隆华科技	4,432,057.77	4.27

51	603132	金徽股份	4,356,960.00	4.20
52	601677	明泰铝业	4,349,030.00	4.19
53	002063	远光软件	4,344,311.80	4.19
54	601088	中国神华	4,342,685.16	4.18
55	603169	兰石重装	4,326,459.84	4.17
56	002048	宁波华翔	4,309,586.77	4.15
57	300573	兴齐眼药	4,230,193.43	4.08
58	300587	天铁股份	4,222,194.10	4.07
59	002475	立讯精密	4,200,381.62	4.05
60	601137	博威合金	4,190,644.18	4.04
61	688041	海光信息	4,182,375.99	4.03
62	600770	综艺股份	4,181,707.20	4.03
63	300033	同花顺	4,146,375.00	3.99
64	002027	分众传媒	4,119,864.48	3.97
65	002291	遥望科技	4,097,905.20	3.95
66	000338	潍柴动力	4,081,062.75	3.93
67	600330	天通股份	4,062,617.67	3.91
68	002219	新里程	4,025,420.40	3.88
69	600312	平高电气	4,005,081.90	3.86
70	601766	中国中车	3,967,031.00	3.82
71	688575	亚辉龙	3,911,881.20	3.77
72	603123	翠微股份	3,893,667.09	3.75
73	601600	中国铝业	3,867,823.35	3.73
74	600372	中航机载	3,857,375.80	3.72
75	601211	国泰君安	3,844,180.00	3.70
76	603393	新天然气	3,819,868.77	3.68
77	002202	金风科技	3,780,914.40	3.64
78	601989	中国重工	3,771,261.60	3.63
79	601857	中国石油	3,758,915.04	3.62
80	600366	宁波韵升	3,755,188.80	3.62
81	000651	格力电器	3,752,795.55	3.62
82	300319	麦捷科技	3,740,763.00	3.60
83	000035	中国天楹	3,737,276.25	3.60
84	002099	海翔药业	3,735,256.85	3.60
85	300098	高新兴	3,734,082.86	3.60
86	688733	壹石通	3,722,065.63	3.59
87	002283	天润工业	3,719,498.50	3.58
88	002461	珠江啤酒	3,709,092.11	3.57
89	600105	永鼎股份	3,689,551.82	3.55
90	603993	洛阳钼业	3,665,090.00	3.53
91	600660	福耀玻璃	3,658,038.00	3.52
92	002239	奥特佳	3,655,344.00	3.52
93	002851	麦格米特	3,647,100.74	3.51
94	688111	金山办公	3,614,542.45	3.48

95	000776	广发证券	3,606,929.20	3.48
96	300887	谱尼测试	3,590,132.50	3.46
97	600309	万华化学	3,578,398.40	3.45
98	603915	国茂股份	3,577,803.95	3.45
99	000560	我爱我家	3,576,303.00	3.45
100	300775	三角防务	3,568,189.44	3.44
101	002555	三七互娱	3,545,764.00	3.42
102	688206	概伦电子	3,539,321.04	3.41
103	002139	拓邦股份	3,514,748.71	3.39
104	002745	木林森	3,502,203.90	3.37
105	002434	万里扬	3,502,087.35	3.37
106	600893	航发动力	3,498,950.00	3.37
107	300123	亚光科技	3,489,492.50	3.36
108	300083	创世纪	3,483,658.00	3.36
109	002428	云南锗业	3,475,809.00	3.35
110	603489	八方股份	3,442,671.50	3.32
111	301268	铭利达	3,437,082.50	3.31
112	300382	斯莱克	3,420,828.50	3.30
113	600575	淮河能源	3,418,629.42	3.29
114	600795	国电电力	3,402,134.60	3.28
115	300080	易成新能	3,399,294.39	3.27
116	601333	广深铁路	3,365,076.50	3.24
117	000795	英洛华	3,362,012.92	3.24
118	000528	柳工	3,360,616.16	3.24
119	002782	可立克	3,359,248.70	3.24
120	688315	诺禾致源	3,347,506.43	3.23
121	002130	沃尔核材	3,339,246.50	3.22
122	000650	仁和药业	3,324,627.90	3.20
123	301015	百洋医药	3,316,929.00	3.20
124	300134	大富科技	3,306,870.00	3.19
125	002001	新和成	3,304,079.08	3.18
126	603005	晶方科技	3,303,795.78	3.18
127	600572	康恩贝	3,282,464.98	3.16
128	000875	吉电股份	3,263,727.83	3.14
129	002773	康弘药业	3,261,642.02	3.14
130	600025	华能水电	3,241,331.25	3.12
131	300170	汉得信息	3,231,661.00	3.11
132	603569	长久物流	3,219,674.18	3.10
133	601811	新华文轩	3,209,121.84	3.09
134	688019	安集科技	3,202,817.25	3.09
135	600219	南山铝业	3,195,724.35	3.08
136	600012	皖通高速	3,186,516.35	3.07
137	601669	中国电建	3,184,392.60	3.07
138	300579	数字认证	3,174,203.66	3.06

139	002594	比亚迪	3,172,461.65	3.06
140	688586	江航装备	3,144,709.93	3.03
141	002038	双鹭药业	3,138,684.85	3.02
142	000950	重药控股	3,133,504.95	3.02
143	000837	秦川机床	3,129,750.00	3.02
144	688289	圣湘生物	3,127,374.11	3.01
145	600741	华域汽车	3,125,353.60	3.01
146	002544	普天科技	3,114,898.00	3.00
147	002534	西子洁能	3,113,627.55	3.00
148	002724	海洋王	3,106,112.52	2.99
149	002498	汉缆股份	3,102,883.34	2.99
150	601311	骆驼股份	3,084,903.00	2.97
151	688188	柏楚电子	3,063,796.13	2.95
152	600556	天下秀	3,063,487.00	2.95
153	000727	冠捷科技	3,059,460.12	2.95
154	002516	旷达科技	3,054,494.10	2.94
155	000969	安泰科技	3,053,706.50	2.94
156	002043	兔宝宝	3,049,890.60	2.94
157	601688	华泰证券	3,033,458.45	2.92
158	002215	诺普信	3,007,037.45	2.90
159	603588	高能环境	2,977,974.00	2.87
160	605376	博迁新材	2,964,731.25	2.86
161	002519	银河电子	2,961,440.91	2.85
162	002446	盛路通信	2,954,756.65	2.85
163	603105	芯能科技	2,951,465.63	2.84
164	000881	中广核技	2,946,473.08	2.84
165	600138	中青旅	2,945,824.00	2.84
166	002436	兴森科技	2,942,260.75	2.83
167	002987	京北方	2,941,395.05	2.83
168	600718	东软集团	2,934,260.36	2.83
169	002697	红旗连锁	2,916,626.50	2.81
170	600478	科力远	2,912,536.00	2.81
171	002489	浙江永强	2,909,274.36	2.80
172	601777	力帆科技	2,901,380.23	2.80
173	002276	万马股份	2,896,662.70	2.79
174	002402	和而泰	2,885,775.09	2.78
175	600183	生益科技	2,882,843.50	2.78
176	000813	德展健康	2,882,470.40	2.78
177	688380	中微半导	2,881,245.29	2.78
178	002456	欧菲光	2,878,973.00	2.77
179	688123	聚辰股份	2,878,296.80	2.77
180	603612	索通发展	2,872,804.00	2.77
181	603171	税友股份	2,872,329.00	2.77
182	000682	东方电子	2,869,450.18	2.76

183	300180	华峰超纤	2,859,321.54	2.75
184	002287	奇正藏药	2,822,364.85	2.72
185	603766	隆鑫通用	2,810,656.00	2.71
186	600163	中闽能源	2,808,997.40	2.71
187	688278	特宝生物	2,782,834.00	2.68
188	301177	迪阿股份	2,778,451.36	2.68
189	600587	新华医疗	2,765,667.78	2.66
190	002068	黑猫股份	2,764,461.94	2.66
191	688110	东芯股份	2,759,116.51	2.66
192	002003	伟星股份	2,758,265.55	2.66
193	605365	立达信	2,749,565.00	2.65
194	603888	新华网	2,743,655.54	2.64
195	600993	马应龙	2,743,395.00	2.64
196	300674	宇信科技	2,728,463.24	2.63
197	301087	可孚医疗	2,724,283.50	2.62
198	601816	京沪高铁	2,715,591.50	2.62
199	002701	奥瑞金	2,715,148.58	2.62
200	603501	韦尔股份	2,710,415.20	2.61
201	688016	心脉医疗	2,705,656.47	2.61
202	002273	水晶光电	2,700,603.12	2.60
203	300274	阳光电源	2,685,583.06	2.59
204	300777	中简科技	2,674,027.50	2.58
205	301286	侨源股份	2,657,000.05	2.56
206	002645	华宏科技	2,654,339.00	2.56
207	002236	大华股份	2,646,153.50	2.55
208	603283	赛腾股份	2,643,115.50	2.55
209	000921	海信家电	2,642,104.86	2.55
210	300034	钢研高纳	2,637,617.76	2.54
211	600971	恒源煤电	2,633,758.47	2.54
212	002937	兴瑞科技	2,633,635.04	2.54
213	601890	亚星锚链	2,628,653.97	2.53
214	002201	正威新材	2,627,244.98	2.53
215	002837	英维克	2,617,511.30	2.52
216	600150	中国船舶	2,615,727.20	2.52
217	000829	天音控股	2,603,131.00	2.51
218	601702	华峰铝业	2,601,954.13	2.51
219	601222	林洋能源	2,600,128.47	2.51
220	600223	福瑞达	2,595,749.00	2.50
221	603259	药明康德	2,589,565.00	2.49
222	603160	汇顶科技	2,582,105.00	2.49
223	000738	航发控制	2,556,987.00	2.46
224	600641	万业企业	2,553,228.40	2.46
225	601279	英利汽车	2,546,211.00	2.45
226	002292	奥飞娱乐	2,542,482.00	2.45

227	002020	京新药业	2,540,490.53	2.45
228	300348	长亮科技	2,537,609.76	2.44
229	600104	上汽集团	2,537,348.00	2.44
230	603938	三孚股份	2,533,371.55	2.44
231	002540	亚太科技	2,529,240.69	2.44
232	000600	建投能源	2,524,974.00	2.43
233	002421	达实智能	2,523,749.95	2.43
234	002226	江南化工	2,520,989.51	2.43
235	600320	振华重工	2,515,454.49	2.42
236	605090	九丰能源	2,514,990.00	2.42
237	601567	三星医疗	2,511,583.00	2.42
238	000062	深圳华强	2,509,807.00	2.42
239	601006	大秦铁路	2,506,961.50	2.42
240	600888	新疆众和	2,503,427.00	2.41
241	600409	三友化工	2,499,034.67	2.41
242	600206	有研新材	2,498,014.00	2.41
243	688327	云从科技	2,490,163.42	2.40
244	002573	清新环境	2,478,330.50	2.39
245	000848	承德露露	2,478,218.30	2.39
246	603025	大豪科技	2,473,460.41	2.38
247	605589	圣泉集团	2,465,491.86	2.38
248	300457	赢合科技	2,463,914.00	2.37
249	300229	拓尔思	2,463,352.58	2.37
250	600057	厦门象屿	2,462,928.54	2.37
251	601985	中国核电	2,456,117.40	2.37
252	600225	卓朗科技	2,454,142.70	2.36
253	603936	博敏电子	2,453,093.00	2.36
254	600361	创新新材	2,440,425.00	2.35
255	688239	航宇科技	2,431,486.83	2.34
256	603013	亚普股份	2,426,524.00	2.34
257	688166	博瑞医药	2,426,194.58	2.34
258	002866	传艺科技	2,425,611.00	2.34
259	600710	苏美达	2,422,498.25	2.33
260	688439	振华风光	2,421,889.67	2.33
261	600566	济川药业	2,415,121.00	2.33
262	000012	南玻 A	2,407,912.00	2.32
263	002264	新华都	2,400,986.08	2.31
264	300451	创业慧康	2,398,780.00	2.31
265	002034	旺能环境	2,377,897.00	2.29
266	300760	迈瑞医疗	2,377,737.40	2.29
267	000166	申万宏源	2,377,621.00	2.29
268	002171	楚江新材	2,376,811.50	2.29
269	600780	通宝能源	2,369,929.00	2.28
270	601952	苏垦农发	2,367,766.10	2.28

271	600039	四川路桥	2,365,987.00	2.28
272	002149	西部材料	2,365,302.10	2.28
273	002081	金螳螂	2,361,557.00	2.28
274	000503	国新健康	2,355,006.00	2.27
275	600997	开滦股份	2,347,187.00	2.26
276	600869	远东股份	2,335,918.00	2.25
277	601939	建设银行	2,335,092.00	2.25
278	603256	宏和科技	2,331,287.00	2.25
279	300035	中科电气	2,330,712.08	2.25
280	600810	神马股份	2,327,126.21	2.24
281	300502	新易盛	2,326,669.60	2.24
282	000016	深康佳 A	2,324,417.99	2.24
283	603300	华铁应急	2,316,074.50	2.23
284	603556	海兴电力	2,314,729.27	2.23
285	688007	光峰科技	2,313,578.71	2.23
286	600901	江苏金租	2,312,816.00	2.23
287	300017	网宿科技	2,311,645.25	2.23
288	603583	捷昌驱动	2,308,828.97	2.22
289	000811	冰轮环境	2,307,166.53	2.22
290	688318	财富趋势	2,305,917.26	2.22
291	300140	节能环境	2,296,052.30	2.21
292	002916	深南电路	2,289,877.50	2.21
293	600929	雪天盐业	2,289,038.00	2.21
294	300369	绿盟科技	2,282,369.08	2.20
295	002938	鹏鼎控股	2,273,153.00	2.19
296	301180	万祥科技	2,270,010.10	2.19
297	002212	天融信	2,260,041.50	2.18
298	002947	恒铭达	2,259,012.50	2.18
299	002895	川恒股份	2,254,343.13	2.17
300	300395	菲利华	2,253,868.30	2.17
301	605123	派克新材	2,253,436.00	2.17
302	300308	中际旭创	2,250,712.32	2.17
303	002241	歌尔股份	2,248,714.00	2.17
304	688432	有研硅	2,237,929.43	2.16
305	300294	博雅生物	2,233,480.60	2.15
306	600776	东方通信	2,215,246.85	2.13
307	300856	科思股份	2,204,374.50	2.12
308	300811	铂科新材	2,197,782.99	2.12
309	601601	中国太保	2,197,509.00	2.12
310	300482	万孚生物	2,190,996.50	2.11
311	600490	鹏欣资源	2,187,453.00	2.11
312	002581	未名医药	2,185,313.50	2.11
313	688001	华兴源创	2,185,168.33	2.11
314	002307	北新路桥	2,183,164.40	2.10

315	600328	中盐化工	2,181,480.23	2.10
316	300284	苏交科	2,178,859.00	2.10
317	000552	甘肃能化	2,175,188.70	2.10
318	603055	台华新材	2,173,419.41	2.09
319	600248	陕建股份	2,169,132.80	2.09
320	002396	星网锐捷	2,164,802.70	2.09
321	601099	太平洋	2,164,562.60	2.09
322	600905	三峡能源	2,163,946.84	2.08
323	601319	中国人保	2,158,536.20	2.08
324	603277	银都股份	2,157,413.75	2.08
325	601117	中国化学	2,155,087.00	2.08
326	300696	爱乐达	2,152,932.50	2.07
327	603236	移远通信	2,152,779.33	2.07
328	601390	中国中铁	2,152,184.00	2.07
329	600760	中航沈飞	2,147,891.00	2.07
330	603699	纽威股份	2,145,029.00	2.07
331	600996	贵广网络	2,144,922.50	2.07
332	300133	华策影视	2,144,902.00	2.07
333	002275	桂林三金	2,144,579.00	2.07
334	600562	国睿科技	2,135,005.00	2.06
335	600436	片仔癀	2,131,967.00	2.05
336	600502	安徽建工	2,131,164.80	2.05
337	002145	中核钛白	2,125,757.20	2.05
338	002142	宁波银行	2,124,759.20	2.05
339	002463	沪电股份	2,120,107.73	2.04
340	002265	建设工业	2,118,405.00	2.04
341	002233	塔牌集团	2,116,094.85	2.04
342	600158	中体产业	2,102,852.00	2.03
343	603308	应流股份	2,102,771.00	2.03
344	001236	弘业期货	2,100,661.00	2.02
345	01398	工商银行	2,095,122.79	2.02
346	002123	梦网科技	2,089,268.20	2.01
347	688321	微芯生物	2,087,842.74	2.01
348	600197	伊力特	2,087,112.00	2.01
349	300762	上海瀚讯	2,085,067.30	2.01
350	600063	皖维高新	2,079,658.29	2.00
351	600588	用友网络	2,076,649.61	2.00

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。

8.4.3 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	2,611,172,609.51

卖出股票的收入（成交）总额	2,597,458,549.84

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。

8.5 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	10,165,203.29	8.81
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,165,203.29	8.81

8.6 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	019733	24 国债 02	60,000	6,114,667.40	5.30
2	019740	24 国债 09	40,000	4,050,535.89	3.51

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。

本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

8.12 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 88,295,616.82 元，占基金资产净值的比例为 76.52%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-79,962,040.00 元，占基金资产净值的比例为-69.30%，空头合约市值占股票资产的比例为-90.56%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 3,168,901.79 元，公允价值变动损益为-5,817,578.09 元。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 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。

8.13.2 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。

8.13.3 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	9,714,589.47
2	应收清算款	1,999,379.73
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,438.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,715,407.20

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.13.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
海富通安益对冲混合 A	742	69,927.72	32,153,415.14	61.97%	19,732,950.35	38.03%
海富通安益对冲混合 C	838	68,009.58	22,406,515.11	39.32%	34,585,516.20	60.68%
合计	1,580	68,910.38	54,559,930.25	50.11%	54,318,466.55	49.89%

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)。

9.2 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	海富通安益对冲混合 A	1,359,507.19	2.6202%
	海富通安益对冲混合 C	127,030.76	0.2229%
	合计	1,486,537.95	1.3653%

9.3 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	海富通安益对冲混合 A	50~100
	海富通安益对冲混合 C	10~50
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通安益对冲混合 A	50~100
	海富通安益对冲混合 C	0
	合计	50~100

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C
基金合同生效日（2020 年 1 月 22 日）基金份额总额	2,359,336,836.26	398,787,680.74
本报告期期初基金份额总额	51,744,696.53	45,587,059.19
本报告期基金总申购份额	28,328,857.81	494,653,596.44
减：本报告期基金总赎回份额	28,187,188.85	483,248,624.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	51,886,365.49	56,992,031.31

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

基金管理人：

2024 年 9 月 4 日，海富通基金管理有限公司发布公告，路颖女士自 2024 年 9 月 2 日起担任公司董事长，杨仓兵先生因退休不再担任公司董事长。

2024 年 12 月 11 日，海富通基金管理有限公司发布公告，周小波先生自 2024 年 12 月 9 日起担任公司副总经理。

基金托管人：

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 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。本年度应支付的审计费用是 45,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 5 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	1,351,462,345.55	25.95%	850,494.18	25.65%	-
海通证券	2	1,029,082,530.23	19.76%	762,280.40	22.99%	-
国金证券	1	906,513,217.58	17.40%	499,440.88	15.06%	-
招商证券	1	588,981,059.45	11.31%	433,436.56	13.07%	-
兴业证券	1	446,154,138.13	8.57%	230,424.33	6.95%	-
华创证券	1	322,204,912.80	6.19%	237,115.64	7.15%	-
平安证券	1	240,138,139.47	4.61%	104,671.96	3.16%	-
光大证券	1	140,422,728.85	2.70%	93,243.32	2.81%	-
华泰证券	1	105,195,002.28	2.02%	45,853.01	1.38%	-
中金公司	1	55,110,773.45	1.06%	41,107.59	1.24%	-
长江证券	1	20,290,633.56	0.39%	15,134.89	0.46%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	3,075,678.00	0.06%	2,263.46	0.07%	-

注：1、报告期内本基金退租太平洋证券两个交易单元、中信建投一个交易单元、国元证券一个交易单元和川财证券一个交易单元。

2、交易单元的选择标准：

基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司，租用其交易单元供本基金证券交易。

3、交易单元的选择程序：

（1）由牵头部门依据上述交易单元选择标准及公司内控制度要求，对候选券商开展尽职调查，综合评估其财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力。

（2）经评估，牵头部门将符合公司制度要求的券商相关材料提交督察长进行合规性审查，再提交基金管理人的总经理办公会审议。

（3）基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	回购交易	权证交易

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	13,699,562.00	23.91%	856,300,000.00	32.61%	-	-
海通证券	17,518,007.00	30.57%	860,500,000.00	32.77%	-	-
国金证券	-	-	104,300,000.00	3.97%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	3,299,856.00	5.76%	362,100,000.00	13.79%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	287,000,000.00	10.93%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	8,302,700.00	14.49%	110,800,000.00	4.22%	-	-
中金公司	1,502,378.00	2.62%	27,000,000.00	1.03%	-	-
长江证券	12,976,199.28	22.65%	18,000,000.00	0.69%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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湘财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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-07-12
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增民商基金销售(上海)有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-08-12
3	海富通基金管理有限公司关于董事长变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-09-04
4	海富通基金管理有限公司关于旗下基金	证券时报、基金管理	2024-09-30

	持有的股票停牌后估值方法变更的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
5	海富通基金管理有限公司关于增聘基金经理助理的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-10-11
6	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-12-11

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 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 124 只公募基金。截至 2024 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1722 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”。

2024 年 12 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“债券型 ETF 典型精品案例”。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金的文件

(二)海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同

(三)海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书

(四)海富通安益对冲策略灵活配置混合型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

13.2 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

13.3 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

二〇二五年三月三十一日