

海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	61
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	61
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	61
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 市场中性策略执行情况	61
7.13 投资组合报告附注	62
§ 8 基金份额持有人信息	63

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

§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	249,485,814.36 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通安益对冲混合 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	46,006,016.36 份	203,479,798.00 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	杨仓兵	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）	
	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C
本期已实现收益	-817,619.88	-6,153,208.93
本期利润	3,871.15	-2,652,770.90
加权平均基金份额本期利润	0.0001	-0.0133
本期加权平均净值利润率	0.01%	-1.25%
本期基金份额净值增长率	0.03%	-0.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	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	3,443,290.32	11,314,635.81
期末可供分配基金份额利润	0.0748	0.0556
期末基金资产净值	49,449,306.68	214,794,433.81
期末基金份额净值	1.0748	1.0556
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
	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	7.48%	5.56%

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

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
过去一个月	-0.48%	0.31%	0.22%	0.01%	-0.70%	0.30%
过去三个月	-1.37%	0.29%	0.68%	0.01%	-2.05%	0.28%
过去六个月	0.03%	0.43%	1.36%	0.01%	-1.33%	0.42%
过去一年	2.22%	0.35%	2.76%	0.01%	-0.54%	0.34%
过去三年	1.95%	0.36%	8.49%	0.01%	-6.54%	0.35%
自基金合同生效起至今	7.48%	0.36%	12.81%	0.01%	-5.33%	0.35%

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
过去一个月	-0.51%	0.31%	0.22%	0.01%	-0.73%	0.30%
过去三个月	-1.47%	0.29%	0.68%	0.01%	-2.15%	0.28%
过去六个月	-0.16%	0.43%	1.36%	0.01%	-1.52%	0.42%
过去一年	1.82%	0.35%	2.76%	0.01%	-0.94%	0.34%
过去三年	0.73%	0.36%	8.49%	0.01%	-7.76%	0.35%
自基金合同生效起至今	5.56%	0.36%	12.81%	0.01%	-7.25%	0.35%

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

海富通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历史走势对比图

(2020 年 1 月 22 日至 2024 年 6 月 30 日)

海富通安益对冲混合 A



海富通安益对冲混合 C



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。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 97 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定

期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通盈丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金、海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金、海富通产业优选混合型证券投资基金、海富通瑞鑫 30 天持有期债券型证券投资基金、海富通优势驱动混合型证券投资基金、海富通 ESG 领先股票型证券投资基金、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金、海富通红利优选混合型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通数字经济混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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 月兼任海富通量化先锋股票、海富通中证 500 指数增强基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通中证 2000 增强策略 ETF 基金经理。
--	--	--	--	---

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组

合同向交易的样本，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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

从 A 股市场看，上半年主要指数多以下跌为主，上证指数为-0.25%，沪深 300 为 0.89%，中证 800 为-1.76%，创业板指为-10.99%。行业板块方面，根据中信一级行业分类，表现靠前的板块是银行、煤炭、石油石化、家电、电力及公用事业，跌幅较大的板块是消费者服务、计算机、商品零售、传媒、医药。

因子方面，价值因子上半年表现强于成长因子，市值因子明显偏大。一月底二月初，小盘股大跌，期间，量化模型表现欠佳，我们在股指期货负基差较大的时候，降低了对冲策略的仓位，避免了进一步的下跌。春节过后，市场触底反弹，我们重新提高了对冲策略的仓位，期间 AI 选股模型表现较好，取得了较为理想的效果。二季度，随着一系列新规的推出，市场风格发生明显变化。期间，量化模型表现一般，同时股指期货负基差收敛，对冲策略表现较弱，产品的净多头仓位较低，但市场的下跌对组合也产生了一些负贡献。

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 0.03%，同期业绩比较基准收益率为 1.36%。
海富通安益对冲混合 C 净值增长率为-0.16%，同期业绩比较基准收益率为 1.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

随着“国九条”等政策的推出，在构建投资组合时，我们会提高基本面因子在模型中的比例，以提升股票组合的质地。展望下半年，我们会使用多种对冲策略，降低单一策略的风险，以获得更为稳定的超额收益。同时我们也在对量化模型做升级迭代，力争获得更好的业绩表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括分管基金运营业务的高级管理人员、分管投资业务的高级管理人员、督察稽核部负责人、风险管理部负责人、研究部负责人及基金运营部负责人等，以上人员具有丰富的合规、风控、证券研究、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会对经济环境发生重大变化或发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：海富通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 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	3,975,567.92	4,591,013.92

结算备付金		31,631,382.80	4,962,855.56
存出保证金		21,447,916.24	8,090,727.48
交易性金融资产	6.4.7.2	199,856,115.45	82,321,562.06
其中：股票投资		184,335,437.23	75,185,558.77
基金投资		-	-
债券投资		15,520,678.22	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	12,000,000.00	-
应收清算款		9,104,887.53	1,807,439.63
应收股利		-	-
应收申购款		24,384.61	10,464,680.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		278,040,254.55	112,238,279.26
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	5,999,477.26
应付清算款		277,037.68	1,509,479.05
应付赎回款		11,791,706.47	63,242.59
应付管理人报酬		275,756.74	130,688.66
应付托管费		45,959.45	21,781.47
应付销售服务费		75,497.53	14,727.32
应付投资顾问费		-	-
应交税费		238.28	50,921.16
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,330,317.91	651,959.95
负债合计		13,796,514.06	8,442,277.46
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	249,485,814.36	97,331,755.72
未分配利润	6.4.7.8	14,757,926.13	6,464,246.08
净资产合计		264,243,740.49	103,796,001.80
负债和净资产总计		278,040,254.55	112,238,279.26

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0748 元，C 类基金份额净值 1.0556 元。

基金份额总额 249,485,814.36 份，其中 A 类基金份额 46,006,016.36 份，C 类基金份额 203,479,798.00

份。

6.2 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-222,829.62	8,761,967.52
1.利息收入		352,840.57	297,490.50
其中：存款利息收入	6.4.7.9	205,621.66	225,699.56
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		147,218.91	71,790.94
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-5,482,102.07	6,450,407.34
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-17,826,617.14	9,751,873.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	108,707.96	94,091.49
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.12	-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	9,695,076.88	-4,219,899.81
股利收益	6.4.7.14	2,540,730.23	824,341.90
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	4,321,929.06	1,887,808.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	584,502.82	126,260.76
减：二、营业总支出		2,426,070.13	1,968,438.78
1. 管理人报酬		1,590,782.70	1,438,663.30
2. 托管费		265,130.44	239,777.25
3. 销售服务费		424,860.73	181,530.30
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,321.91	2,233.55
其中：卖出回购金融资产支出		1,321.91	2,233.55
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		43,140.75	258.79
8. 其他费用	6.4.7.17	100,833.60	105,975.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,648,899.75	6,793,528.74

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,648,899.75	6,793,528.74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,648,899.75	6,793,528.74

6.3 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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）	152,154,058.64	-	8,293,680.05	160,447,738.69
（一）、综合收益总额	-	-	-2,648,899.75	-2,648,899.75
（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）	152,154,058.64	-	10,942,579.80	163,096,638.44
其中：1.基金申购款	461,696,187.96	-	32,379,615.63	494,075,803.59
2.基金赎回款	-309,542,129.32	-	-21,437,035.83	-330,979,165.15
（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	249,485,814.36	-	14,757,926.13	264,243,740.49
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合	未分配利润	净资产合计

		收益（若有）		
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）	-197,376,084.90	-	-746,998.33	-198,123,083.23
（一）、综合收益总额	-	-	6,793,528.74	6,793,528.74
（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）	-197,376,084.90	-	-7,540,527.07	-204,916,611.97
其中：1.基金申购款	59,573,026.94	-	2,160,395.20	61,733,422.14
2.基金赎回款	-256,949,111.84	-	-9,700,922.27	-266,650,034.11
（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	111,026,130.71	-	5,394,889.53	116,421,020.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：胡光涛，会计机构负责人：胡正万

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通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。权益类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 2024 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及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要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况、2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2008] 1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2012] 85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差

别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2014] 81 号文《财政部国家税务总局证监会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》、财税 [2016] 36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税 [2016] 70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税 [2017] 90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市

股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	3,975,567.92
等于：本金	3,974,350.36
加：应计利息	1,217.56
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	3,975,567.92

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	188,295,226.98	-	184,335,437.23	-3,959,789.75
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	195,128.22		
	市场	15,320,682.55	15,520,678.22	4,867.45
	银行间		-	
	市场	-	-	-
合计	15,320,682.55	195,128.22	15,520,678.22	4,867.45
资产支持证券	-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	203,615,909.53	195,128.22	199,856,115.45	-3,954,922.30

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-185,858,647.52	-	-	-
——股指期货	-185,858,647.52	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-185,858,647.52	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2412	IM2412	-144.00	-135,043,200.00	9,114,087.52
IC2407	IC2407	-17.00	-16,719,840.00	70,360.00
IM2409	IM2409	-26.00	-24,857,040.00	54,120.00
合计	-	-	-	9,238,567.52
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	9,238,567.52
净额	-	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	12,000,000.00	-
银行间市场	-	-

合计	12,000,000.00	-
----	---------------	---

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,248,268.67
其中：交易所市场	1,248,268.67
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	82,049.24
合计	1,330,317.91

6.4.7.7 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6月30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	9,516,887.82	9,516,887.82
本期赎回（以“-”号填列）	-15,255,567.99	-15,255,567.99
本期末	46,006,016.36	46,006,016.36

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6月30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	452,179,300.14	452,179,300.14
本期赎回（以“-”号填列）	-294,286,561.33	-294,286,561.33
本期末	203,479,798.00	203,479,798.00

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 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	-817,619.88	821,491.03	3,871.15
本期基金份额交易产生的变动数	-883,444.95	470,443.35	-413,001.60
其中：基金申购款	1,714,616.80	-856,698.89	857,917.91
基金赎回款	-2,598,061.75	1,327,142.24	-1,270,919.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,695,736.57	-3,252,446.25	3,443,290.32

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	-6,153,208.93	3,500,438.03	-2,652,770.90
本期基金份额交易产生的变动数	25,191,065.71	-13,835,484.31	11,355,581.40
其中：基金申购款	71,205,572.57	-39,683,874.85	31,521,697.72
基金赎回款	-46,014,506.86	25,848,390.54	-20,166,116.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,622,004.64	-14,307,368.83	11,314,635.81

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	47,278.56
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	155,166.26
其他	3,176.84
合计	205,621.66

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	1,687,136,921.40
减：卖出股票成本总额	1,701,311,880.24
减：交易费用	3,651,658.30
买卖股票差价收入	-17,826,617.14

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	115,779.13
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-7,071.17
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	108,707.96

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	18,947,086.39
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	18,715,147.45
减：应计利息总额	239,010.11
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-7,071.17

6.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益（税前）	10,137,995.55
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	355,089.46
减：交易费用	87,829.21
合计	9,695,076.88

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,540,730.23
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	2,540,730.23

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-4,134,695.39
——股票投资	-4,150,622.84
——债券投资	15,927.45
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	8,456,624.45
——权证投资	-
——股指期货	8,456,624.45
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	4,321,929.06

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	563,958.03
基金转换费收入	20,544.79

合计	584,502.82
----	------------

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	22,376.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	160.00
证券组合费	24.36
其他费用	600.00
债券托管账户维护费	18,000.00
合计	100,833.60

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例
海通证券	1,005,566,734.81	28.72%	203,687,766.23	17.52%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
海通证券	750,522.57	29.20%	364,327.07	29.19%
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
海通证券	155,644.32	18.28%	85,393.80	23.08%

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

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用海通证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从海通证券获得研究综合服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,590,782.70	1,438,663.30
其中：应支付销售机构的客户维护费	484,427.60	225,182.62
应支付基金管理人的净管理费	1,106,355.10	1,213,480.68

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 x 1.50% / 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 x 1.20% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	265,130.44	239,777.25

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 x 0.25% / 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 x 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通安益对冲混合 A	海富通安益对冲混合 C	合计
交通银行	-	2,096.98	2,096.98
海通证券	-	1,291.67	1,291.67
海富通	-	45,000.17	45,000.17
合计	-	48,388.82	48,388.82

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通安益对冲混合A	海富通安益对冲混合C	合计
交通银行	-	1,882.36	1,882.36
海通证券	-	2,430.41	2,430.41
海富通	-	142,624.45	142,624.45
合计	-	146,937.22	146,937.22

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	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
期初持有的基金份额	19,218,738.86	-	49,218,738.86	-
期间申购/买入总额	-	-	-	-

期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	19,218,738.86	-	49,218,738.86	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	41.77%	-	55.26%	-

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。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	3,975,567.92	47,278.56	2,062,333.10	38,662.17

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
海通证券	688469	中芯集成	网下发行	23,666	134,659.54

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300630	普利制药	2024-05-06	重大事项未公告	12.35	2024-07-08	9.88	115,100	1,676,784.00	1,421,485.00	-

注：本基金本报告期末持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-

A-1 以下	-	-
未评级	15,520,678.22	7,136,003.29
合计	15,520,678.22	7,136,003.29

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,975,567.92	-	-	-	3,975,567.92
结算备付金	31,631,382.80	-	-	-	31,631,382.80
存出保证金	225,369.04	-	-	21,222,547.20	21,447,916.24
交易性金融资产	15,520,678.22	-	-	184,335,437.23	199,856,115.45
买入返售金融资	12,000,000.00	-	-	-	12,000,000.00

产					
应收清算款	-	-	-	9,104,887.53	9,104,887.53
应收申购款	-	-	-	24,384.61	24,384.61
资产总计	63,352,997.98	-	-	214,687,256.57	278,040,254.55
负债					
应付清算款	-	-	-	277,037.68	277,037.68
应付赎回款	-	-	-	11,791,706.47	11,791,706.47
应付管理人报酬	-	-	-	275,756.74	275,756.74
应付托管费	-	-	-	45,959.45	45,959.45
应付销售服务费	-	-	-	75,497.53	75,497.53
应交税费	-	-	-	238.28	238.28
其他负债	-	-	-	1,330,317.91	1,330,317.91
负债总计	-	-	-	13,796,514.06	13,796,514.06
利率敏感度缺口	63,352,997.98	-	-	200,890,742.51	264,243,740.49
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进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的	
		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-12,922.24	-805.78
市场利率下降 25 个基点	12,969.32	807.88	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	1,367,194.64	1,367,194.64
资产合计	-	1,367,194.64	1,367,194.64

以外币计价的 负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	1,367,194.64	1,367,194.64
项目	上年度末 2023年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的 资产			
交易性金融资 产	-	-	-
资产合计	-	-	-
以外币计价的 负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	-	-

注：出于列报考虑，风险敞口金额以人民币列示，以资产负债表日即期汇率折算。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	68,359.73	-
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-68,359.73	-

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票、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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	184,335,437.	69.76	75,185,558.77	72.44

	23			
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	184,335,437.	69.76	75,185,558.77	72.44
	23			

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	-1,258,991.98	60,370.52
	2.业绩比较基准下降 5%	1,258,991.98	-60,370.52

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。

三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	182,913,952.23	75,185,558.77
第二层次	16,942,163.22	7,136,003.29
第三层次	-	-

合计	199,856,115.45	82,321,562.06
----	----------------	---------------

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2023 年 12 月 31 日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	184,335,437.23	66.30
	其中：股票	184,335,437.23	66.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,520,678.22	5.58
	其中：债券	15,520,678.22	5.58
	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	12,000,000.00	4.32
	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	35,606,950.72	12.81
8	其他各项资产	30,577,188.38	11.00
9	合计	278,040,254.55	100.00

注：本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 1,367,194.64 元，占资产净值比例为 0.52%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,054,257.20	0.40
B	采矿业	11,912,090.60	4.51
C	制造业	126,484,055.46	47.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,789,322.27	4.46
E	建筑业	1,407,505.20	0.53
F	批发和零售业	3,978,197.60	1.51
G	交通运输、仓储和邮政业	6,526,595.64	2.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,032,941.71	2.66
J	金融业	8,698,014.43	3.29
K	房地产业	195,444.00	0.07
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,042,910.00	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	308,000.00	0.12
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,427,676.48	0.92
S	综合	111,232.00	0.04
	合计	182,968,242.59	69.24

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	1,367,194.64	0.52
合计	1,367,194.64	0.52

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300476	胜宏科技	72,480	2,338,204.80	0.88
2	603283	赛腾股份	29,500	2,253,800.00	0.85
3	601318	中国平安	53,400	2,208,624.00	0.84
4	688111	金山办公	8,717	1,983,117.50	0.75
5	601138	工业富联	66,800	1,830,320.00	0.69
6	002139	拓邦股份	166,162	1,764,640.44	0.67
7	603393	新天然气	49,600	1,723,104.00	0.65
8	002048	宁波华翔	132,970	1,720,631.80	0.65
9	002851	麦格米特	65,198	1,684,716.32	0.64
10	601288	农业银行	383,500	1,672,060.00	0.63
11	601137	博威合金	109,400	1,667,256.00	0.63
12	002837	英维克	77,920	1,666,708.80	0.63
13	600036	招商银行	48,540	1,659,582.60	0.63
14	002635	安洁科技	106,800	1,648,992.00	0.62
15	002773	康弘药业	75,825	1,641,611.25	0.62
16	300857	协创数据	28,800	1,641,600.00	0.62
17	300415	伊之密	78,400	1,629,152.00	0.62
18	688123	聚辰股份	26,559	1,615,583.97	0.61
19	600577	精达股份	405,000	1,607,850.00	0.61
20	300573	兴齐眼药	9,734	1,596,376.00	0.60
21	002463	沪电股份	43,700	1,595,050.00	0.60
22	603699	纽威股份	91,600	1,568,192.00	0.59
23	601019	山东出版	128,200	1,515,324.00	0.57
24	000600	建投能源	231,800	1,460,340.00	0.55
25	300630	普利制药	115,100	1,421,485.00	0.54
26	002396	星网锐捷	104,700	1,383,087.00	0.52
27	00981	中芯国际	87,500	1,367,194.64	0.52
28	601702	华峰铝业	74,077	1,352,646.02	0.51
29	002043	兔宝宝	123,400	1,279,658.00	0.48
30	002947	恒铭达	35,900	1,263,680.00	0.48
31	688575	亚辉龙	53,048	1,237,079.36	0.47

32	600012	皖通高速	87,180	1,217,904.60	0.46
33	601231	环旭电子	73,300	1,176,465.00	0.45
34	000848	承德露露	147,470	1,159,114.20	0.44
35	002273	水晶光电	68,000	1,154,640.00	0.44
36	000682	东方电子	102,300	1,129,392.00	0.43
37	301308	江波龙	11,800	1,117,932.00	0.42
38	605090	九丰能源	38,100	1,104,900.00	0.42
39	600312	平高电气	56,700	1,102,815.00	0.42
40	688289	圣湘生物	62,650	1,101,387.00	0.42
41	600993	马应龙	40,900	1,090,803.00	0.41
42	300775	三角防务	35,600	1,089,360.00	0.41
43	605111	新洁能	35,580	1,088,392.20	0.41
44	601677	明泰铝业	94,000	1,086,640.00	0.41
45	688008	澜起科技	18,959	1,083,696.44	0.41
46	688041	海光信息	15,389	1,082,154.48	0.41
47	603129	春风动力	7,600	1,081,784.00	0.41
48	002916	深南电路	10,200	1,078,854.00	0.41
49	002226	江南化工	240,700	1,078,336.00	0.41
50	600968	海油发展	260,400	1,072,848.00	0.41
51	000902	新洋丰	90,000	1,068,300.00	0.40
52	002270	华明装备	47,500	1,056,400.00	0.40
53	600409	三友化工	210,250	1,055,455.00	0.40
54	600971	恒源煤电	88,300	1,054,302.00	0.40
55	601975	招商南油	291,800	1,047,562.00	0.40
56	002895	川恒股份	57,100	1,045,501.00	0.40
57	600761	安徽合力	48,300	1,045,212.00	0.40
58	600582	天地科技	151,600	1,044,524.00	0.40
59	600323	瀚蓝环境	49,900	1,042,910.00	0.39
60	601333	广深铁路	321,800	1,042,632.00	0.39
61	600021	上海电力	105,100	1,039,439.00	0.39
62	688568	中科星图	21,723	1,036,187.10	0.39
63	600461	洪城环境	89,300	1,034,094.00	0.39
64	603505	金石资源	37,000	1,033,410.00	0.39
65	600562	国睿科技	75,500	1,031,330.00	0.39
66	000683	远兴能源	149,000	1,029,590.00	0.39
67	601001	晋控煤业	62,300	1,029,196.00	0.39
68	000951	中国重汽	71,800	1,028,176.00	0.39
69	002223	鱼跃医疗	27,300	1,026,480.00	0.39
70	002594	比亚迪	4,100	1,026,025.00	0.39
71	002078	太阳纸业	73,000	1,018,350.00	0.39
72	300394	天孚通信	11,460	1,013,293.20	0.38
73	600458	时代新材	100,200	1,012,020.00	0.38
74	002001	新和成	52,700	1,011,840.00	0.38
75	600566	济川药业	31,900	1,011,549.00	0.38

76	603605	珀莱雅	9,100	1,010,009.00	0.38
77	600480	凌云股份	102,200	1,004,626.00	0.38
78	601918	新集能源	102,700	1,001,325.00	0.38
79	603766	隆鑫通用	147,600	1,000,728.00	0.38
80	300679	电连技术	24,800	997,704.00	0.38
81	601717	郑煤机	67,400	997,520.00	0.38
82	603328	依顿电子	126,430	993,739.80	0.38
83	000550	江铃汽车	45,700	992,147.00	0.38
84	603338	浙江鼎力	16,400	990,888.00	0.37
85	300783	三只松鼠	45,200	988,524.00	0.37
86	688188	柏楚电子	5,343	986,050.65	0.37
87	300482	万孚生物	40,400	985,760.00	0.37
88	688235	百济神州	8,389	971,781.76	0.37
89	300049	福瑞股份	19,300	971,562.00	0.37
90	601101	昊华能源	105,140	966,236.60	0.37
91	603979	金诚信	19,100	965,123.00	0.37
92	601311	骆驼股份	119,360	957,267.20	0.36
93	002003	伟星股份	74,160	930,708.00	0.35
94	000795	英洛华	163,720	907,008.80	0.34
95	300017	网宿科技	111,650	882,035.00	0.33
96	603983	丸美股份	31,900	878,207.00	0.33
97	688525	佰维存储	13,681	877,636.15	0.33
98	600125	铁龙物流	143,150	854,605.50	0.32
99	600900	长江电力	29,540	854,296.80	0.32
100	300308	中际旭创	5,960	821,764.80	0.31
101	002697	红旗连锁	171,550	794,276.50	0.30
102	600519	贵州茅台	540	792,390.60	0.30
103	300750	宁德时代	4,400	792,132.00	0.30
104	688617	惠泰医疗	1,700	775,370.00	0.29
105	002416	爱施德	86,450	765,082.50	0.29
106	300705	九典制药	27,940	747,115.60	0.28
107	000690	宝新能源	143,200	730,320.00	0.28
108	603298	杭叉集团	34,440	676,401.60	0.26
109	002100	天康生物	97,400	674,982.00	0.26
110	603160	汇顶科技	9,800	673,750.00	0.25
111	002701	奥瑞金	160,980	669,676.80	0.25
112	002267	陕天然气	88,500	669,060.00	0.25
113	002475	立讯精密	16,600	652,546.00	0.25
114	300866	安克创新	9,000	640,890.00	0.24
115	001323	慕思股份	21,700	624,309.00	0.24
116	002737	葵花药业	26,400	617,232.00	0.23
117	600219	南山铝业	158,640	604,418.40	0.23
118	300502	新易盛	5,700	601,635.00	0.23
119	603871	嘉友国际	32,820	580,585.80	0.22

120	603323	苏农银行	119,653	575,530.93	0.22
121	000552	甘肃能化	165,700	574,979.00	0.22
122	300760	迈瑞医疗	1,880	546,910.80	0.21
123	300832	新产业	8,100	546,264.00	0.21
124	002595	豪迈科技	14,200	542,014.00	0.21
125	601058	赛轮轮胎	38,700	541,800.00	0.21
126	603279	景津装备	24,900	540,081.00	0.20
127	601666	平煤股份	48,200	539,840.00	0.20
128	600420	国药现代	50,400	538,272.00	0.20
129	001309	德明利	6,200	535,680.00	0.20
130	002318	久立特材	22,900	534,257.00	0.20
131	000923	河钢资源	30,900	532,098.00	0.20
132	300856	科思股份	16,600	531,366.00	0.20
133	600373	中文传媒	35,000	519,400.00	0.20
134	002237	恒邦股份	44,900	516,799.00	0.20
135	000703	恒逸石化	72,600	514,734.00	0.19
136	002312	川发龙蟒	76,200	512,826.00	0.19
137	002215	诺普信	68,300	508,835.00	0.19
138	000875	吉电股份	95,400	508,482.00	0.19
139	300761	立华股份	22,300	504,872.00	0.19
140	002372	伟星新材	32,700	504,234.00	0.19
141	603515	欧普照明	29,000	502,860.00	0.19
142	300791	仙乐健康	19,890	501,228.00	0.19
143	300910	瑞丰新材	11,400	498,408.00	0.19
144	603733	仙鹤股份	28,100	493,998.00	0.19
145	002154	报喜鸟	90,010	489,654.40	0.19
146	300433	蓝思科技	26,800	489,100.00	0.19
147	000521	长虹美菱	63,000	477,540.00	0.18
148	603277	银都股份	15,800	474,632.00	0.18
149	600406	国电南瑞	18,936	472,642.56	0.18
150	600285	羚锐制药	19,500	472,095.00	0.18
151	000333	美的集团	7,280	469,560.00	0.18
152	002035	华帝股份	75,100	467,873.00	0.18
153	600150	中国船舶	11,260	458,394.60	0.17
154	000921	海信家电	14,100	454,584.00	0.17
155	600320	振华重工	131,485	449,678.70	0.17
156	600123	兰花科创	50,100	448,395.00	0.17
157	601398	工商银行	77,200	440,040.00	0.17
158	000975	银泰黄金	26,500	431,685.00	0.16
159	601088	中国神华	9,700	430,389.00	0.16
160	600795	国电电力	71,620	429,003.80	0.16
161	600750	江中药业	18,200	420,602.00	0.16
162	601567	三星医疗	12,000	420,000.00	0.16
163	601117	中国化学	50,300	414,472.00	0.16

164	000598	兴蓉环境	55,100	414,352.00	0.16
165	603556	海兴电力	8,800	412,104.00	0.16
166	002533	金杯电工	41,100	408,945.00	0.15
167	000543	皖能电力	46,100	407,985.00	0.15
168	600887	伊利股份	15,780	407,755.20	0.15
169	002444	巨星科技	16,500	407,550.00	0.15
170	000528	柳工	35,900	401,721.00	0.15
171	600916	中国黄金	41,600	400,192.00	0.15
172	600690	海尔智家	14,000	397,320.00	0.15
173	600269	赣粤高速	76,800	397,056.00	0.15
174	688578	艾力斯	6,217	396,271.58	0.15
175	600309	万华化学	4,900	396,214.00	0.15
176	600210	紫江企业	74,300	395,276.00	0.15
177	000426	兴业银锡	29,000	393,820.00	0.15
178	601811	新华文轩	28,048	392,952.48	0.15
179	688208	道通科技	16,275	392,878.50	0.15
180	688018	乐鑫科技	3,900	384,852.00	0.15
181	300274	阳光电源	6,160	382,104.80	0.14
182	000028	国药一致	11,800	380,314.00	0.14
183	002991	甘源食品	6,200	376,030.00	0.14
184	601899	紫金矿业	21,400	375,998.00	0.14
185	600901	江苏金租	74,350	375,467.50	0.14
186	600919	江苏银行	49,900	370,757.00	0.14
187	688278	特宝生物	6,908	369,923.40	0.14
188	603883	老百姓	19,760	362,793.60	0.14
189	600874	创业环保	64,033	357,944.47	0.14
190	688676	金盘科技	6,800	354,620.00	0.13
191	600787	中储股份	72,900	350,649.00	0.13
192	000338	潍柴动力	21,240	344,937.60	0.13
193	688019	安集科技	2,700	339,660.00	0.13
194	002938	鹏鼎控股	8,400	333,984.00	0.13
195	600820	隧道股份	50,900	332,377.00	0.13
196	601668	中国建筑	61,140	324,653.40	0.12
197	300633	开立医疗	8,100	320,598.00	0.12
198	002130	沃尔核材	22,500	317,700.00	0.12
199	600030	中信证券	17,200	313,556.00	0.12
200	000526	学大教育	5,000	308,000.00	0.12
201	603986	兆易创新	3,200	305,984.00	0.12
202	000429	粤高速 A	28,400	295,644.00	0.11
203	002402	和而泰	27,600	295,596.00	0.11
204	600031	三一重工	17,600	290,400.00	0.11
205	603993	洛阳钼业	34,000	289,000.00	0.11
206	601211	国泰君安	21,260	288,073.00	0.11
207	002371	北方华创	900	287,901.00	0.11

208	600660	福耀玻璃	6,000	287,400.00	0.11
209	601077	渝农商行	56,700	284,634.00	0.11
210	600025	华能水电	25,600	275,968.00	0.10
211	002142	宁波银行	12,500	275,750.00	0.10
212	300498	温氏股份	13,860	274,705.20	0.10
213	002714	牧原股份	6,300	274,680.00	0.10
214	002415	海康威视	8,600	265,826.00	0.10
215	601225	陕西煤业	10,100	260,277.00	0.10
216	000858	五粮液	2,000	256,080.00	0.10
217	601600	中国铝业	32,980	251,637.40	0.10
218	002847	盐津铺子	5,840	249,776.80	0.09
219	000568	泸州老窖	1,740	249,672.60	0.09
220	000933	神火股份	12,300	248,829.00	0.09
221	605333	沪光股份	8,900	247,865.00	0.09
222	600348	华阳股份	23,900	238,044.00	0.09
223	600487	亨通光电	14,500	228,665.00	0.09
224	300475	香农芯创	7,700	227,689.00	0.09
225	600803	新奥股份	10,900	226,720.00	0.09
226	600612	老凤祥	3,850	224,031.50	0.08
227	600023	浙能电力	31,200	221,832.00	0.08
228	000651	格力电器	5,580	218,847.60	0.08
229	600760	中航沈飞	5,200	208,520.00	0.08
230	601989	中国重工	41,400	204,102.00	0.08
231	600426	华鲁恒升	7,500	199,800.00	0.08
232	600007	中国国贸	8,900	195,444.00	0.07
233	002545	东方铁塔	27,900	189,999.00	0.07
234	600368	五洲交通	48,920	174,644.40	0.07
235	600183	生益科技	8,200	172,692.00	0.07
236	600741	华域汽车	10,100	165,438.00	0.06
237	002752	昇兴股份	32,600	164,956.00	0.06
238	600019	宝钢股份	24,800	164,920.00	0.06
239	601898	中煤能源	13,100	163,488.00	0.06
240	688408	中信博	1,737	159,942.96	0.06
241	601985	中国核电	14,820	157,981.20	0.06
242	605099	共创草坪	8,300	156,953.00	0.06
243	601728	中国电信	25,400	156,210.00	0.06
244	002648	卫星化学	8,400	151,032.00	0.06
245	002550	千红制药	27,900	150,381.00	0.06
246	002252	上海莱士	19,200	150,144.00	0.06
247	603019	中科曙光	3,600	149,400.00	0.06
248	601611	中国核建	18,300	148,047.00	0.06
249	688766	普冉股份	1,522	147,892.74	0.06
250	000977	浪潮信息	4,000	145,480.00	0.06
251	002241	歌尔股份	7,400	144,374.00	0.05

252	688012	中微公司	1,000	141,260.00	0.05
253	601021	春秋航空	2,500	140,825.00	0.05
254	600642	申能股份	15,600	137,748.00	0.05
255	603303	得邦照明	11,500	132,020.00	0.05
256	601669	中国电建	23,320	130,358.80	0.05
257	000021	深科技	8,600	130,032.00	0.05
258	601988	中国银行	27,920	128,990.40	0.05
259	300408	三环集团	4,260	124,349.40	0.05
260	603529	爱玛科技	4,500	122,985.00	0.05
261	600575	淮河能源	31,230	121,484.70	0.05
262	600673	东阳光	15,800	111,232.00	0.04
263	000403	派林生物	4,100	109,306.00	0.04
264	600018	上港集团	18,800	108,664.00	0.04
265	601658	邮储银行	20,700	104,949.00	0.04
266	688100	威胜信息	2,698	102,928.70	0.04
267	603501	韦尔股份	900	89,433.00	0.03
268	000582	北部湾港	10,971	81,624.24	0.03
269	600801	华新水泥	5,500	75,625.00	0.03
270	600028	中国石化	11,700	73,944.00	0.03
271	600104	上汽集团	4,800	66,528.00	0.03
272	600893	航发动力	1,700	62,135.00	0.02
273	600694	大商股份	3,500	58,835.00	0.02
274	600029	南方航空	9,960	58,664.40	0.02
275	600039	四川路桥	7,300	57,597.00	0.02
276	601000	唐山港	11,500	54,050.00	0.02
277	603008	喜临门	2,500	43,325.00	0.02
278	600938	中国海油	1,100	36,300.00	0.01
279	600905	三峡能源	8,200	35,752.00	0.01
280	600295	鄂尔多斯	3,100	30,752.00	0.01
281	603050	科林电气	900	21,834.00	0.01
282	688036	传音控股	280	21,431.20	0.01
283	300470	中密控股	400	13,524.00	0.01
284	600989	宝丰能源	600	10,398.00	0.00
285	002467	二六三	735	2,454.90	0.00
286	688599	天合光能	130	2,199.60	0.00
287	002978	安宁股份	50	1,393.00	0.00
288	688468	科美诊断	152	962.16	0.00
289	688303	大全能源	38	774.82	0.00
290	600328	中盐化工	100	686.00	0.00
291	603939	益丰药房	20	491.00	0.00
292	600063	皖维高新	83	292.16	0.00
293	688221	前沿生物	39	216.45	0.00

注：根据银泰黄金股份有限公司于 2024 年 7 月 24 日发布的《关于变更公司全称及证券简称暨

完成变更登记的公告》，自 2024 年 7 月 25 日起，公司的证券简称由“银泰黄金”变更为“山金国际”，证券代码“000975”保持不变。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	16,428,727.91	15.83
2	601318	中国平安	12,746,506.00	12.28
3	601398	工商银行	12,681,745.00	12.22
4	600036	招商银行	11,753,716.55	11.32
5	600900	长江电力	8,826,247.00	8.50
6	600887	伊利股份	8,227,858.00	7.93
7	601288	农业银行	7,082,359.00	6.82
8	600028	中国石化	6,646,231.00	6.40
9	600050	中国联通	6,316,237.00	6.09
10	601166	兴业银行	6,174,027.00	5.95
11	600030	中信证券	5,901,294.00	5.69
12	601988	中国银行	5,827,755.00	5.61
13	601728	中国电信	5,525,123.00	5.32
14	601668	中国建筑	5,372,018.42	5.18
15	000725	京东方 A	5,352,559.00	5.16
16	300750	宁德时代	5,345,352.60	5.15
17	600406	国电南瑞	5,233,195.08	5.04
18	688235	百济神州	5,215,865.16	5.03
19	002549	凯美特气	5,212,534.26	5.02
20	601899	紫金矿业	5,141,835.00	4.95
21	600809	山西汾酒	5,024,536.00	4.84
22	600919	江苏银行	4,849,789.00	4.67
23	600690	海尔智家	4,586,768.00	4.42
24	002219	新里程	4,451,356.00	4.29
25	002015	协鑫能科	4,306,359.00	4.15
26	300741	华宝股份	4,281,361.00	4.12
27	600577	精达股份	4,164,024.00	4.01
28	002585	双星新材	4,156,004.00	4.00
29	603123	翠微股份	4,119,389.00	3.97
30	600491	龙元建设	4,041,349.00	3.89
31	002291	遥望科技	4,038,509.00	3.89
32	603169	兰石重装	4,003,456.00	3.86
33	600276	恒瑞医药	3,989,288.00	3.84

34	300573	兴齐眼药	3,848,745.20	3.71
35	603328	依顿电子	3,843,116.00	3.70
36	00981	中芯国际	3,827,961.01	3.69
37	000338	潍柴动力	3,787,402.00	3.65
38	300098	高新兴	3,768,306.54	3.63
39	600770	综艺股份	3,767,083.00	3.63
40	300080	易成新能	3,732,388.60	3.60
41	002048	宁波华翔	3,730,998.00	3.59
42	600601	方正科技	3,727,793.00	3.59
43	300303	聚飞光电	3,646,936.10	3.51
44	603132	金徽股份	3,612,946.00	3.48
45	600105	永鼎股份	3,611,759.00	3.48
46	002239	奥特佳	3,607,443.00	3.48
47	688161	威高骨科	3,568,614.73	3.44
48	002099	海翔药业	3,560,768.00	3.43
49	300587	天铁股份	3,536,768.86	3.41
50	002461	珠江啤酒	3,521,491.00	3.39
51	603489	八方股份	3,514,833.00	3.39
52	300263	隆华科技	3,514,461.00	3.39
53	601677	明泰铝业	3,497,441.00	3.37
54	601088	中国神华	3,449,086.00	3.32
55	000568	泸州老窖	3,431,347.00	3.31
56	002815	崇达技术	3,425,158.00	3.30
57	002434	万里扬	3,396,910.00	3.27
58	300382	斯莱克	3,380,520.00	3.26
59	688617	惠泰医疗	3,367,422.52	3.24
60	002202	金风科技	3,362,726.00	3.24
61	000727	冠捷科技	3,342,355.00	3.22
62	000560	我爱我家	3,317,328.00	3.20
63	300134	大富科技	3,317,023.00	3.20
64	002724	海洋王	3,293,462.00	3.17
65	002038	双鹭药业	3,292,563.00	3.17
66	600667	太极实业	3,291,039.00	3.17
67	688575	亚辉龙	3,283,673.02	3.16
68	300170	汉得信息	3,264,783.00	3.15
69	000100	TCL 科技	3,226,908.00	3.11
70	300579	数字认证	3,209,961.00	3.09
71	000333	美的集团	3,189,001.00	3.07
72	688206	概伦电子	3,148,320.29	3.03
73	601137	博威合金	3,126,219.00	3.01
74	301268	铭利达	3,107,617.00	2.99
75	603915	国茂股份	3,107,523.84	2.99
76	002519	银河电子	3,057,854.00	2.95
77	603569	长久物流	3,040,701.05	2.93

78	000969	安泰科技	3,039,781.00	2.93
79	300408	三环集团	3,037,069.00	2.93
80	002063	远光软件	3,028,341.00	2.92
81	688380	中微半导	3,018,384.14	2.91
82	688733	壹石通	3,017,300.57	2.91
83	002436	兴森科技	2,998,707.00	2.89
84	000795	英洛华	2,996,022.00	2.89
85	600309	万华化学	2,990,457.00	2.88
86	002489	浙江永强	2,989,404.00	2.88
87	600572	康恩贝	2,988,057.00	2.88
88	601777	力帆科技	2,987,683.36	2.88
89	601211	国泰君安	2,986,791.00	2.88
90	300180	华峰超纤	2,985,251.00	2.88
91	002773	康弘药业	2,979,424.00	2.87
92	000813	德展健康	2,979,331.00	2.87
93	300887	谱尼测试	2,966,673.39	2.86
94	002851	麦格米特	2,966,614.00	2.86
95	300593	新雷能	2,946,414.00	2.84
96	002068	黑猫股份	2,923,814.00	2.82
97	600012	皖通高速	2,913,642.00	2.81
98	603393	新天然气	2,912,442.00	2.81
99	002027	分众传媒	2,885,878.00	2.78
100	301015	百洋医药	2,884,733.00	2.78
101	002697	红旗连锁	2,880,563.00	2.78
102	600330	天通股份	2,877,990.00	2.77
103	002415	海康威视	2,873,464.00	2.77
104	002782	可立克	2,868,981.50	2.76
105	688111	金山办公	2,865,282.89	2.76
106	002498	汉缆股份	2,858,542.92	2.75
107	601600	中国铝业	2,800,758.00	2.70
108	603283	赛腾股份	2,796,080.00	2.69
109	605365	立达信	2,778,000.00	2.68
110	600372	中航机载	2,777,981.76	2.68
111	002276	万马股份	2,777,470.00	2.68
112	000858	五粮液	2,762,579.00	2.66
113	300775	三角防务	2,759,577.00	2.66
114	002428	云南锗业	2,756,242.00	2.66
115	300476	胜宏科技	2,740,143.00	2.64
116	301286	侨源股份	2,707,881.44	2.61
117	601138	工业富联	2,707,853.00	2.61
118	600163	中闽能源	2,694,922.00	2.60
119	002534	西子洁能	2,692,807.00	2.59
120	300369	绿盟科技	2,692,719.00	2.59
121	603171	税友股份	2,691,383.00	2.59

122	601811	新华文轩	2,686,534.00	2.59
123	688289	圣湘生物	2,683,672.72	2.59
124	605376	博迁新材	2,679,539.00	2.58
125	603105	芯能科技	2,675,226.00	2.58
126	002283	天润工业	2,661,420.00	2.56
127	600556	天下秀	2,655,918.00	2.56
128	603259	药明康德	2,646,755.00	2.55
129	002573	清新环境	2,644,008.00	2.55
130	300319	麦捷科技	2,631,083.00	2.53
131	600366	宁波韵升	2,596,303.00	2.50
132	002937	兴瑞科技	2,582,619.40	2.49
133	600361	创新新材	2,582,543.00	2.49
134	000651	格力电器	2,573,168.00	2.48
135	600478	科力远	2,572,368.00	2.48
136	300857	协创数据	2,568,929.00	2.47
137	601279	英利汽车	2,545,371.00	2.45
138	601669	中国电建	2,531,629.00	2.44
139	300140	节能环境	2,527,156.00	2.43
140	600641	万业企业	2,519,193.00	2.43
141	002594	比亚迪	2,486,676.00	2.40
142	002201	正威新材	2,472,213.00	2.38
143	000682	东方电子	2,464,126.00	2.37
144	600312	平高电气	2,436,519.00	2.35
145	600225	卓朗科技	2,436,308.00	2.35
146	601333	广深铁路	2,428,840.27	2.34
147	000650	仁和药业	2,427,950.00	2.34
148	601702	华峰铝业	2,423,590.00	2.33
149	601989	中国重工	2,413,266.00	2.33
150	603013	亚普股份	2,410,618.00	2.32
151	600566	济川药业	2,395,897.00	2.31
152	600025	华能水电	2,394,778.00	2.31
153	601857	中国石油	2,392,176.20	2.30
154	002540	亚太科技	2,391,929.80	2.30
155	688586	江航装备	2,386,208.74	2.30
156	002139	拓邦股份	2,385,443.06	2.30
157	688041	海光信息	2,378,400.10	2.29
158	002516	旷达科技	2,377,476.00	2.29
159	600780	通宝能源	2,376,130.16	2.29
160	002701	奥瑞金	2,375,468.00	2.29
161	002212	天融信	2,365,647.00	2.28
162	002215	诺普信	2,335,231.00	2.25
163	300451	创业慧康	2,329,429.00	2.24
164	002866	传艺科技	2,315,209.00	2.23
165	601766	中国中车	2,312,306.00	2.23

166	002307	北新路桥	2,302,914.00	2.22
167	000016	深康佳 A	2,300,320.00	2.22
168	600795	国电电力	2,291,799.00	2.21
169	301180	万祥科技	2,288,503.00	2.20
170	688315	诺禾致源	2,287,384.38	2.20
171	002837	英维克	2,284,659.00	2.20
172	002265	建设工业	2,278,001.00	2.19
173	600741	华域汽车	2,276,130.00	2.19
174	000837	秦川机床	2,268,111.00	2.19
175	300123	亚光科技	2,261,589.00	2.18
176	688001	华兴源创	2,261,320.32	2.18
177	300674	宇信科技	2,253,884.68	2.17
178	600104	上汽集团	2,253,482.00	2.17
179	603936	博敏电子	2,245,670.00	2.16
180	300760	迈瑞医疗	2,241,900.00	2.16
181	000848	承德露露	2,234,076.00	2.15
182	601099	太平洋	2,227,993.00	2.15
183	688432	有研硅	2,226,065.59	2.14
184	601311	骆驼股份	2,224,259.00	2.14
185	300348	长亮科技	2,223,917.99	2.14
186	002264	新华都	2,207,265.00	2.13
187	600999	招商证券	2,205,584.00	2.12
188	002581	未名医药	2,197,189.00	2.12
189	603298	杭叉集团	2,193,486.00	2.11
190	002583	海能达	2,190,322.00	2.11
191	000950	重药控股	2,184,622.00	2.10
192	002034	旺能环境	2,163,724.58	2.08
193	600996	贵广网络	2,162,912.00	2.08
194	600039	四川路桥	2,162,827.20	2.08
195	603256	宏和科技	2,158,981.00	2.08
196	603277	银都股份	2,154,540.00	2.08
197	600869	远东股份	2,151,542.00	2.07
198	600660	福耀玻璃	2,144,962.00	2.07
199	002645	华宏科技	2,142,269.00	2.06
200	600320	振华重工	2,131,774.00	2.05
201	605338	巴比食品	2,122,965.00	2.05
202	001236	弘业期货	2,120,333.00	2.04
203	600971	恒源煤电	2,115,690.00	2.04
204	000811	冰轮环境	2,105,026.55	2.03
205	600409	三友化工	2,101,129.00	2.02
206	600718	东软集团	2,094,292.26	2.02
207	300457	赢合科技	2,081,120.00	2.01
208	600436	片仔癀	2,078,213.00	2.00
209	002142	宁波银行	2,077,224.00	2.00

210	000875	吉电股份	2,076,845.00	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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	15,857,500.80	15.28
2	601398	工商银行	12,465,859.00	12.01
3	601318	中国平安	11,073,832.30	10.67
4	600036	招商银行	10,515,023.40	10.13
5	600900	长江电力	8,222,439.07	7.92
6	600887	伊利股份	8,057,401.00	7.76
7	600028	中国石化	6,786,612.80	6.54
8	600050	中国联通	6,447,696.80	6.21
9	601166	兴业银行	6,305,693.40	6.08
10	600030	中信证券	5,811,802.55	5.60
11	601988	中国银行	5,799,969.80	5.59
12	000725	京东方 A	5,573,554.40	5.37
13	601288	农业银行	5,564,441.00	5.36
14	601728	中国电信	5,406,460.40	5.21
15	601668	中国建筑	5,263,195.40	5.07
16	600809	山西汾酒	5,174,153.40	4.98
17	601899	紫金矿业	5,141,317.00	4.95
18	002549	凯美特气	4,964,320.30	4.78
19	600406	国电南瑞	4,878,321.40	4.70
20	300750	宁德时代	4,670,832.00	4.50
21	600919	江苏银行	4,603,489.02	4.44
22	300741	华宝股份	4,548,567.00	4.38
23	002015	协鑫能科	4,513,987.00	4.35
24	600690	海尔智家	4,474,221.00	4.31
25	600770	综艺股份	4,181,707.20	4.03
26	600276	恒瑞医药	4,140,988.40	3.99
27	688235	百济神州	4,125,074.21	3.97
28	002291	遥望科技	4,097,905.20	3.95
29	002585	双星新材	4,052,277.00	3.90
30	002219	新里程	4,025,420.40	3.88
31	600667	太极实业	4,000,762.00	3.85
32	600491	龙元建设	3,970,192.00	3.82
33	603169	兰石重装	3,957,991.84	3.81
34	603123	翠微股份	3,893,667.09	3.75

35	603132	金徽股份	3,814,849.00	3.68
36	002099	海翔药业	3,735,256.85	3.60
37	300098	高新兴	3,734,082.86	3.60
38	002239	奥特佳	3,655,344.00	3.52
39	600601	方正科技	3,586,603.17	3.46
40	000560	我爱我家	3,576,303.00	3.45
41	300587	天铁股份	3,517,375.10	3.39
42	603328	依顿电子	3,511,311.80	3.38
43	002815	崇达技术	3,504,606.00	3.38
44	000338	潍柴动力	3,486,624.20	3.36
45	300303	聚飞光电	3,458,714.00	3.33
46	300263	隆华科技	3,428,273.55	3.30
47	002461	珠江啤酒	3,400,950.67	3.28
48	300080	易成新能	3,399,294.39	3.27
49	002202	金风科技	3,361,194.40	3.24
50	688617	惠泰医疗	3,331,904.35	3.21
51	300319	麦捷科技	3,328,466.00	3.21
52	300134	大富科技	3,306,870.00	3.19
53	000100	TCL 科技	3,276,831.00	3.16
54	600105	永鼎股份	3,266,090.82	3.15
55	000568	泸州老窖	3,244,062.20	3.13
56	688161	威高骨科	3,239,113.88	3.12
57	002027	分众传媒	3,203,778.48	3.09
58	002434	万里扬	3,188,981.08	3.07
59	300579	数字认证	3,174,203.66	3.06
60	002038	双鹭药业	3,138,684.85	3.02
61	300170	汉得信息	3,119,834.00	3.01
62	600330	天通股份	3,113,424.90	3.00
63	603915	国茂股份	3,111,916.95	3.00
64	002724	海洋王	3,106,112.52	2.99
65	601088	中国神华	3,072,097.80	2.96
66	300123	亚光科技	3,067,966.50	2.96
67	000727	冠捷科技	3,059,460.12	2.95
68	002516	旷达科技	3,054,494.10	2.94
69	000969	安泰科技	3,053,706.50	2.94
70	300408	三环集团	3,029,965.40	2.92
71	603489	八方股份	3,002,153.50	2.89
72	300593	新雷能	2,984,236.82	2.88
73	002063	远光软件	2,979,678.80	2.87
74	300382	斯莱克	2,965,212.50	2.86
75	002519	银河电子	2,961,440.91	2.85
76	301268	铭利达	2,957,397.50	2.85
77	600372	中航机载	2,930,450.80	2.82
78	603569	长久物流	2,921,557.18	2.81

79	600478	科力远	2,912,536.00	2.81
80	002489	浙江永强	2,909,274.36	2.80
81	601777	力帆科技	2,901,380.23	2.80
82	600572	康恩贝	2,897,898.98	2.79
83	002534	西子洁能	2,882,904.55	2.78
84	000813	德展健康	2,882,470.40	2.78
85	688206	概伦电子	2,880,388.41	2.78
86	300180	华峰超纤	2,859,321.54	2.75
87	688380	中微半导	2,844,427.30	2.74
88	300887	谱尼测试	2,832,299.50	2.73
89	002428	云南锗业	2,827,606.00	2.72
90	000333	美的集团	2,826,251.20	2.72
91	600163	中闽能源	2,808,997.40	2.71
92	600577	精达股份	2,808,825.00	2.71
93	000035	中国天楹	2,781,930.25	2.68
94	002068	黑猫股份	2,764,461.94	2.66
95	002436	兴森科技	2,752,928.75	2.65
96	605365	立达信	2,749,565.00	2.65
97	601211	国泰君安	2,733,209.60	2.63
98	601857	中国石油	2,722,329.04	2.62
99	002498	汉缆股份	2,707,293.34	2.61
100	301015	百洋医药	2,703,206.00	2.60
101	688733	壹石通	2,700,367.00	2.60
102	002782	可立克	2,699,282.50	2.60
103	600556	天下秀	2,694,193.00	2.60
104	600309	万华化学	2,672,396.40	2.57
105	002415	海康威视	2,662,520.00	2.57
106	301286	侨源股份	2,657,000.05	2.56
107	605376	博迁新材	2,642,600.25	2.55
108	002937	兴瑞科技	2,633,635.04	2.54
109	002201	正威新材	2,627,244.98	2.53
110	601600	中国铝业	2,620,603.40	2.52
111	600718	东软集团	2,616,549.22	2.52
112	002276	万马股份	2,611,584.70	2.52
113	002283	天润工业	2,594,543.50	2.50
114	603105	芯能科技	2,590,450.63	2.50
115	603259	药明康德	2,589,565.00	2.49
116	600641	万业企业	2,553,228.40	2.46
117	601279	英利汽车	2,546,211.00	2.45
118	000651	格力电器	2,538,009.40	2.45
119	603171	税友股份	2,533,238.00	2.44
120	002421	达实智能	2,523,749.95	2.43
121	601766	中国中车	2,509,714.00	2.42
122	000858	五粮液	2,497,155.00	2.41

123	688315	诺禾致源	2,481,459.11	2.39
124	002573	清新环境	2,478,330.50	2.39
125	002745	木林森	2,467,249.90	2.38
126	601677	明泰铝业	2,464,241.00	2.37
127	600225	卓朗科技	2,454,142.70	2.36
128	603936	博敏电子	2,453,093.00	2.36
129	002645	华宏科技	2,443,159.00	2.35
130	600361	创新新材	2,440,425.00	2.35
131	601669	中国电建	2,437,242.20	2.35
132	603013	亚普股份	2,426,524.00	2.34
133	002866	传艺科技	2,425,611.00	2.34
134	000650	仁和药业	2,415,605.90	2.33
135	688586	江航装备	2,410,637.94	2.32
136	002264	新华都	2,400,986.08	2.31
137	600780	通宝能源	2,369,929.00	2.28
138	300451	创业慧康	2,367,760.00	2.28
139	600999	招商证券	2,340,530.60	2.25
140	301087	可孚医疗	2,337,973.50	2.25
141	600869	远东股份	2,335,918.00	2.25
142	603256	宏和科技	2,331,287.00	2.25
143	002130	沃尔核材	2,325,556.50	2.24
144	000016	深康佳 A	2,324,417.99	2.24
145	300140	节能环境	2,296,052.30	2.21
146	601989	中国重工	2,286,207.00	2.20
147	300369	绿盟科技	2,282,369.08	2.20
148	002540	亚太科技	2,282,308.80	2.20
149	300573	兴齐眼药	2,273,928.43	2.19
150	600366	宁波韵升	2,272,266.00	2.19
151	301180	万祥科技	2,270,010.10	2.19
152	688575	亚辉龙	2,268,457.79	2.19
153	002212	天融信	2,260,041.50	2.18
154	601811	新华文轩	2,243,325.64	2.16
155	688432	有研硅	2,237,929.43	2.16
156	000837	秦川机床	2,233,632.00	2.15
157	000950	重药控股	2,233,303.95	2.15
158	600104	上汽集团	2,228,887.00	2.15
159	600776	东方通信	2,215,246.85	2.13
160	600025	华能水电	2,197,133.00	2.12
161	600490	鹏欣资源	2,187,453.00	2.11
162	002581	未名医药	2,185,313.50	2.11
163	002307	北新路桥	2,183,164.40	2.10
164	600312	平高电气	2,169,447.00	2.09
165	601099	太平洋	2,164,562.60	2.09
166	600996	贵广网络	2,144,922.50	2.07

167	600436	片仔癀	2,131,967.00	2.05
168	002145	中核钛白	2,125,757.20	2.05
169	002265	建设工业	2,118,405.00	2.04
170	688016	心脉医疗	2,108,545.93	2.03
171	001236	弘业期货	2,100,661.00	2.02
172	600741	华域汽车	2,091,430.60	2.01
173	00981	中芯国际	2,082,360.26	2.01
174	002544	普天科技	2,079,030.00	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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,814,612,381.54
卖出股票的收入（成交）总额	1,687,136,921.40

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	15,520,678.22	5.87
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	15,520,678.22	5.87

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019733	24 国债 02	60,000	6,064,384.11	2.29
2	019709	23 国债 16	50,000	5,078,075.34	1.92
3	019727	23 国债 24	43,000	4,378,218.77	1.66

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货投资根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。

本基金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，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。符合基金合同既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金合同，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 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。

7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 184,335,437.23 元，占基金资产净值的比例为 69.76%；

运用股指期货进行对冲的空头合约市值-176,620,080.00 元，占基金资产净值的比例为-66.84%，空头合约市值占股票资产的比例为-95.81%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为-5,590,810.03 元，公允价值变动损益为 4,306,001.61 元。

7.13 投资组合报告附注

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

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

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	21,447,916.24
2	应收清算款	9,104,887.53
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	24,384.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,577,188.38

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
海富通安益对冲混合 A	918	50,115.49	19,220,603.31	41.78%	26,785,413.05	58.22%
海富通安益对冲混合 C	1,491	136,472.03	100,120,780.36	49.20%	103,359,017.64	50.80%
合计	2,409	103,564.06	119,341,383.67	47.83%	130,144,430.69	52.17%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,A、C级比例分母为各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	海富通安益对冲混合 A	2,166,239.46	4.7086%
	海富通安益对冲混合 C	136,529.60	0.0671%
	合计	2,302,769.06	0.9230%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海富通安益对冲混合 A	>100
	海富通安益对冲混合 C	10~50
	合计	>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

9 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	9,516,887.82	452,179,300.14
减：本报告期基金总赎回份额	15,255,567.99	294,286,561.33
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	46,006,016.36	203,479,798.00

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
海通证券	2	1,005,566,734.81	28.72%	750,522.57	29.20%	-
国泰君安	2	890,681,622.64	25.44%	649,626.34	25.28%	-
招商证券	1	588,981,059.45	16.82%	433,436.56	16.87%	-
国金证券	1	393,084,412.49	11.23%	275,635.89	10.73%	-
华创证券	1	322,204,912.80	9.20%	237,115.64	9.23%	-
兴业证券	1	115,983,139.16	3.31%	86,506.50	3.37%	-
光大证券	1	106,770,336.58	3.05%	78,574.18	3.06%	-
中金公司	1	55,110,773.45	1.57%	41,107.59	1.60%	-
长江证券	1	20,290,633.56	0.58%	15,134.89	0.59%	-
太平洋证券	2	3,075,678.00	0.09%	2,263.46	0.09%	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

2、(1)交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉、研究水平和综合服务支持三个部分进行评议，形成证券公司交易单元租用意见。

(2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门内部讨论，形成证券公司交易单元租用意见，并报公司总经理办公会审议。

<2> 核准。在完成对证券公司的评估和审核后，由基金管理人的总经理办公会核准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总 额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
海通证券	17,518,007.00	38.34%	860,500.00	53.29%	-	-
国泰君安	13,699,562.00	29.98%	656,400.00	40.65%	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	52,700,000.00	3.26%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	1,502,378.00	3.29%	27,000,000.00	1.67%	-	-
长江证券	12,976,199.28	28.40%	18,000,000.00	1.11%	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

无

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 123 只公募基金。截至 2024 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1613 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联《上海证券报》颁发的“金基金·偏股混

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

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

2023 年 3 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获上海证券交易所颁发的“上交所 2022 年度债券旗舰 ETF”。2023 年 6 月，海富通收益增长证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”。2023 年 8 月，海富通荣获《上海证券报》颁发的“上证中国基金投教创新案例奖”。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通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它文件

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日