

海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金
2023 年年度报告
2023 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：二〇二四年三月二十九日

§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 2024 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 2023 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.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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.....	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19
§6 审计报告	20
6.1 审计意见.....	20
6.2 形成审计意见的基础.....	20
6.3 其他信息.....	20
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任.....	21
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任.....	21
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 净资产变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况.....	60
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.....	68

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	70
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	70
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	70
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	71
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
8.12 市场中性策略执行情况	71
8.13 投资组合报告附注	71
§9 基金份额持有人信息	72
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
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	73
§10 开放式基金份额变动	73
§11 重大事件揭示	74
11.1 基金份额持有人大会决议	74
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	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4 基金投资策略的改变	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
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	74
11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	74
11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8 其他重大事件	76
12 影响投资者决策的其他重要信息	77
§13 备查文件目录	79
13.1 备查文件目录	79
13.2 存放地点	79
13.3 查阅方式	79

§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	97,331,755.72 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	51,744,696.53 份	45,587,059.19 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	陆志俊
	联系电话	021-38650788	95559
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	luzj@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	2023 年		2022 年		2021 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	2,641,242.90	2,111,385.57	-6,926,686.22	-3,568,381.54	152,079,308.22	17,143,729.90
本期利润	4,859,147.48	4,735,283.37	-24,884,747.74	-14,007,248.03	57,739,613.01	3,881,791.57
加权平均基金份额本期利润	0.0542	0.0787	-0.0839	-0.0589	0.0405	0.0186
本期加权平均净值利润率	5.11%	7.55%	-8.05%	-5.71%	3.83%	1.76%
本期基金份额净值增长率	4.59%	4.16%	-3.51%	-3.89%	2.86%	2.44%

3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 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	3,852,420.77	2,611,825.31	3,325,089.47	2,816,798.39	56,146,545.89	24,200,802.29
期末可供分配基金份额利润	0.0745	0.0573	0.0273	0.0151	0.0647	0.0562
期末基金资产净值	55,597,117.30	48,198,884.50	124,969,473.03	189,574,630.44	924,272,148.48	455,090,892.69
期末基金份额净值	1.0745	1.0573	1.0273	1.0151	1.0647	1.0562
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 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	7.45%	5.73%	2.73%	1.51%	6.47%	5.62%

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	0.35%	0.29%	0.69%	0.01%	-0.34%	0.28%
过去六个月	2.19%	0.25%	1.38%	0.01%	0.81%	0.24%
过去一年	4.59%	0.27%	2.75%	0.01%	1.84%	0.26%
过去三年	3.81%	0.37%	8.48%	0.01%	-4.67%	0.36%
自基金合同生效起至今	7.45%	0.35%	11.30%	0.01%	-3.85%	0.34%

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	0.25%	0.29%	0.69%	0.01%	-0.44%	0.28%
过去六个月	1.99%	0.25%	1.38%	0.01%	0.61%	0.24%
过去一年	4.16%	0.27%	2.75%	0.01%	1.41%	0.26%
过去三年	2.55%	0.37%	8.48%	0.01%	-5.93%	0.36%
自基金合同生效起至今	5.73%	0.35%	11.30%	0.01%	-5.57%	0.34%

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

海富通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 2023 年 12 月 31 日)



2. 海富通安益对冲混合 C

(2020 年 1 月 22 日至 2023 年 12 月 31 日)



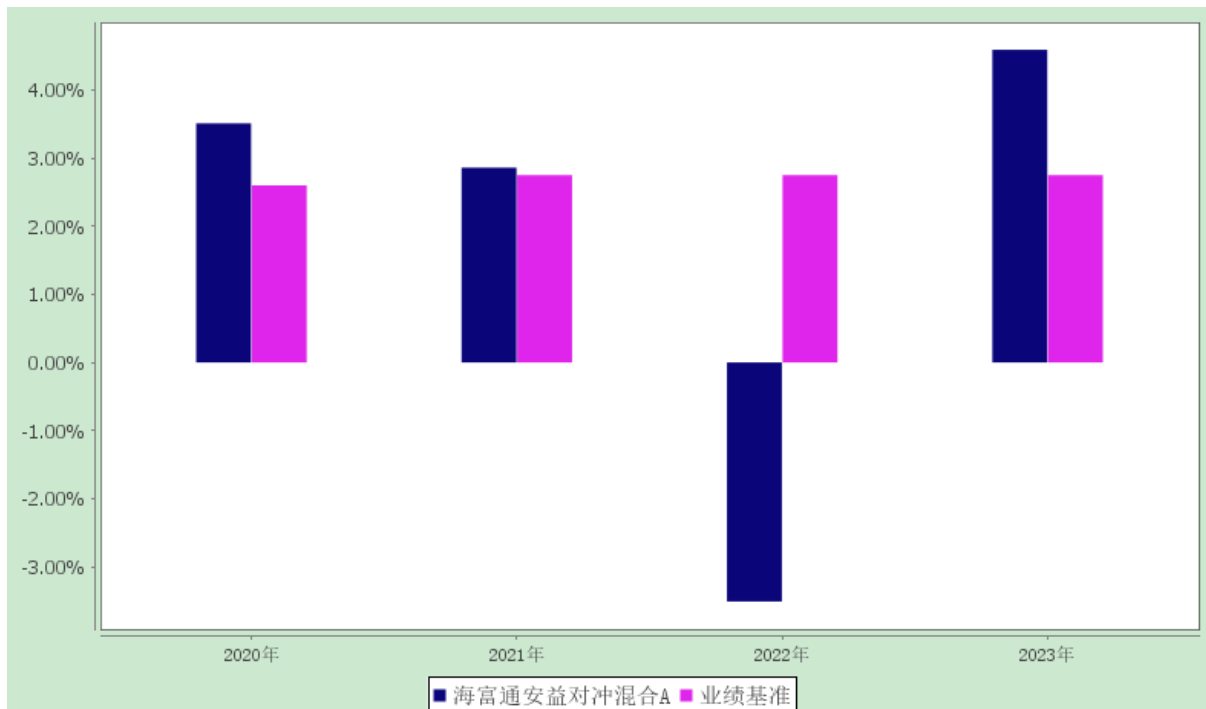
注：本基金合同于 2020 年 1 月 22 日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

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

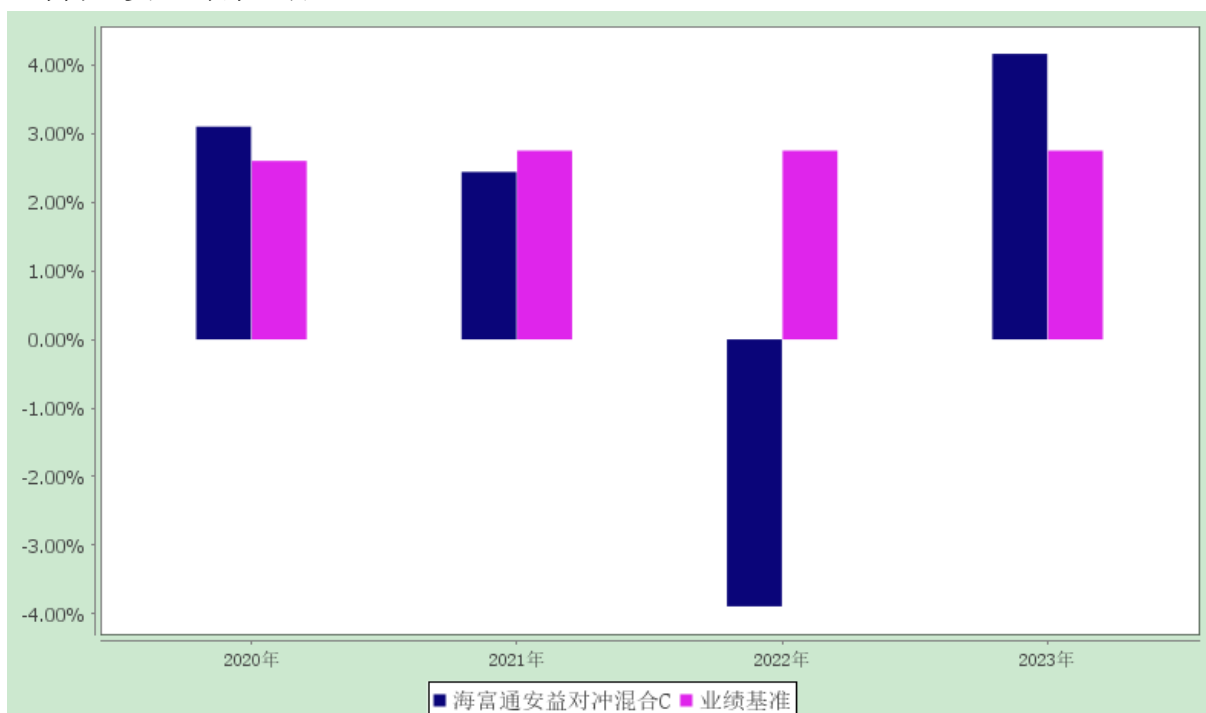
海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金

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
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 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
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 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 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 88 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、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券

型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通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。

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	-	16 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 月起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。
林立禾	本基金的基金经理助理	2023-07-20	2023-11-23	5 年	美国密歇根大学定量金融与风险管理硕士。历任中欧基金管理有限公司风险管理部量化风控岗。2020 年 8 月加入海富通基金管

					理有限公司，历任量化研究员、量化投资部基金经理助理。2023 年 11 月起任海富通欣益混合、海富通富利三个月持有、海富通沪深 300 增强的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2023 年股票部分超额收益较为出色。基金股票部分主要是中证 1000 增强策略，获得了约 10%左右的超额收益，并用中证 1000 股指期货套保，将超额收益转化为绝对收益。2023 年，我们在量化模型中运用了深度学习等人工智能技术，增强了量化模型的预测能力，提升了投资业绩。

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 4.59%，同期业绩比较基准收益率为 2.75%，基金净值跑赢业绩比较基准 1.84 个百分点。海富通安益对冲混合 C 净值增长率为 4.16%，同期业绩比较基准收益率为 2.75%，基金净值跑赢业绩比较基准 1.41 个百分点。

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，具体的下行速度、幅度需要具体跟踪。在这个背景下，美联储的具体降息操作将成为全球市场关注的一个焦点。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的脆弱和不足可能短期加剧经济的疲弱。不过，目前市场信心已在相对低位，监管层也在积极呵护市场，对经济的托底力度也有望进一步加强。我们对此依然怀抱着积极心态，积极跟踪国内政策和经济的变化。

展望 2024 年，我们会根据股指期货的负基差水平，灵活配置各种对冲策略，并不断改进模型，力争获得更好的业绩表现。投资策略上，我们会运用深度学习等人工智能技术，升级现有的量化模型，进一步提高组合的超额收益。另一方面，市场可能会比较波动，我们会做好风险控制，控制最大回撤，力争给投资者带来较好的投资体验。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 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、专项稽核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，健全内控体系，落实内控责任。

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，新增和修订了多项内部制度和流程，并持续倡导合规文化建设，提升了公司内部控制环境建设。

二、客观开展内外部内控评估，进一步完善内控措施。

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。针对上述内外部评估检查中发现的问题，公司相关业务部门均认真进行整改。通过及时跟踪落实各项问题的整改情况，严格控制了各部门的主要风险，加强并完善了公司的内部控制状况。

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及流程，组织多场反洗钱专项培训和宣传活动；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，全面升级反洗钱系统，持续优化监测模型，强化对大额交易和可疑交易方面的监控，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 2022 年度洗钱固有风险评估工作，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，提升反洗钱工作质效。

四、强化法规学习，组织开展内外部培训，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。另外，通过考试等方式检验培训效果，将法规落实到具体的业务、工作中。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 2400387 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 2023 年 12 月 31 日的资产负债表、2023 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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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 2023 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
 王国蓓 倪益
 北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
 2024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：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	4,591,013.92	12,526,078.26
结算备付金		4,962,855.56	25,366,110.51
存出保证金		8,090,727.48	22,249,837.26
交易性金融资产	7.4.7.2	82,321,562.06	203,331,610.95
其中：股票投资		75,185,558.77	196,213,384.99
基金投资		-	-
债券投资		7,136,003.29	7,118,225.96
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	-	-14,383.57
应收清算款		1,807,439.63	50,243,808.13
应收股利		-	-
应收申购款		10,464,680.61	2,080,601.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		112,238,279.26	315,783,663.38
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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		5,999,477.26	-
应付清算款		1,509,479.05	1.31
应付赎回款		63,242.59	81,933.27
应付管理人报酬		130,688.66	395,829.11
应付托管费		21,781.47	65,971.50
应付销售服务费		14,727.32	62,894.27
应付投资顾问费		-	-
应交税费		50,921.16	3,939.07
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	651,959.95	628,991.38
负债合计		8,442,277.46	1,239,559.91
净资产:			
实收基金	7.4.7.7	97,331,755.72	308,402,215.61
未分配利润	7.4.7.8	6,464,246.08	6,141,887.86
净资产合计		103,796,001.80	314,544,103.47
负债和净资产总计		112,238,279.26	315,783,663.38

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.0745 元，C 类基金份额净值 1.0573 元。基金份额总额 97,331,755.72 份，其中 A 类基金份额 51,744,696.53 份，C 类基金份额 45,587,059.19 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		12,705,824.64	-27,282,986.12
1.利息收入		386,529.19	2,247,349.71
其中：存款利息收入	7.4.7.9	303,889.17	2,024,647.52
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		82,640.02	222,702.19
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,342,124.83	-1,263,747.92
其中：股票投资收益	7.4.7.10	4,416,203.43	-114,608,598.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	218,029.30	1,348,610.25
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	1,468,850.91	108,242,406.35
股利收益	7.4.7.14	1,239,041.19	3,753,833.57
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	4,841,802.38	-28,396,928.01
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	135,368.24	130,340.10
减：二、营业总支出		3,111,393.79	11,609,009.65
1. 管理人报酬		2,241,168.86	8,558,933.96
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		373,528.19	1,426,488.99
3. 销售服务费		251,082.62	997,562.98
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		31,910.18	-
其中：卖出回购金融资产支出		31,910.18	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		5,741.92	407,160.03
8. 其他费用	7.4.7.17	207,962.02	218,863.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,594,430.85	-38,891,995.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,594,430.85	-38,891,995.77
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,594,430.85	-38,891,995.77

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合	未分配利润	净资产合计

		收益		
一、上期期末净资产	1,299,015,692.99	-	80,347,348.18	1,379,363,041.17
二、本期期初净资产	1,299,015,692.99	-	80,347,348.18	1,379,363,041.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-990,613,477.38	-	-74,205,460.32	-1,064,818,937.70
（一）、综合收益总额	-	-	-38,891,995.77	-38,891,995.77
（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）	-990,613,477.38	-	-35,313,464.55	-1,025,926,941.93
其中：1. 基金申购款	260,903,366.52	-	9,837,945.36	270,741,311.88
2. 基金赎回款	-1,251,516,843.90	-	-45,151,409.91	-1,296,668,253.81
（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	308,402,215.61	-	6,141,887.86	314,544,103.47

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 2024 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要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况、2023 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。

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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	4,591,013.92	12,526,078.26
等于：本金	4,590,073.29	12,522,667.79
加：应计利息	940.63	3,410.47
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	4,591,013.92	12,526,078.26

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		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
项目		上年度末			
		2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		203,228,703.61	-	196,213,384.99	-7,015,318.62
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,056,638.52	82,830.16	7,118,225.96	-21,242.72
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,056,638.52	82,830.16	7,118,225.96	-21,242.72
资产支持证券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	210,285,342.13	82,830.16	203,331,610.95	-7,036,561.34

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 2023 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	-67,593,303.07	-	-	-
——股指期货	-67,593,303.07	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-67,593,303.07	-	-	-
项目	上年度末 2022 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	-168,764,375.12	-	-	-
——股指期货	-168,764,375.12	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-168,764,375.12	-	-	-

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
IM2406	IM2406	-58.00	-66,811,360.00	781,943.07
合计	-	-	-	781,943.07
减：可抵销期货 暂收款	-	-	-	781,943.07
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 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	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-14,383.57	-
银行间市场	-	-
合计	-14,383.57	-

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1.75	-
应付证券出借违约金	-	-

应付交易费用	481,958.20	448,991.38
其中：交易所市场	481,958.20	448,991.38
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	180,000.00
合计	651,959.95	628,991.38

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 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	121,644,383.56	121,644,383.56
本期申购	2,052,771.31	2,052,771.31
本期赎回（以“-”号填列）	-71,952,458.34	-71,952,458.34
本期末	51,744,696.53	51,744,696.53

海富通安益对冲混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	186,757,832.05	186,757,832.05
本期申购	99,653,199.13	99,653,199.13
本期赎回（以“-”号填列）	-240,823,971.99	-240,823,971.99
本期末	45,587,059.19	45,587,059.19

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	16,100,998.49	-12,775,909.02	3,325,089.47
本期期初	16,100,998.49	-12,775,909.02	3,325,089.47
本期利润	2,641,242.90	2,217,904.58	4,859,147.48
本期基金份额交易产生的变动数	-10,345,439.99	6,013,623.81	-4,331,816.18
其中：基金申购款	321,911.23	-177,720.34	144,190.89
基金赎回款	-10,667,351.22	6,191,344.15	-4,476,007.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,396,801.40	-4,544,380.63	3,852,420.77

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	22,219,178.78	-19,402,380.39	2,816,798.39
本期期初	22,219,178.78	-19,402,380.39	2,816,798.39
本期利润	2,111,385.57	2,623,897.80	4,735,283.37
本期基金份额交易产生的变动数	-17,746,416.49	12,806,160.04	-4,940,256.45
其中：基金申购款	12,991,115.59	-8,687,377.36	4,303,738.23
基金赎回款	-30,737,532.08	21,493,537.40	-9,243,994.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,584,147.86	-3,972,322.55	2,611,825.31

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
活期存款利息收入	61,125.94	314,462.66
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	237,731.61	1,704,121.79
其他	5,031.62	6,063.07

合计	303,889.17	2,024,647.52
----	------------	--------------

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,330,713,680.80	2,322,378,028.04
减：卖出股票成本总额	1,323,072,303.89	2,431,261,451.48
减：交易费用	3,225,173.48	5,725,174.65
买卖股票差价收入	4,416,203.43	-114,608,598.09

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 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	159,602.03	624,870.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	58,427.27	723,739.56
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	218,029.30	1,348,610.25

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 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,853,480.15	106,546,718.66
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,590,679.43	104,519,521.86
减：应计利息总额	203,933.17	1,303,205.96
减：交易费用	440.28	251.28
买卖债券差价收入	58,427.27	723,739.56

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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股指期货投资收益（税前）	1,557,572.05	111,762,348.14
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	45,366.18	3,386,764.21
减：交易费用	43,354.96	133,177.58
合计	1,468,850.91	108,242,406.35

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,239,041.19	3,753,833.57
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	1,239,041.19	3,753,833.57

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	7,216,334.43	-38,130,379.87
——股票投资	7,206,151.71	-38,018,790.50
——债券投资	10,182.72	-111,589.37
——资产支持证券投资	-	-

——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-2,374,532.05	9,733,451.86
——权证投资	-	-
——股指期货	-2,374,532.05	9,733,451.86
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	4,841,802.38	-28,396,928.01

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
基金赎回费收入	134,633.79	130,332.70
基金转换费收入	734.45	7.40
合计	135,368.24	130,340.10

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
审计费用	50,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
证券组合费	297.02	398.69
银行划款手续费	465.00	1,265.00
其他费用	1,200.00	1,200.00
债券托管账户维护费	36,000.00	36,000.00
合计	207,962.02	218,863.69

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

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	356,295,438.95	14.12%	1,553,756,019.37	38.44%

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 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 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	267,317.73	14.43%	39,887.14	8.28%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	1,135,134.69	38.67%	120,571.79	26.85%

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。

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 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,241,168.86	8,558,933.96
其中：应支付销售机构的客户维护 费	396,921.34	1,077,700.96
应支付基金管理人的净管理费	1,844,247.52	7,481,233.00

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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	373,528.19	1,426,488.99

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		
	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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年1月1日至2022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	-	4,912.92	4,912.92
海通证券	-	5,572.72	5,572.72

海富通	-	731,704.27	731,704.27
合计	-	742,189.91	742,189.91

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 × 0.40% / 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 2023年1月1日至2023年12月31 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	49,218,738.86	-	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：报告期内赎回/卖出总份额	30,000,000.00	-	-	-
报告期末持有的基金份额	19,218,738.86	-	49,218,738.86	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	37.14%	-	40.46%	-

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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	4,591,013.92	61,125.94	12,526,078.26	314,462.66

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 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
上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	688234	天岳先进	网下发行	6,759	559,577.61
海通证券	688259	创耀科技	网下发行	1,595	106,227.00
海通证券	301228	实朴检测	网下发行	3,721	74,717.68

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（2023 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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2023 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 5,999,477.26 元，于 2024 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 2023 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（2022 年 12 月 31 日：0.01%）。

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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	7,136,003.29	-
合计	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。

7.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	27,699.66
未评级	-	7,090,526.30
合计	-	7,118,225.96

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。

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上市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 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
上年度末 2022 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	12,526,078.26	-	-	-	12,526,078.26
结算备付金	25,366,110.51	-	-	-	25,366,110.51
存出保证金	151,290.10	-	-	22,098,547.16	22,249,837.26

交易性金融资产	7,090,526.30	-	27,699.66	196,213,384.99	203,331,610.95
买入返售金融资产	-14,383.57	-	-	-	-14,383.57
应收清算款	-	-	-	50,243,808.13	50,243,808.13
应收申购款	-	-	-	2,080,601.84	2,080,601.84
资产总计	45,119,621.60	-	27,699.66	270,636,342.12	315,783,663.38
负债					
应付清算款	-	-	-	1.31	1.31
应付赎回款	-	-	-	81,933.27	81,933.27
应付管理人报酬	-	-	-	395,829.11	395,829.11
应付托管费	-	-	-	65,971.50	65,971.50
应付销售服务费	-	-	-	62,894.27	62,894.27
应交税费	-	-	-	3,939.07	3,939.07
其他负债	-	-	-	628,991.38	628,991.38
负债总计	-	-	-	1,239,559.91	1,239,559.91
利率敏感度缺口	45,119,621.60	-	27,699.66	269,396,782.21	314,544,103.47

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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-805.78	-9,057.85
	市场利率下降 25 个基点	807.88	9,097.00

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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 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	-	-	-
项目	上年度末 2022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	-	6,028,813.22	6,028,813.22
资产合计	-	6,028,813.22	6,028,813.22
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	-	6,028,813.22	6,028,813.22

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。

7.4.13.4.2.2 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	-	301,440.66
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-	-301,440.66	

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和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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 2023年12月31日		上年度末 2022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	75,185,558.77	72.44	196,213,384.99	62.38
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	75,185,558.77	72.44	196,213,384.99	62.38

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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	60,370.52	2,031,158.94
2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-60,370.52	-2,031,158.94	

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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	75,185,558.77	194,967,353.87
第二层次	7,136,003.29	7,586,607.40
第三层次	-	777,649.68
合计	82,321,562.06	203,331,610.95

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。

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 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	-	-	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	2,745,306.10	2,745,306.10
转出第三层次	-	2,201,286.64	2,201,286.64
当期利得或损失总额	-	233,630.22	233,630.22
其中：计入损益的利得或损失	-	233,630.22	233,630.22
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	777,649.68	777,649.68
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	-	20,112.35	20,112.35

注：于2023年12月31日，本基金未持有第三层次的交易性金融资产（2022年12月31日：持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资）。于2023年度，本基金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（2022年度：同）。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。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	777,649.68	亚式期权模型	预期年化波动率	20.63%~247.56%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2022 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	75,185,558.77	66.99
	其中：股票	75,185,558.77	66.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,136,003.29	6.36
	其中：债券	7,136,003.29	6.36

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,553,869.48	8.51
8	其他各项资产	20,362,847.72	18.14
9	合计	112,238,279.26	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	56,205.00	0.05
B	采矿业	1,096,287.00	1.06
C	制造业	51,239,326.27	49.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,690,110.00	1.63
E	建筑业	2,545,493.00	2.45
F	批发和零售业	1,559,223.50	1.50
G	交通运输、仓储和邮政业	255,408.00	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,757,390.00	8.44
J	金融业	694,251.00	0.67
K	房地产业	879,954.00	0.85
L	租赁和商务服务业	1,900,512.00	1.83
M	科学研究和技术服务业	2,337,006.00	2.25
N	水利、环境和公共设施管理业	1,124,759.00	1.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	220,038.00	0.21

S	综合	829,596.00	0.80
	合计	75,185,558.77	72.44

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	603530	神马电力	64,100	1,329,434.00	1.28
2	688617	惠泰医疗	2,600	1,010,100.00	0.97
3	002130	沃尔核材	108,000	815,400.00	0.79
4	000035	中国天楹	162,600	803,244.00	0.77
5	300088	长信科技	114,700	767,343.00	0.74
6	600312	平高电气	60,200	763,938.00	0.74
7	600770	综艺股份	155,100	761,541.00	0.73
8	300639	凯普生物	81,400	760,276.00	0.73
9	300319	麦捷科技	78,800	759,632.00	0.73
10	688188	柏楚电子	3,000	759,330.00	0.73
11	605369	拱东医疗	13,600	759,152.00	0.73
12	002171	楚江新材	101,450	758,846.00	0.73
13	603328	依顿电子	93,100	758,765.00	0.73
14	002516	旷达科技	153,100	754,783.00	0.73
15	002195	岩山科技	244,700	751,229.00	0.72
16	300123	亚光科技	102,300	749,859.00	0.72
17	301047	义翘神州	9,100	749,840.00	0.72
18	002544	普天科技	36,900	749,808.00	0.72
19	000990	诚志股份	91,100	747,931.00	0.72
20	600206	有研新材	59,400	735,966.00	0.71
21	000901	航天科技	78,800	734,416.00	0.71
22	000061	农产品	112,500	727,875.00	0.70
23	002163	海南发展	80,000	726,400.00	0.70
24	600161	天坛生物	22,700	702,338.00	0.68
25	603300	华铁应急	108,700	695,680.00	0.67
26	002537	海联金汇	104,300	694,638.00	0.67
27	002206	海利得	137,000	687,740.00	0.66
28	002390	信邦制药	154,800	687,312.00	0.66
29	600667	太极实业	97,400	684,722.00	0.66
30	002891	中宠股份	25,100	661,385.00	0.64

31	000612	焦作万方	114,200	656,650.00	0.63
32	002421	达实智能	199,900	643,678.00	0.62
33	600216	浙江医药	59,500	638,435.00	0.62
34	600184	光电股份	54,100	618,363.00	0.60
35	002745	木林森	70,200	607,932.00	0.59
36	301095	广立微	8,100	605,313.00	0.58
37	600718	东软集团	64,200	593,850.00	0.57
38	603707	健友股份	39,300	589,500.00	0.57
39	601567	三星医疗	28,500	584,250.00	0.56
40	301062	上海艾录	53,500	578,870.00	0.56
41	603393	新天然气	18,000	550,260.00	0.53
42	603055	台华新材	45,600	549,024.00	0.53
43	002003	伟星股份	49,800	540,330.00	0.52
44	603556	海兴电力	18,400	534,152.00	0.51
45	300344	立方数科	93,000	529,170.00	0.51
46	688333	铂力特	4,300	498,370.00	0.48
47	688315	诺禾致源	20,900	487,806.00	0.47
48	600691	阳煤化工	149,800	480,858.00	0.46
49	600863	内蒙华电	122,900	479,310.00	0.46
50	600750	江中药业	22,900	478,152.00	0.46
51	688425	铁建重工	120,400	477,988.00	0.46
52	002196	方正电机	66,200	475,316.00	0.46
53	002274	华昌化工	62,900	474,895.00	0.46
54	600595	中孚实业	133,200	463,536.00	0.45
55	002403	爱仕达	53,900	461,384.00	0.44
56	600710	苏美达	64,700	458,723.00	0.44
57	603636	南威软件	35,500	455,110.00	0.44
58	688300	联瑞新材	8,500	450,075.00	0.43
59	600550	保变电气	89,900	438,712.00	0.42
60	688020	方邦股份	8,900	431,472.00	0.42
61	300741	华宝股份	20,100	430,341.00	0.41
62	600612	老凤祥	6,200	427,800.00	0.41
63	300224	正海磁材	36,500	427,780.00	0.41
64	600169	太原重工	174,900	412,764.00	0.40
65	301361	众智科技	17,100	407,664.00	0.39
66	600037	歌华有线	52,700	407,371.00	0.39
67	000937	冀中能源	56,300	401,982.00	0.39
68	000062	深圳华强	35,600	401,212.00	0.39
69	300009	安科生物	38,700	395,514.00	0.38
70	001696	宗申动力	59,600	395,148.00	0.38
71	002091	江苏国泰	49,800	389,934.00	0.38
72	300893	松原股份	13,200	385,836.00	0.37
73	000517	荣安地产	157,000	384,650.00	0.37
74	002444	巨星科技	17,000	382,840.00	0.37

75	600586	金晶科技	55,400	370,072.00	0.36
76	688097	博众精工	11,000	369,600.00	0.36
77	002028	思源电气	7,100	369,484.00	0.36
78	600126	杭钢股份	67,500	359,775.00	0.35
79	301051	信濠光电	5,600	356,552.00	0.34
80	000928	中钢国际	60,300	351,549.00	0.34
81	002405	四维图新	38,600	343,540.00	0.33
82	000504	南华生物	28,800	334,080.00	0.32
83	002838	道恩股份	26,000	333,060.00	0.32
84	688575	亚辉龙	14,300	327,041.00	0.32
85	600637	东方明珠	42,300	318,096.00	0.31
86	300497	富祥药业	33,100	309,816.00	0.30
87	601702	华峰铝业	17,100	306,945.00	0.30
88	601886	江河集团	46,000	306,360.00	0.30
89	601609	金田股份	45,000	304,650.00	0.29
90	002145	中核钛白	67,400	301,952.00	0.29
91	688508	芯朋微	6,100	300,181.00	0.29
92	301087	可孚医疗	7,900	299,410.00	0.29
93	002201	正威新材	41,200	297,876.00	0.29
94	300398	飞凯材料	18,900	297,864.00	0.29
95	603601	再升科技	68,500	294,550.00	0.28
96	600201	生物股份	27,300	294,021.00	0.28
97	002918	蒙娜丽莎	21,700	293,818.00	0.28
98	300247	融捷健康	82,500	293,700.00	0.28
99	603588	高能环境	44,900	293,646.00	0.28
100	300284	苏交科	53,700	292,665.00	0.28
101	601918	新集能源	55,200	290,904.00	0.28
102	000791	甘肃能源	52,000	289,640.00	0.28
103	300451	创业慧康	44,200	289,510.00	0.28
104	605589	圣泉集团	12,900	288,702.00	0.28
105	002215	诺普信	34,800	287,448.00	0.28
106	688661	和林微纳	6,100	279,502.00	0.27
107	600997	开滦股份	36,600	279,258.00	0.27
108	300551	古鳌科技	15,900	276,660.00	0.27
109	301200	大族数控	7,300	275,721.00	0.27
110	688100	威胜信息	9,300	268,956.00	0.26
111	600776	东方通信	23,600	266,444.00	0.26
112	002084	海鸥住工	66,200	263,476.00	0.25
113	000761	本钢板材	73,000	260,610.00	0.25
114	002139	拓邦股份	26,600	259,616.00	0.25
115	603713	密尔克卫	4,800	255,408.00	0.25
116	002741	光华科技	16,800	249,816.00	0.24
117	300296	利亚德	41,500	249,000.00	0.24
118	002534	西子洁能	19,600	244,804.00	0.24

119	603225	新凤鸣	16,800	238,560.00	0.23
120	300217	东方电热	44,200	237,796.00	0.23
121	300480	光力科技	10,900	232,715.00	0.22
122	600135	乐凯胶片	28,700	231,609.00	0.22
123	601139	深圳燃气	32,600	224,614.00	0.22
124	002739	万达电影	16,900	220,038.00	0.21
125	300253	卫宁健康	30,600	220,014.00	0.21
126	300821	东岳硅材	26,500	219,950.00	0.21
127	688420	美腾科技	8,500	219,640.00	0.21
128	002378	章源钨业	38,800	219,608.00	0.21
129	603013	亚普股份	12,700	219,456.00	0.21
130	001322	箭牌家居	18,500	219,410.00	0.21
131	600497	驰宏锌锗	43,400	219,170.00	0.21
132	601375	中原证券	57,200	219,076.00	0.21
133	002545	东方铁塔	30,600	218,790.00	0.21
134	002019	亿帆医药	14,800	218,744.00	0.21
135	002985	北摩高科	6,300	218,484.00	0.21
136	002085	万丰奥威	44,200	218,348.00	0.21
137	601233	桐昆股份	14,400	217,872.00	0.21
138	688175	高凌信息	7,800	217,854.00	0.21
139	600392	盛和资源	21,400	217,852.00	0.21
140	002027	分众传媒	34,400	217,408.00	0.21
141	600808	马钢股份	79,900	217,328.00	0.21
142	300613	富瀚微	5,100	216,444.00	0.21
143	688385	复旦微电	5,600	216,328.00	0.21
144	603936	博敏电子	20,700	216,108.00	0.21
145	002051	中工国际	26,500	215,180.00	0.21
146	002023	海特高新	23,500	213,850.00	0.21
147	000631	顺发恒业	64,300	213,476.00	0.21
148	002636	金安国纪	23,850	212,503.50	0.20
149	002546	新联电子	40,800	204,000.00	0.20
150	600901	江苏金租	41,300	199,892.00	0.19
151	301217	铜冠铜箔	16,800	199,248.00	0.19
152	301208	中亦科技	5,100	199,104.00	0.19
153	000563	陕国投 A	65,400	198,816.00	0.19
154	688016	心脉医疗	1,000	194,630.00	0.19
155	688133	泰坦科技	4,100	190,035.00	0.18
156	002488	金固股份	25,600	183,808.00	0.18
157	688578	艾力斯	4,300	179,138.00	0.17
158	002125	湘潭电化	16,700	178,523.00	0.17
159	603444	吉比特	700	171,584.00	0.17
160	600060	海信视像	8,200	171,380.00	0.17
161	300150	世纪瑞尔	33,600	162,960.00	0.16
162	688128	中国电研	7,900	162,108.00	0.16

163	601369	陕鼓动力	19,200	153,216.00	0.15
164	002724	海洋王	18,400	151,248.00	0.15
165	300595	欧普康视	6,600	149,028.00	0.14
166	300083	创世纪	23,500	148,755.00	0.14
167	688029	南微医学	1,535	148,588.00	0.14
168	000058	深赛格	20,700	148,419.00	0.14
169	002475	立讯精密	4,300	148,135.00	0.14
170	600861	北京人力	7,900	148,046.00	0.14
171	603529	爱玛科技	5,900	147,736.00	0.14
172	002646	天佑德酒	10,800	146,988.00	0.14
173	300681	英搏尔	7,600	146,452.00	0.14
174	000767	晋控电力	48,600	146,286.00	0.14
175	688626	翔宇医疗	2,700	143,883.00	0.14
176	603866	桃李面包	18,700	143,242.00	0.14
177	688739	成大生物	4,400	143,044.00	0.14
178	000019	深粮控股	18,900	142,506.00	0.14
179	301080	百普赛斯	2,400	141,456.00	0.14
180	002932	明德生物	6,100	140,117.00	0.13
181	601058	赛轮轮胎	11,900	139,825.00	0.13
182	600854	春兰股份	26,100	137,547.00	0.13
183	002298	中电兴发	23,700	136,512.00	0.13
184	002191	劲嘉股份	25,200	135,324.00	0.13
185	603229	奥翔药业	10,200	134,742.00	0.13
186	002452	长高电新	17,900	127,090.00	0.12
187	600320	振华重工	38,100	126,492.00	0.12
188	688327	云从科技	7,500	126,450.00	0.12
189	300002	神州泰岳	13,800	122,130.00	0.12
190	301257	普蕊斯	1,800	114,300.00	0.11
191	600711	盛屯矿业	25,900	112,406.00	0.11
192	300689	澄天伟业	5,800	112,346.00	0.11
193	000533	顺钠股份	23,700	111,153.00	0.11
194	603879	永悦科技	16,900	107,991.00	0.10
195	300884	狄耐克	8,100	105,948.00	0.10
196	002775	文科园林	26,400	105,600.00	0.10
197	002097	山河智能	17,100	104,823.00	0.10
198	600657	信达地产	28,800	103,392.00	0.10
199	600986	浙文互联	18,800	102,648.00	0.10
200	603528	多伦科技	11,214	101,823.12	0.10
201	000059	华锦股份	18,000	98,820.00	0.10
202	600987	航民股份	11,200	98,112.00	0.09
203	002761	浙江建投	9,500	97,470.00	0.09
204	600059	古越龙山	10,300	95,790.00	0.09
205	300624	万兴科技	1,000	94,600.00	0.09
206	300627	华测导航	3,000	93,060.00	0.09

207	300476	胜宏科技	4,900	90,405.00	0.09
208	000636	风华高科	6,500	88,790.00	0.09
209	600623	华谊集团	13,700	88,228.00	0.09
210	300229	拓尔思	4,800	80,928.00	0.08
211	600959	江苏有线	25,400	79,756.00	0.08
212	600223	福瑞达	8,100	78,003.00	0.08
213	301246	宏源药业	3,000	77,940.00	0.08
214	600120	浙江东方	21,300	76,467.00	0.07
215	688088	虹软科技	1,800	73,872.00	0.07
216	603087	甘李药业	1,400	73,710.00	0.07
217	300412	迦南科技	12,900	73,401.00	0.07
218	000603	盛达资源	6,500	71,825.00	0.07
219	603826	坤彩科技	1,200	70,836.00	0.07
220	300188	美亚柏科	4,300	68,886.00	0.07
221	000551	创元科技	6,500	68,055.00	0.07
222	002283	天润工业	11,500	67,275.00	0.06
223	300795	米奥会展	1,800	66,366.00	0.06
224	600225	卓朗科技	16,500	62,700.00	0.06
225	600602	云赛智联	5,400	62,478.00	0.06
226	300130	新国都	2,500	60,500.00	0.06
227	601068	中铝国际	12,600	58,212.00	0.06
228	301090	华润材料	5,200	56,472.00	0.05
229	603477	巨星农牧	1,500	56,205.00	0.05
230	600172	黄河旋风	15,000	56,100.00	0.05
231	600381	青海春天	6,500	50,245.00	0.05
232	300128	锦富技术	10,700	49,327.00	0.05
233	601231	环旭电子	3,200	48,352.00	0.05
234	603355	莱克电气	2,100	46,830.00	0.05
235	603333	尚纬股份	8,000	45,680.00	0.04
236	002115	三维通信	6,200	44,764.00	0.04
237	688158	优刻得	2,700	44,415.00	0.04
238	300257	开山股份	2,600	40,976.00	0.04
239	688393	安必平	1,600	39,952.00	0.04
240	000036	华联控股	9,700	37,733.00	0.04
241	603881	数据港	1,900	37,658.00	0.04
242	300134	大富科技	3,600	37,152.00	0.04
243	688400	凌云光	1,300	35,100.00	0.03
244	688511	天微电子	1,100	34,617.00	0.03
245	688670	金迪克	1,200	34,152.00	0.03
246	600933	爱柯迪	1,400	30,716.00	0.03
247	688310	迈得医疗	1,000	29,900.00	0.03
248	601200	上海环境	3,100	27,869.00	0.03
249	688179	阿拉丁	1,400	26,824.00	0.03
250	002296	辉煌科技	3,200	26,400.00	0.03

251	300952	恒辉安防	1,200	26,136.00	0.03
252	002689	远大智能	5,700	25,365.00	0.02
253	601608	中信重工	6,300	24,318.00	0.02
254	002589	瑞康医药	5,750	18,802.50	0.02
255	300337	银邦股份	1,900	15,371.00	0.01
256	603050	科林电气	800	14,360.00	0.01
257	002185	华天科技	1,400	11,928.00	0.01
258	688469	芯联集成	2,367	11,882.34	0.01
259	002535	林州重机	2,400	11,136.00	0.01
260	688361	中科飞测	123	9,154.89	0.01
261	301179	泽宇智能	300	7,785.00	0.01
262	688512	慧智微	332	6,470.68	0.01
263	001380	华纬科技	132	4,598.88	0.00
264	002869	金溢科技	150	3,036.00	0.00
265	300440	运达科技	400	2,980.00	0.00
266	603172	万丰股份	122	2,150.86	0.00

注：1.根据厦门市美亚柏科信息股份有限公司于 2023 年 12 月 29 日发布的《关于变更公司名称、证券简称、住所暨完成工商变更登记的公告》，自 2024 年 1 月 2 日起，公司的证券简称由“美亚柏科”变更为“国投智能”，证券代码“300188”保持不变。

2.根据深圳文科园林股份有限公司于 2023 年 12 月 30 日发布的《关于变更公司全称、证券简称及经营范围暨完成工商变更登记的公告》，自 2024 年 1 月 2 日起，公司的证券简称由“文科园林”变更为“文科股份”，证券代码“002775”保持不变。

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	00700	腾讯控股	17,356,410.45	5.52
2	601318	中国平安	7,988,324.08	2.54
3	00981	中芯国际	5,787,282.49	1.84
4	601728	中国电信	3,915,137.00	1.24
5	000063	中兴通讯	3,781,937.00	1.20
6	601668	中国建筑	3,488,469.20	1.11
7	002415	海康威视	3,374,405.00	1.07
8	002544	普天科技	3,202,087.00	1.02
9	002063	远光软件	2,981,494.60	0.95
10	00388	香港交易所	2,935,096.86	0.93

11	000858	五 粮 液	2,874,575.00	0.91
12	603444	吉比特	2,756,382.00	0.88
13	002517	恺英网络	2,744,204.00	0.87
14	300316	晶盛机电	2,738,752.00	0.87
15	300059	东方财富	2,695,946.01	0.86
16	002636	金安国纪	2,657,040.00	0.84
17	002558	巨人网络	2,533,854.00	0.81
18	002212	天融信	2,519,297.00	0.80
19	300525	博思软件	2,464,317.00	0.78
20	600184	光电股份	2,434,959.00	0.77

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	00700	腾讯控股	17,992,550.97	5.72
2	601318	中国平安	11,749,920.89	3.74
3	000858	五 粮 液	7,035,399.25	2.24
4	600519	贵州茅台	6,830,315.00	2.17
5	00981	中芯国际	6,790,374.69	2.16
6	300750	宁德时代	6,047,330.20	1.92
7	601888	中国中免	5,274,518.00	1.68
8	300122	智飞生物	4,358,097.76	1.39
9	300760	迈瑞医疗	4,357,204.00	1.39
10	601728	中国电信	4,305,551.00	1.37
11	601668	中国建筑	4,281,637.00	1.36
12	000333	美的集团	4,281,358.00	1.36
13	300059	东方财富	4,255,542.12	1.35
14	000063	中兴通讯	3,981,956.00	1.27
15	600048	保利发展	3,790,922.00	1.21
16	600036	招商银行	3,456,116.00	1.10
17	002415	海康威视	3,400,344.00	1.08
18	300316	晶盛机电	3,180,352.00	1.01
19	600919	江苏银行	3,126,217.00	0.99
20	002517	恺英网络	3,080,367.00	0.98

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	1,194,838,325.96
卖出股票的收入（成交）总额	1,330,713,680.80

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	7,136,003.29	6.88
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	7,136,003.29	6.88

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	019694	23 国债 01	70,000	7,136,003.29	6.88

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 75,185,558.77 元，占基金资产净值的比例为 72.44%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-66,811,360.00 元，占基金资产净值的比例为-64.37%，空头合约市值占股票资产的比例为-88.86%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 7,124,095.53 元，公允价值变动损益为 4,831,619.66 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	8,090,727.48
2	应收清算款	1,807,439.63
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,464,680.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,362,847.72

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	930	55,639.46	19,220,603.31	37.15%	32,524,093.22	62.85%
海富通安益对冲混合 C	501	90,992.13	37,867,779.52	83.07%	7,719,279.67	16.93%
合计	1,431	68,016.60	57,088,382.83	58.65%	40,243,372.89	41.35%

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	1,933,321.20	3.7363%
	海富通安益对冲混合 C	127,137.28	0.2789%
	合计	2,060,458.48	2.1169%

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	>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	10~50
	海富通安益对冲混合 C	0
	合计	10~50

§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	121,644,383.56	186,757,832.05
本报告期基金总申购份额	2,052,771.31	99,653,199.13
减:本报告期基金总赎回份额	71,952,458.34	240,823,971.99
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	51,744,696.53	45,587,059.19

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

2023 年 12 月 13 日,海富通基金管理有限公司发布公告,经公司第七届董事会第二十一一次临时会议审议通过,何树方先生不再担任公司副总经理职务。

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 50,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 4 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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期	佣金	占当期	

	数量		股票成交总额的比例		佣金总量的比例	
国泰君安	2	687,867,143.54	27.26%	508,941.74	27.48%	-
太平洋证券	2	387,178,717.58	15.35%	279,654.71	15.10%	-
海通证券	2	356,295,438.95	14.12%	267,317.73	14.43%	-
华创证券	1	213,843,657.52	8.48%	154,247.93	8.33%	-
申万宏源	1	199,955,562.04	7.93%	146,229.07	7.90%	-
招商证券	1	171,880,962.42	6.81%	125,034.62	6.75%	-
国金证券	1	156,660,877.66	6.21%	115,281.91	6.22%	-
华泰证券	1	137,165,556.30	5.44%	100,398.36	5.42%	-
光大证券	1	98,269,623.80	3.89%	70,882.04	3.83%	-
兴业证券	1	91,529,889.01	3.63%	67,430.13	3.64%	-
长江证券	1	18,403,675.63	0.73%	13,725.71	0.74%	-
平安证券	1	4,011,034.78	0.16%	2,933.11	0.16%	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	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。

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	2,124,125.92	8.49%	518,200,000.00	55.54%	-	-
太平洋证券	198,220.67	0.79%	-	-	-	-

海通证券	-	-	136,000,000.00	14.58%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	3,328,032.67	13.30%	134,000,000.00	14.36%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	19,365,179.42	77.41%	79,000,000.00	8.47%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	55,900,000.00	5.99%	-	-
长江证券	-	-	10,000,000.00	1.07%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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东方财富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	2023-01-06
2	海富通基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	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	2023-02-22
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增兴业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	2023-03-30
4	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	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	2023-05-05
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	2023-07-20

6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增麦高证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	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	2023-08-15
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海万得基金销售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	2023-08-25
8	海富通基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告	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	2023-08-26
9	海富通基金管理有限公司关于调整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	2023-11-24
10	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	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	2023-12-13

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023/1/17-2023/12/28	49,218,738.86	-	30,000,000.00	19,218,738.86	19.75%
	2	2023/1/1-2023/4/26	95,932,463.55	-	95,932,463.55	-	-
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；</p> <p>2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能</p>							

无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额；

3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于 5000 万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；

4、其他可能的风险。

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

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 113 只公募基金。截至 2023 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1510 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“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“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“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”。

§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
二〇二四年三月二十九日