

海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金  
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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	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
<b>§4 管理人报告</b> .....	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合规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
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.....	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
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.....	21
<b>§5 托管人报告</b> .....	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	21
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.....	21
<b>§6 审计报告</b> .....	21
6.1 审计意见.....	22
6.2 形成审计意见的基础.....	22
6.3 其他信息.....	22
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任.....	22
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任.....	23
<b>§7 年度财务报表</b> .....	24
7.1 资产负债表.....	24
7.2 利润表.....	25
7.3 净资产变动表.....	26
7.4 报表附注.....	28
<b>§8 投资组合报告</b> .....	62
8.1 期末基金资产组合情况.....	62
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	63
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.....	63
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	81

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	83
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 .....	83
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 .....	84
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 .....	84
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 .....	84
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	84
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	84
8.12 市场中性策略执行情况 .....	84
8.13 投资组合报告附注 .....	85
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>85</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	85
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	86
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 .....	86
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	87
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>87</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>87</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	87
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 .....	87
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	87
11.4 基金投资策略的改变 .....	88
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	88
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 .....	88
11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	88
11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	88
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	88
11.8 其他重大事件 .....	90
<b>12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>92</b>
<b>§13 备查文件目录</b> .....	<b>93</b>
13.1 备查文件目录 .....	93
13.2 存放地点 .....	93
13.3 查阅方式 .....	93



## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金	
基金简称	海富通阿尔法对冲混合	
基金主代码	519062	
交易代码	519062	
基金运作方式	契约型、发起式、开放式	
基金合同生效日	2014 年 11 月 20 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	329,284,648.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C
下属分级基金的交易代码	519062	008795
报告期末下属分级基金的份 额总额	308,964,612.04 份	20,320,036.04 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过灵活的投资策略,捕捉市场中的绝对收益机会,并且采用有效的风险管理措施,降低波动风险的同时,获取稳定的收益。
投资策略	本基金将主要通过阿尔法对冲等绝对收益策略,实现组合的稳定收益。同时本基金也根据市场环境的变化,灵活运用其他绝对收益策略,提高资金利用效率。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。本基金通过多种绝对收益策略剥离市场系统风险,因此与一般的混合型基金相比,本基金的预期风险更小。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	许俊
	联系电话	021-38650788	010-66596688
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京西城区复兴门内大街1 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京西城区复兴门内大街1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		杨仓兵	葛海蛟

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## §3 主要财务指标、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	
	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C
本期已实现收益	-27,150,895.35	-2,048,302.93	-65,320,186.01	-779,721.99	738,064,313.44	19,459,120.56
本期利润	-6,221,606.47	-666,734.27	-170,977,798.64	-5,507,570.40	217,302,245.60	4,202,334.56
加权平均基金份额本期利润	-0.0149	-0.0216	-0.0917	-0.0628	0.0352	0.0263
本期加权平均净值利润率	-1.37%	-2.02%	-7.97%	-5.52%	2.98%	2.24%
本期基金份额净值增长率	-1.98%	-2.37%	-7.58%	-7.94%	2.10%	1.67%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C



期末可供分配利润	21,674,79 8.97	1,089,030. 24	68,247,141. 77	4,017,907.6 5	705,247,272 .72	16,673,379.5 0
期末可供分配基金份额利润	0.0702	0.0536	0.0918	0.0792	0.1772	0.1676
期末基金资产净值	330,639,4 11.01	21,409,06 6.28	811,954,027 .34	54,773,337. 17	4,702,619,4 76.77	116,598,155. 60
期末基金份额净值	1.0702	1.0536	1.0918	1.0792	1.1813	1.1723
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C
基金份额累计净值增长率	48.14%	-5.93%	51.13%	-3.64%	63.52%	4.67%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

5、本基金管理人于 2021 年 12 月 7 日发布公告，自 2021 年 12 月 7 日起提高本基金份额净值精确位数至小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

### 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. 海富通阿尔法对冲混合 A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.37%	0.19%	0.69%	0.01%	-2.06%	0.18%
过去六个月	-2.16%	0.18%	1.38%	0.01%	-3.54%	0.17%
过去一年	-1.98%	0.20%	2.75%	0.01%	-4.73%	0.19%
过去三年	-7.50%	0.35%	8.48%	0.01%	-15.98%	0.34%
过去五年	4.19%	0.33%	14.54%	0.01%	-10.35%	0.32%
自基金合同生效起至今	48.14%	0.33%	29.02%	0.01%	19.12%	0.32%

##### 2. 海富通阿尔法对冲混合 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.48%	0.19%	0.69%	0.01%	-2.17%	0.18%
过去六个月	-2.36%	0.18%	1.38%	0.01%	-3.74%	0.17%
过去一年	-2.37%	0.20%	2.75%	0.01%	-5.12%	0.19%
过去三年	-8.62%	0.35%	8.48%	0.01%	-17.10%	0.34%
自基金合同生效起至今	-5.93%	0.34%	11.29%	0.01%	-17.22%	0.33%

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

海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金

## 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

## 1. 海富通阿尔法对冲混合 A

(2014 年 11 月 20 日至 2023 年 12 月 31 日)



## 2. 海富通阿尔法对冲混合 C

(2020 年 1 月 22 日至 2023 年 12 月 31 日)



注：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，截至报告期末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

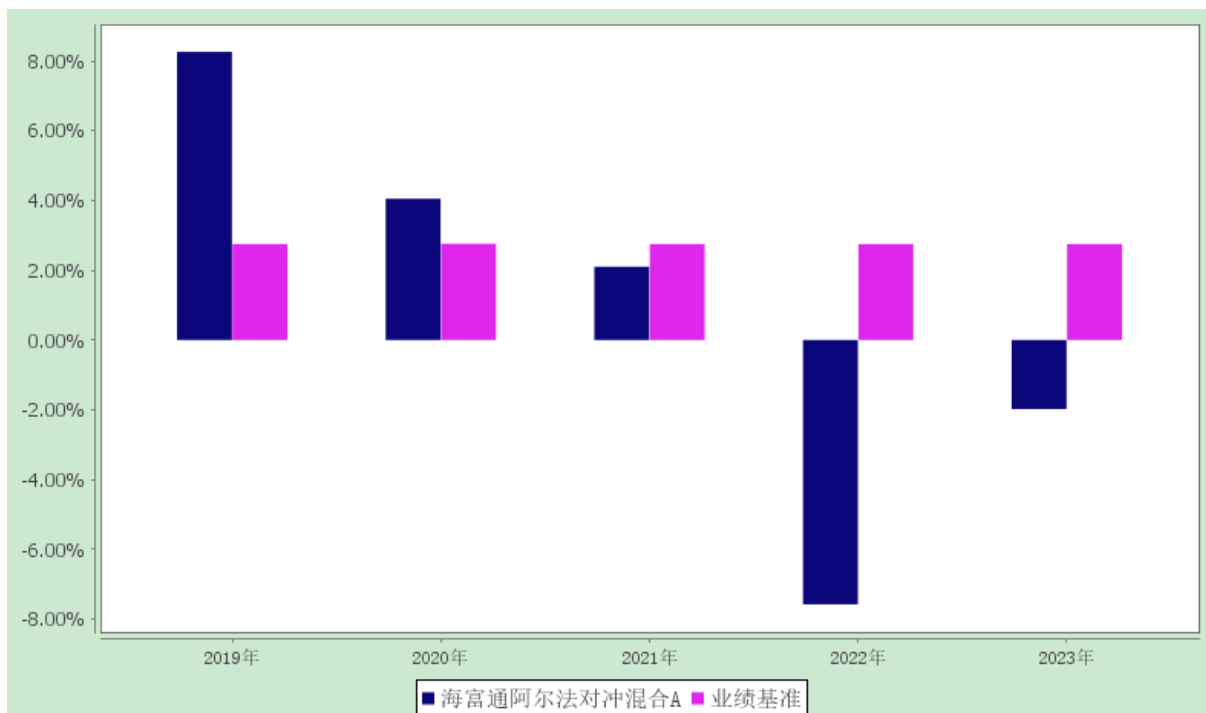
的各项比例。

### 3.2.3 过去五年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

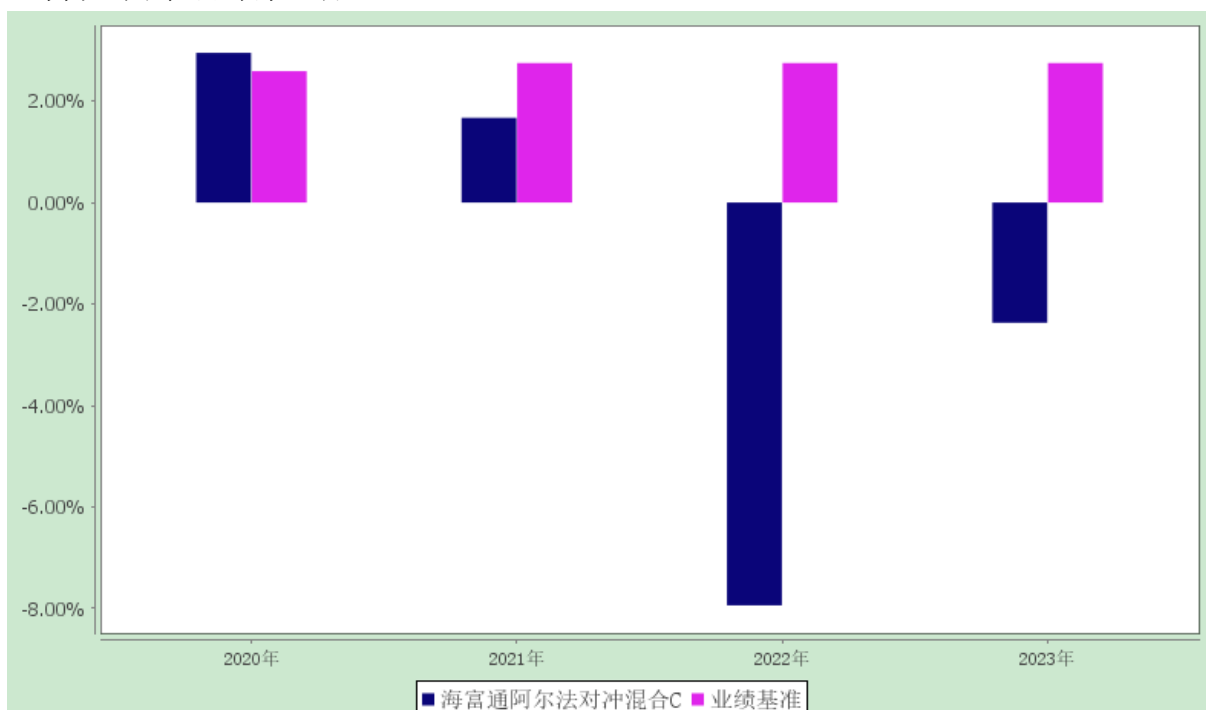
海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金

过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

#### 1. 海富通阿尔法对冲混合 A



#### 2. 海富通阿尔法对冲混合 C



注：图中列示的海富通阿尔法对冲混合 C 份额 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（新增份额日）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、海富通阿尔法对冲混合 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、海富通阿尔法对冲混合 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		
李自悟	本基金的基金经理	2023-04-10	-	15 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2008 年 4 月至 2010 年 1 月任 MNJ Capital Management 交易员，2010 年 7 月至 2011 年 6 月任 BlackRock 研究员，2011 年 7 月至 2016 年 3 月任国家外汇管理局中央外汇业务中心基金经理，2016 年 3 月至 2019 年 8 月任上海均直资产管理有限公司基金经理，2019 年 9 月至 2022 年 8 月任野村东方国际证券量化投资主管。2022 年 8 月加入海富通基金管理有限公司。2023 年 2 月起任海富通量化先锋股票、海富通中证 500 增强基金经理。2023 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合基金经理。
杜晓海	本基金的基金经理；总经理助理兼量化投资部总监。	2018-04-09	-	23 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及

				<p>风险管理总监、多资产策略投资部总监，现任海富通基金管理有限公司总经理助理兼量化投资部总监。2016 年 6 月起任海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 10 月兼任海富通富睿混合（现海富通沪深 300 增强）基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 10 月兼任海富通量化先锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月至 2022 年 8 月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月至 2021 年 7 月兼任海富通中证 500 增强（原海富通中证内地低碳指数）基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 7 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年</p>
--	--	--	--	--



					5 月至 2023 年 10 月兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。2023 年 10 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。
林立禾	本基金的基金经理助理	2022-10-14	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

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

本报告期内，价值板块显著跑赢成长板块，小盘股跑赢大盘股。红利指数一枝独秀，上涨 2.67%，大幅跑赢各宽基指数，反映出市场对于高股息的追捧。行业上，从全年看，受益于 AI 技术的革命性进步，TMT 板块大幅上涨；由于经济复苏较弱、地产不及预期，消费板块、地产板块大幅下跌。在宏观经济缓慢复苏、市场风格轮动较为剧烈的前提下，本基金积极配置拥挤度较低、盈利有预期改善的高性价比资产，组合风格向均衡结构靠拢，同时在因子配置上尽可能兼顾估值与成长。

因子方面，全年来看，低估值、低波、反转类因子表现较好，成长表现较差。这与市场持续下跌，投资者防御意愿较强有关。在北向资金持续流出的背景下，大盘显著跑输小盘。当前在低拥挤度的股票中挖掘机会更有利于获得超额。

组合风格上相对均衡，根据公司基本面在盈利质量、景气度和估值匹配的公司中寻找投资机会，同时积极运用深度学习量价模型在低关注股票中挖掘机会。本基金坚持通过多策略并行的方式，力争在风险可控的基础上跑赢市场。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通阿尔法对冲混合 A 净值增长率为-1.98%，同期业绩比较基准收益率为 2.75%，基金净值跑输业绩比较基准 4.73 个百分点。海富通阿尔法对冲混合 C 净值增长率为-2.37%，同期业绩比较基准收益率为 2.75%，基金净值跑输业绩比较基准 5.12 个百分点。净值跑输基准主要原因包括 2 个方面：市场的预期博弈强于基本面，从个股业绩出发的基本面类因子有效性较差，且行业配置方面对红利板块的侧重不足，导致股票现货部分相对基准超额总体较低；此外由于大盘下跌，裸多部分造成净值下跌。

#### 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。

量化策略上，我们将坚持多策略并行，一方面通过基本面策略跟踪公司的业绩，挖掘估值与成长相匹配、具备投资价值的好公司，另一方面通过深度学习策略在交易中获取超额收益，力争在风险可控的基础上跑赢市场。同时，我们会根据期货基差以及模型超额的情况，动态调整不同策略单元的权重和整体的权益比重。

进入 2024 年，随着年报业绩预告陆续披露，个股景气度将得到进一步验证。后市操作上，本基金将在控制回撤的基础上，力图寻找合适的股票投资机会以赚取相对指数的超额收益，并通过股指期货对冲将股票部分的超额收益转化为绝对收益。

#### 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 and 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，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日该次可供分配利润的 30%。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

#### 4.9 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### §6 审计报告

毕马威华振审字第 2400361 号

海富通阿尔法对冲混合型发起式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阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金（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：海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	14,616,544.11	11,409,387.61
结算备付金		54,476,240.05	188,182,118.01
存出保证金		27,472,015.32	63,260,248.42
交易性金融资产	7.4.7.2	259,188,849.68	587,884,400.59
其中：股票投资		246,547,929.57	543,808,508.70
基金投资		-	-
债券投资		12,640,920.11	44,075,891.89
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	-	-5,830.13
应收清算款		1,989,044.64	20,797,756.59
应收股利		-	-
应收申购款		59,016.23	55,751.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		357,801,710.03	871,583,832.20
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>



		2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>			
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		-	-
应付清算款		3,442,481.91	1,900,338.13
应付赎回款		548,370.59	307,788.83
应付管理人报酬		373,982.79	1,169,663.61
应付托管费		62,330.49	194,943.96
应付销售服务费		7,336.64	18,645.19
应付投资顾问费		-	-
应交税费		65,658.26	538.33
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,253,072.06	1,264,549.64
负债合计		5,753,232.74	4,856,467.69
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.7	329,284,648.08	794,462,315.09
未分配利润	7.4.7.8	22,763,829.21	72,265,049.42
净资产合计		352,048,477.29	866,727,364.51
负债和净资产总计		357,801,710.03	871,583,832.20

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.0702 元，C 类基金份额净值 1.0536 元。基金份额总额 329,284,648.08 份，其中 A 类基金份额 308,964,612.04 份，C 类基金份额 20,320,036.04 份。

## 7.2 利润表

会计主体：海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金

本报告期：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	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
一、营业总收入		1,605,181.22	-134,347,975.98
1.利息收入		1,237,657.17	9,551,973.95
其中：存款利息收入	7.4.7.9	1,229,864.90	9,399,737.21
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		7,792.27	152,236.74

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-22,904,380.38	-38,563,316.96
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-30,326,772.47	-446,584,647.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	513,128.31	4,163,614.20
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	1,868,193.66	385,814,117.78
股利收益	7.4.7.14	5,041,070.12	18,043,598.71
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	22,310,857.54	-110,385,461.04
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	961,046.89	5,048,828.07
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>8,493,521.96</b>	<b>42,137,393.06</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,955,256.62	34,284,401.44
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,159,209.53	5,714,066.97
3. 销售服务费		133,230.31	400,641.63
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	26,839.07
其中：卖出回购金融资产支出		-	26,839.07
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		7,063.96	1,433,194.06
8. 其他费用	7.4.7.17	238,761.54	278,249.89
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-6,888,340.74</b>	<b>-176,485,369.04</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-6,888,340.74</b>	<b>-176,485,369.04</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-6,888,340.74</b>	<b>-176,485,369.04</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金

本报告期：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	794,462,315.09	-	72,265,049.42	866,727,364.51
二、本期期初净资产	794,462,315.09	-	72,265,049.42	866,727,364.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-465,177,667.01	-	-49,501,220.21	-514,678,887.22
（一）、综合收益总额	-	-	-6,888,340.74	-6,888,340.74
（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）	-465,177,667.01	-	-42,612,879.47	-507,790,546.48
其中：1. 基金申购款	95,755,398.99	-	8,034,701.14	103,790,100.13
2. 基金赎回款	-560,933,066.00	-	-50,647,580.61	-611,580,646.61
（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	329,284,648.08	-	22,763,829.21	352,048,477.29
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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,080,424,362.60	-	738,793,269.77	4,819,217,632.37
二、本期期初净资产	4,080,424,362.60	-	738,793,269.77	4,819,217,632.37
三、本期增减变动	-3,285,962,047.51	-	-666,528,220.35	-3,952,490,267.86

动额（减少以“-”号填列）				67.86
（一）、综合收益总额	-	-	-176,485,369.04	-176,485,369.04
（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）	-3,285,962,047.51	-	-490,042,851.31	-3,776,004,898.82
其中：1. 基金申购款	655,840,559.16	-	97,517,107.15	753,357,666.31
2. 基金赎回款	-3,941,802,606.67	-	-587,559,958.46	-4,529,362,565.13
（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	794,462,315.09	-	72,265,049.42	866,727,364.51

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

海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]895 号《关于准予海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 719,531,193.38 元。经向中国证监会备案，《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2014 年 11 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 719,877,758.17 份基金份额,其中认购资金利息折合 346,564.79 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，基金募集份额总额不少于 5,000 万份，基金募集金额不少于 5,000 万元，其中基金管理人作为发起资金的提供方认购的金额为 1,000 万元且承诺持有期限不少于三年。

根据本基金管理人海富通基金管理有限公司 2020 年 1 月 21 日《关于海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2020 年 1 月 22 日起对本基金增加 C 类份额并相应修改基金合同。本基金原有的基金份额类别更名为 A 类基金份额，新增的基金份额类别命名为 C 类基金份额，并对 C 级份额收取销售服务费。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、股指期货、权证、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%~120% 之间。在每个交易日日终持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行

业实务操作的规定的要求, 真实、完整地反映了本基金 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、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

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

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

##### 公允价值变动收益

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金基金合同》的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日该次可供分配利润的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；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相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金各类别份额默认的收益分配方式均是现金分红；同一基金账户的不同基金交易账户对本基金各类别份额设置的分红方式相互独立、互不影响；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日各类基金份额的基金份额净值减去该类别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，基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

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

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

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

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

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

(d)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》,自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收。

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

## 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	14,616,544.11	11,409,387.61
等于: 本金	14,614,954.02	11,406,473.83
加: 应计利息	1,590.09	2,913.78
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	14,616,544.11	11,409,387.61

## 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	247,718,704.80	-	246,547,929.57	-1,170,775.23	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	12,416,842.61	239,680.11	12,640,920.11	-15,602.61
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	12,416,842.61	239,680.11	12,640,920.11	-15,602.61
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	260,135,547.41	239,680.11	259,188,849.68	-1,186,377.84	
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	565,954,819.97	-	543,808,508.70	-22,146,311.27	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	

债券	交易所市场	43,696,347.94	512,386.67	44,075,891.89	-132,842.72
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	43,696,347.94	512,386.67	44,075,891.89	-132,842.72
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		609,651,167.91	512,386.67	587,884,400.59	-22,279,153.99

### 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	-215,959,474.99	-	-	-
——股指期货	-215,959,474.99	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-215,959,474.99	-	-	-
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	-473,749,793.60	-	-	-
——股指期货	-473,749,793.60	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-473,749,793.60	-	-	-

#### 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
IC2406	IC2406	-3.00	-3,213,600.00	14,880.00
IF2403	IF2403	-32.00	-33,175,680.00	1,828,171.76
IF2406	IF2406	-3.00	-3,107,880.00	-52,020.00
IM2406	IM2406	-60.00	-69,115,200.00	984,800.00
IC2403	IC2403	-19.00	-20,575,480.00	465,665.45
IM2403	IM2403	-70.00	-81,852,400.00	1,677,737.78
合计	-	-	-	4,919,234.99
减：可抵销期货 暂收款	-	-	-	4,919,234.99
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	-5,830.13	-
银行间市场	-	-
合计	-5,830.13	-

##### 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未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。



## 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	77.24	222.97
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,072,994.82	1,074,326.67
其中：交易所市场	1,072,994.82	1,074,326.67
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	190,000.00
合计	1,253,072.06	1,264,549.64

## 7.4.7.7 实收基金

## 海富通阿尔法对冲混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	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	743,706,885.57	743,706,885.57
本期申购	79,292,469.71	79,292,469.71
本期赎回（以“-”号填列）	-514,034,743.24	-514,034,743.24
本期末	308,964,612.04	308,964,612.04

## 海富通阿尔法对冲混合 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	50,755,429.52	50,755,429.52
本期申购	16,462,929.28	16,462,929.28

本期赎回（以“-”号填列）	-46,898,322.76	-46,898,322.76
本期末	20,320,036.04	20,320,036.04

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

##### 海富通阿尔法对冲混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	122,526,690.16	-54,279,548.39	68,247,141.77
本期期初	122,526,690.16	-54,279,548.39	68,247,141.77
本期利润	-27,150,895.35	20,929,288.88	-6,221,606.47
本期基金份额交易产生的变动数	-61,839,818.29	21,489,081.96	-40,350,736.33
其中：基金申购款	9,721,244.45	-2,887,834.88	6,833,409.57
基金赎回款	-71,561,062.74	24,376,916.84	-47,184,145.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,535,976.52	-11,861,177.55	21,674,798.97

##### 海富通阿尔法对冲混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,657,257.16	-3,639,349.51	4,017,907.65
本期期初	7,657,257.16	-3,639,349.51	4,017,907.65
本期利润	-2,048,302.93	1,381,568.66	-666,734.27
本期基金份额交易产生的变动数	-3,757,471.96	1,495,328.82	-2,262,143.14
其中：基金申购款	1,858,319.96	-657,028.39	1,201,291.57
基金赎回款	-5,615,791.92	2,152,357.21	-3,463,434.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,851,482.27	-762,452.03	1,089,030.24

### 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	80,816.58	458,045.99
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	1,142,031.73	8,917,740.52
其他	7,016.59	23,950.70
合计	1,229,864.90	9,399,737.21

### 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	2,781,973,619.65	8,943,709,628.71
减：卖出股票成本总额	2,806,162,482.60	9,370,101,570.28
减：交易费用	6,137,909.52	20,192,706.08
买卖股票差价收入	-30,326,772.47	-446,584,647.65

### 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	436,287.66	2,387,911.39
债券投资收益——买卖债券(债转股及 债券到期兑付)差价收入	76,840.65	1,775,702.81
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	513,128.31	4,163,614.20

#### 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	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
卖出债券（债转股及债券到期兑付） 成交总额	84,974,289.65	283,298,533.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑 付）成本总额	83,628,743.07	277,405,026.68
减：应计利息总额	1,267,074.41	4,117,641.48
减：交易费用	1,631.52	162.97
买卖债券差价收入	76,840.65	1,775,702.81

**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）	2,012,738.61	398,190,029.24
减：股指期货差价收入应缴 纳增值税额	58,623.45	11,939,447.60
减：交易费用	85,921.50	436,463.86
合计	1,868,193.66	385,814,117.78

**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	5,041,070.12	18,043,598.71
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	5,041,070.12	18,043,598.71

## 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1.交易性金融资产	21,092,776.15	-152,199,871.80
——股票投资	20,975,536.04	-152,096,372.89
——债券投资	117,240.11	-103,498.91
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	1,218,081.39	41,814,410.76
——权证投资	-	-
——股指期货	1,218,081.39	41,814,410.76
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	22,310,857.54	-110,385,461.04

## 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	960,958.37	5,022,310.33
基金转换费收入	88.52	26,517.74
合计	961,046.89	5,048,828.07

## 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	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31
----	-------------------------	---------------------------------

	月31日	日
审计费用	60,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	21,561.54	51,049.89
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	238,761.54	278,249.89

## 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
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
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

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	成交金额	占当期股

		票成交总 额的比例		票成交总 额的比例
海通证券	-	-	1,698,707,131.11	10.90%

#### 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	-	-	-	-
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	1,234,545.02	12.52%	-	-

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	6,955,256.62	34,284,401.44

其中：应支付销售机构的客户维护费	2,491,506.69	7,297,009.50
应支付基金管理人的净管理费	4,463,749.93	26,987,391.94

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

2023 年 8 月 26 日之前，支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 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 × 1.20% / 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	1,159,209.53	5,714,066.97

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

2023 年 8 月 26 日之前，支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 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 × 0.20% / 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		
	海富通阿尔法对冲混合A	海富通阿尔法对冲混合C	合计
中国银行	-	7,049.81	7,049.81



海通证券	-	1,211.55	1,211.55
海富通	-	7,564.45	7,564.45
合计	-	15,825.81	15,825.81
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		
	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合C	合计
中国银行	-	10,253.53	10,253.53
海通证券	-	1,019.64	1,019.64
海富通	-	146,933.49	146,933.49
合计	-	158,206.66	158,206.66

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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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
中国银行	14,616,544.11	80,816.58	11,409,387.61	458,045.99

#### 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	48,643	276,778.67
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均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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001378	德冠新材	2023-10-23	6个月	新股锁定	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股锁定	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	新股锁定	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301251	威尔高	2023-08-30	6个月	新股锁定	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	新股锁定	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301272	英华特	2023-07-06	6个月	新股锁定	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6个月	新股锁定	38.13	28.36	614	23,411.82	17,413.04	-
301292	海科新源	2023-06-29	6个月	新股锁定	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-
301329	信音电子	2023-07-05	6个月	新股锁定	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	6个月	新股锁定	55.68	37.58	245	13,641.60	9,207.10	-
301418	协昌科技	2023-08-10	6个月	新股锁定	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	新股锁定	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301498	乖宝宠物	2023-08-09	6个月	新股锁定	39.99	38.81	373	14,916.27	14,476.13	-
301500	飞南资源	2023-09-13	6个月	新股锁定	23.97	20.89	428	10,259.16	8,940.92	-
301505	苏州规划	2023-07-12	6个月	新股锁定	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301507	民生健康	2023-08-24	6个月	新股锁定	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301515	港通医疗	2023-07-13	6个月	新股锁定	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301517	陕西华达	2023-10-09	6个月	新股锁定	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301511	舜禹	2023-	6个	新股	20.93	20.21	442	9,251.	8,932.	-

9	股份	07-19	月	锁定				06	82	
301520	万邦医药	2023-09-18	6个月	新股锁定	67.88	52.74	150	10,182.00	7,911.00	-
301528	多浦乐	2023-08-17	6个月	新股锁定	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301550	斯菱股份	2023-09-06	6个月	新股锁定	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301555	惠柏新材	2023-10-24	6个月	新股锁定	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301559	中集环科	2023-09-26	6个月	新股锁定	24.22	18.24	504	12,206.88	9,192.96	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	新股锁定	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301578	辰奕智能	2023-12-21	6个月	新股锁定	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6个月	新股锁定	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603276	恒兴新材	2023-09-18	6个月	新股锁定	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
688450	光格科技	2023-07-17	6个月	新股锁定	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688563	航材股份	2023-07-12	6个月	新股锁定	78.99	60.49	320	25,276.80	19,356.80	-
688602	康鹏科技	2023-07-13	6个月	新股锁定	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	新股锁定	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688610	埃科光电	2023-07-10	6个月	新股锁定	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00	-
688646	逸飞激光	2023-07-21	6个月	新股锁定	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688652	京仪装备	2023-11-22	6个月	新股锁定	31.95	52.25	318	10,160.10	16,615.50	-
688657	浩辰软件	2023-09-25	6个月	新股锁定	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧兴物联	2023-08-02	6个月	新股锁定	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688702	盛科通信	2023-09-06	6个月	新股锁定	42.66	48.18	289	12,328.74	13,924.02	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2023 年 12 月 31 日，本基金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

于 2023 年 12 月 31 日,本基金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

于 2023 年 12 月 31 日,本基金无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2023 年 12 月 31 日,本基金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

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,在董事会下设立审计及风险管理委员会,负责制定公司的风险管理政策,审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等;在管理层层面设立风险管理委员会,负责实施董事会下设立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：0.02%）。

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	12,640,920.11	-
合计	12,640,920.11	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	215,922.05
未评级	-	43,859,969.84
合计	-	44,075,891.89

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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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	14,616,544.11	-	-	-	14,616,544.11
结算备付金	54,476,240.05	-	-	-	54,476,240.05
存出保证金	48,233.62	-	-	27,423,781.70	27,472,015.32
交易性金融资产	12,640,920.11	-	-	246,547,929.57	259,188,849.68
应收清算款	-	-	-	1,989,044.64	1,989,044.64



应收申购款	-	-	-	59,016.23	59,016.23
资产总计	81,781,937.89	-	-	276,019,772.14	357,801,710.03
负债					
应付清算款	-	-	-	3,442,481.91	3,442,481.91
应付赎回款	-	-	-	548,370.59	548,370.59
应付管理人报酬	-	-	-	373,982.79	373,982.79
应付托管费	-	-	-	62,330.49	62,330.49
应付销售服务费	-	-	-	7,336.64	7,336.64
应交税费	-	-	-	65,658.26	65,658.26
其他负债	-	-	-	1,253,072.06	1,253,072.06
负债总计	-	-	-	5,753,232.74	5,753,232.74
利率敏感度缺口	81,781,937.89	-	-	270,266,539.40	352,048,477.29
<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
货币资金	11,409,387.61	-	-	-	11,409,387.61
结算备付金	188,182,118.01	-	-	-	188,182,118.01
存出保证金	500,501.22	-	-	62,759,747.20	63,260,248.42
交易性金融资产	43,859,969.84	1,086.31	214,835.74	543,808,508.70	587,884,400.59
买入返售金融资产	-5,830.13	-	-	-	-5,830.13
应收清算款	-	-	-	20,797,756.59	20,797,756.59
应收申购款	-	-	-	55,751.11	55,751.11
资产总计	243,946,146.55	1,086.31	214,835.74	627,421,763.60	871,583,832.20
负债					
应付清算款	-	-	-	1,900,338.13	1,900,338.13
应付赎回款	-	-	-	307,788.83	307,788.83
应付管理人报酬	-	-	-	1,169,663.61	1,169,663.61
应付托管费	-	-	-	194,943.96	194,943.96
应付销售服务费	-	-	-	18,645.19	18,645.19

应交税费	-	-	-	538.33	538.33
其他负债	-	-	-	1,264,549.64	1,264,549.64
负债总计	-	-	-	4,856,467.69	4,856,467.69
利率敏感度缺口	243,946,146.55	1,086.31	214,835.74	622,565,295.91	866,727,364.51

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	-1,427.39	-56,604.82
	市场利率下降 25 个基点	1,431.10	56,855.82

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，形成对不同市场周期的预测和判断，通过灵活主动且有纪律的资产配置，确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例，追求较高的收益，同时规避市场的系统性风险。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入

股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。在每个交易日日终持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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	246,547,929.57	70.03	543,808,508.70	62.74
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	246,547,929.57	70.03	543,808,508.70	62.74

#### 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%		1,069,847.23
2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%		-1,069,847.23	-4,862,444.33

### 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	246,154,394.37	542,271,797.25
第二层次	12,640,920.11	44,405,779.80
第三层次	393,535.20	1,206,823.54
合计	259,188,849.68	587,884,400.59

##### 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	-	1,206,823.54	1,206,823.54
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,073,090.38	1,073,090.38
转出第三层次	-	2,176,741.85	2,176,741.85
当期利得或损失总额	-	290,363.13	290,363.13
其中：计入损益的利得或损失	-	290,363.13	290,363.13
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-

期末余额	-	393,535.20	393,535.20
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	-	10,366.88	10,366.88
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	-	3,836,135.95	3,836,135.95
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	4,621,375.85	4,621,375.85
当期利得或损失总额	-	1,992,063.44	1,992,063.44
其中：计入损益的利得或损失	-	1,992,063.44	1,992,063.44
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	1,206,823.54	1,206,823.54
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	-	35,235.52	35,235.52

注：于2023年12月31日，本基金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（2022年12月31日：同）。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	393,535.20	亚式期权模型	预期年化波动率	19.62%~194.82%	负相关
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	1,206,823.54	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买入返售金融资产、应收款项、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

于 2023 年 12 月 31 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	246,547,929.57	68.91
	其中：股票	246,547,929.57	68.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,640,920.11	3.53
	其中：债券	12,640,920.11	3.53
	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	69,092,784.16	19.31
8	其他各项资产	29,520,076.19	8.25
9	合计	357,801,710.03	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	-	-
B	采矿业	6,909,437.84	1.96
C	制造业	161,540,851.02	45.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,377,119.20	1.81
E	建筑业	6,074,725.11	1.73
F	批发和零售业	8,340,909.40	2.37
G	交通运输、仓储和邮政业	4,667,606.39	1.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,005,402.25	6.53
J	金融业	10,598,374.34	3.01
K	房地产业	3,331,636.00	0.95
L	租赁和商务服务业	4,264,917.16	1.21
M	科学研究和技术服务业	4,788,136.04	1.36
N	水利、环境和公共设施管理业	4,588,419.82	1.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	433,285.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	978,008.00	0.28
S	综合	649,102.00	0.18
	合计	246,547,929.57	70.03

### 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	300319	麦捷科技	206,800	1,993,552.00	0.57

2	600519	贵州茅台	1,091	1,883,066.00	0.53
3	300130	新国都	67,900	1,643,180.00	0.47
4	002130	沃尔核材	200,300	1,512,265.00	0.43
5	600710	苏美达	204,500	1,449,905.00	0.41
6	000921	海信家电	65,733	1,340,953.20	0.38
7	688128	中国电研	65,001	1,333,820.52	0.38
8	300866	安克创新	14,800	1,311,280.00	0.37
9	002027	分众传媒	206,400	1,304,448.00	0.37
10	002600	领益智造	188,100	1,271,556.00	0.36
11	603588	高能环境	192,200	1,256,988.00	0.36
12	601601	中国太保	51,700	1,229,426.00	0.35
13	300894	火星号	73,800	1,198,512.00	0.34
14	603530	神马电力	56,300	1,167,662.00	0.33
15	002126	银轮股份	62,413	1,165,250.71	0.33
16	002171	楚江新材	154,600	1,156,408.00	0.33
17	000885	城发环境	101,600	1,152,144.00	0.33
18	300497	富祥药业	118,300	1,107,288.00	0.31
19	000035	中国天楹	223,300	1,103,102.00	0.31
20	002206	海利得	218,500	1,096,870.00	0.31
21	002516	旷达科技	213,600	1,053,048.00	0.30
22	002891	中宠股份	39,100	1,030,285.00	0.29
23	300296	利亚德	168,600	1,011,600.00	0.29
24	603556	海兴电力	34,100	989,923.00	0.28
25	002091	江苏国泰	125,000	978,750.00	0.28
26	603328	依顿电子	116,700	951,105.00	0.27
27	601899	紫金矿业	75,494	940,655.24	0.27
28	002643	万润股份	56,338	934,647.42	0.27
29	600312	平高电气	72,700	922,563.00	0.26
30	000061	农产品	135,800	878,626.00	0.25
31	603300	华铁应急	136,800	875,520.00	0.25
32	603713	密尔克卫	16,400	872,644.00	0.25
33	002421	达实智能	270,500	871,010.00	0.25
34	605009	豪悦护理	22,800	870,276.00	0.25
35	002163	海南发展	95,500	867,140.00	0.25
36	600161	天坛生物	27,800	860,132.00	0.24
37	600206	有研新材	68,800	852,432.00	0.24
38	603730	岱美股份	58,800	852,012.00	0.24
39	000901	航天科技	91,100	849,052.00	0.24
40	601068	中铝国际	178,800	826,056.00	0.23
41	002838	道恩股份	63,100	808,311.00	0.23
42	002537	海联金汇	119,300	794,538.00	0.23
43	600201	生物股份	73,500	791,595.00	0.22
44	600986	浙文互联	143,500	783,510.00	0.22
45	002003	伟星股份	70,600	766,010.00	0.22



46	600997	开滦股份	99,100	756,133.00	0.21
47	600900	长江电力	32,300	753,882.00	0.21
48	600901	江苏金租	155,205	751,192.20	0.21
49	300219	鸿利智汇	88,700	746,854.00	0.21
50	600941	中国移动	7,450	741,126.00	0.21
51	600007	中国国贸	38,200	740,316.00	0.21
52	002191	劲嘉股份	137,600	738,912.00	0.21
53	601336	新华保险	23,700	737,781.00	0.21
54	002034	旺能环境	48,300	736,575.00	0.21
55	002283	天润工业	125,300	733,005.00	0.21
56	000589	贵州轮胎	118,700	726,444.00	0.21
57	601330	绿色动力	108,400	719,776.00	0.20
58	002063	远光软件	116,300	718,734.00	0.20
59	600933	爱柯迪	32,100	704,274.00	0.20
60	002475	立讯精密	20,376	701,953.20	0.20
61	600138	中青旅	65,800	698,796.00	0.20
62	601390	中国中铁	122,800	697,504.00	0.20
63	603636	南威软件	54,400	697,408.00	0.20
64	300791	仙乐健康	20,000	693,200.00	0.20
65	000019	深粮控股	91,700	691,418.00	0.20
66	603055	台华新材	57,400	691,096.00	0.20
67	600750	江中药业	33,000	689,040.00	0.20
68	002302	西部建设	105,800	685,584.00	0.19
69	688508	芯朋微	13,900	684,019.00	0.19
70	300119	瑞普生物	41,600	681,824.00	0.19
71	000650	仁和药业	101,600	673,608.00	0.19
72	603979	金诚信	17,700	668,352.00	0.19
73	301200	大族数控	17,600	664,752.00	0.19
74	000791	甘肃能源	118,700	661,159.00	0.19
75	688617	惠泰医疗	1,700	660,450.00	0.19
76	688499	利元亨	17,301	658,822.08	0.19
77	603093	南华期货	54,800	657,600.00	0.19
78	600612	老凤祥	9,500	655,500.00	0.19
79	600797	浙大网新	99,700	654,032.00	0.19
80	002444	巨星科技	29,032	653,800.64	0.19
81	002403	爱仕达	76,300	653,128.00	0.19
82	300639	凯普生物	69,650	650,531.00	0.18
83	600216	浙江医药	60,600	650,238.00	0.18
84	300123	亚光科技	88,600	649,438.00	0.18
85	600770	综艺股份	132,200	649,102.00	0.18
86	600169	太原重工	274,000	646,640.00	0.18
87	002463	沪电股份	28,900	639,268.00	0.18
88	600691	阳煤化工	198,000	635,580.00	0.18
89	002139	拓邦股份	65,000	634,400.00	0.18

90	688188	柏楚电子	2,500	632,775.00	0.18
91	300009	安科生物	61,100	624,442.00	0.18
92	002636	金安国纪	69,300	617,463.00	0.18
93	603123	翠微股份	57,800	615,570.00	0.17
94	300284	苏交科	112,600	613,670.00	0.17
95	000990	诚志股份	73,600	604,256.00	0.17
96	002429	兆驰股份	107,300	598,734.00	0.17
97	600037	歌华有线	77,300	597,529.00	0.17
98	601567	三星医疗	29,100	596,550.00	0.17
99	002544	普天科技	28,900	587,248.00	0.17
100	603105	芯能科技	50,400	583,632.00	0.17
101	600795	国电电力	139,700	581,152.00	0.17
102	002138	顺络电子	21,382	577,527.82	0.16
103	002546	新联电子	115,500	577,500.00	0.16
104	002212	天融信	58,500	572,130.00	0.16
105	603010	万盛股份	52,800	569,712.00	0.16
106	600184	光电股份	49,200	562,356.00	0.16
107	600718	东软集团	60,600	560,550.00	0.16
108	600060	海信视像	26,613	556,211.70	0.16
109	002498	汉缆股份	137,800	551,200.00	0.16
110	600740	山西焦化	107,600	542,304.00	0.15
111	600480	凌云股份	59,300	540,223.00	0.15
112	002645	华宏科技	47,400	535,620.00	0.15
113	688680	海优新材	8,001	525,265.65	0.15
114	300348	长亮科技	50,600	521,686.00	0.15
115	300002	神州泰岳	58,900	521,265.00	0.15
116	002252	上海莱士	65,100	520,800.00	0.15
117	000012	南玻A	91,400	509,098.00	0.14
118	601985	中国核电	67,800	508,500.00	0.14
119	601609	金田股份	74,600	505,042.00	0.14
120	002083	孚日股份	99,700	502,488.00	0.14
121	601728	中国电信	92,700	501,507.00	0.14
122	002815	崇达技术	52,300	501,034.00	0.14
123	600623	华谊集团	77,700	500,388.00	0.14
124	002274	华昌化工	65,800	496,790.00	0.14
125	600449	宁夏建材	27,700	496,661.00	0.14
126	000006	深振业A	108,000	495,720.00	0.14
127	603132	金徽股份	36,200	495,216.00	0.14
128	300150	世纪瑞尔	101,800	493,730.00	0.14
129	000597	东北制药	92,100	492,735.00	0.14
130	600252	中恒集团	196,200	492,462.00	0.14
131	000025	特力A	30,900	491,619.00	0.14
132	002320	海峡股份	84,200	490,886.00	0.14
133	001213	中铁特货	116,700	490,140.00	0.14

134	000400	许继电气	22,300	489,708.00	0.14
135	002461	珠江啤酒	61,400	485,060.00	0.14
136	600835	上海机电	40,600	481,922.00	0.14
137	603917	合力科技	26,900	477,744.00	0.14
138	688981	中芯国际	9,000	477,180.00	0.14
139	300122	智飞生物	7,800	476,658.00	0.14
140	000426	兴业银锡	52,000	472,160.00	0.13
141	000543	皖能电力	75,400	472,004.00	0.13
142	688078	龙软科技	11,700	471,744.00	0.13
143	300922	天秦装备	27,400	467,718.00	0.13
144	605090	九丰能源	16,600	463,638.00	0.13
145	301376	致欧科技	19,320	462,134.40	0.13
146	603113	金能科技	57,200	461,604.00	0.13
147	002304	洋河股份	4,200	461,580.00	0.13
148	000333	美的集团	8,400	458,892.00	0.13
149	601328	交通银行	79,900	458,626.00	0.13
150	688425	铁建重工	115,500	458,535.00	0.13
151	301051	信濠光电	7,200	458,424.00	0.13
152	603993	洛阳钼业	87,838	456,757.60	0.13
153	002923	润都股份	36,900	455,346.00	0.13
154	603323	苏农银行	109,300	454,688.00	0.13
155	688033	天宜上佳	26,900	454,610.00	0.13
156	600266	城建发展	93,700	453,508.00	0.13
157	600586	金晶科技	67,600	451,568.00	0.13
158	600572	康恩贝	89,400	451,470.00	0.13
159	600531	豫光金铅	74,600	451,330.00	0.13
160	300627	华测导航	14,500	449,790.00	0.13
161	688580	伟思医疗	7,000	447,510.00	0.13
162	601886	江河集团	67,100	446,886.00	0.13
163	601600	中国铝业	79,200	446,688.00	0.13
164	600645	中源协和	22,000	445,940.00	0.13
165	002689	远大智能	100,000	445,000.00	0.13
166	601211	国泰君安	29,900	444,912.00	0.13
167	300893	松原股份	15,200	444,296.00	0.13
168	002493	荣盛石化	42,900	444,015.00	0.13
169	688667	菱电电控	5,400	443,016.00	0.13
170	000829	天音控股	46,200	440,748.00	0.13
171	000932	华菱钢铁	85,500	440,325.00	0.13
172	600172	黄河旋风	117,200	438,328.00	0.12
173	000737	北方铜业	75,300	436,740.00	0.12
174	000928	中钢国际	74,800	436,084.00	0.12
175	002534	西子洁能	34,900	435,901.00	0.12
176	603218	日月股份	35,200	435,424.00	0.12
177	300224	正海磁材	37,100	434,812.00	0.12

178	688303	大全能源	14,600	431,722.00	0.12
179	300451	创业慧康	65,600	429,680.00	0.12
180	603737	三棵树	9,000	428,490.00	0.12
181	601857	中国石油	60,600	427,836.00	0.12
182	600282	南钢股份	115,000	425,500.00	0.12
183	002125	湘潭电化	39,800	425,462.00	0.12
184	002179	中航光电	10,900	425,100.00	0.12
185	000034	神州数码	14,200	424,722.00	0.12
186	002353	杰瑞股份	15,100	424,461.00	0.12
187	002768	国恩股份	19,800	424,116.00	0.12
188	600422	昆药集团	20,300	423,458.00	0.12
189	000811	冰轮环境	31,200	423,384.00	0.12
190	002949	华阳国际	30,300	423,291.00	0.12
191	002991	甘源食品	5,900	421,614.00	0.12
192	688368	晶丰明源	3,900	420,966.00	0.12
193	003035	南网能源	80,000	420,800.00	0.12
194	600420	国药现代	42,800	419,012.00	0.12
195	002405	四维图新	47,000	418,300.00	0.12
196	603589	口子窖	9,200	416,760.00	0.12
197	600801	华新水泥	33,500	416,405.00	0.12
198	300957	贝泰妮	6,100	415,837.00	0.12
199	600363	联创光电	12,200	414,800.00	0.12
200	600210	紫江企业	88,100	414,070.00	0.12
201	002978	安宁股份	13,000	411,580.00	0.12
202	002287	奇正藏药	18,300	411,567.00	0.12
203	000951	中国重汽	30,800	411,488.00	0.12
204	300349	金卡智能	33,100	411,102.00	0.12
205	300358	楚天科技	38,400	410,880.00	0.12
206	603393	新天然气	13,400	409,638.00	0.12
207	600510	黑牡丹	72,400	409,060.00	0.12
208	002946	新乳业	35,600	408,688.00	0.12
209	002649	博彦科技	33,300	408,591.00	0.12
210	301235	华康医疗	15,900	407,517.00	0.12
211	300772	运达股份	38,300	407,512.00	0.12
212	600993	马应龙	16,800	406,224.00	0.12
213	688226	威腾电气	21,600	406,080.00	0.12
214	002345	潮宏基	59,600	405,876.00	0.12
215	600803	新奥股份	24,100	405,362.00	0.12
216	600398	海澜之家	54,561	404,842.62	0.11
217	600919	江苏银行	60,482	404,624.58	0.11
218	301047	义翘神州	4,900	403,760.00	0.11
219	301095	广立微	5,400	403,542.00	0.11
220	603212	赛伍技术	23,200	402,984.00	0.11
221	002920	德赛西威	3,100	401,481.00	0.11

222	002677	浙江美大	39,700	401,367.00	0.11
223	600820	隧道股份	69,619	401,005.44	0.11
224	600458	时代新材	43,500	400,635.00	0.11
225	688559	海目星	11,200	399,840.00	0.11
226	300083	创世纪	63,000	398,790.00	0.11
227	603333	尚纬股份	69,300	395,703.00	0.11
228	600667	太极实业	56,000	393,680.00	0.11
229	000661	长春高新	2,700	393,660.00	0.11
230	603602	纵横通信	26,700	393,558.00	0.11
231	688568	中科星图	8,000	392,480.00	0.11
232	300551	古鳌科技	22,500	391,500.00	0.11
233	605208	永茂泰	41,200	391,400.00	0.11
234	600497	驰宏锌锗	77,500	391,375.00	0.11
235	603733	仙鹤股份	24,200	390,588.00	0.11
236	600699	均胜电子	21,700	389,732.00	0.11
237	002236	大华股份	20,900	385,605.00	0.11
238	600657	信达地产	107,100	384,489.00	0.11
239	000685	中山公用	52,500	383,775.00	0.11
240	000517	荣安地产	156,100	382,445.00	0.11
241	600550	保变电气	78,300	382,104.00	0.11
242	600577	精达股份	91,600	379,224.00	0.11
243	688315	诺禾致源	16,200	378,108.00	0.11
244	601668	中国建筑	78,607	378,099.67	0.11
245	688012	中微公司	2,451	376,473.60	0.11
246	300663	科蓝软件	26,600	376,124.00	0.11
247	601288	农业银行	103,000	374,920.00	0.11
248	002821	凯莱英	3,200	371,520.00	0.11
249	002415	海康威视	10,700	371,504.00	0.11
250	601101	昊华能源	58,600	370,352.00	0.11
251	603076	乐惠国际	13,800	369,840.00	0.11
252	600637	东方明珠	49,100	369,232.00	0.10
253	600867	通化东宝	33,900	367,137.00	0.10
254	601658	邮储银行	84,200	366,270.00	0.10
255	300416	苏试试验	19,900	365,563.00	0.10
256	603187	海容冷链	24,000	363,840.00	0.10
257	605369	拱东医疗	6,500	362,830.00	0.10
258	002390	信邦制药	81,700	362,748.00	0.10
259	002402	和而泰	25,300	361,537.00	0.10
260	002641	公元股份	71,800	361,154.00	0.10
261	603896	寿仙谷	11,200	361,088.00	0.10
262	600584	长电科技	11,900	355,334.00	0.10
263	603936	博敏电子	33,900	353,916.00	0.10
264	601689	拓普集团	4,800	352,800.00	0.10
265	688586	江航装备	31,800	352,662.00	0.10

266	601126	四方股份	24,900	352,584.00	0.10
267	002134	天津普林	32,100	352,137.00	0.10
268	600970	中材国际	37,600	351,184.00	0.10
269	601138	工业富联	23,100	349,272.00	0.10
270	300134	大富科技	33,700	347,784.00	0.10
271	300482	万孚生物	11,500	346,955.00	0.10
272	601319	中国人保	70,900	343,156.00	0.10
273	603032	德新科技	16,800	341,040.00	0.10
274	600380	健康元	27,400	340,582.00	0.10
275	601001	晋控煤业	27,600	340,308.00	0.10
276	600150	中国船舶	11,400	335,616.00	0.10
277	603518	锦泓集团	33,400	334,668.00	0.10
278	002218	拓日新能	74,200	334,642.00	0.10
279	300747	锐科激光	14,200	334,126.00	0.09
280	603699	纽威股份	24,044	333,249.84	0.09
281	600507	方大特钢	71,500	329,615.00	0.09
282	688420	美腾科技	12,600	325,584.00	0.09
283	688578	艾力斯	7,800	324,948.00	0.09
284	002984	森麒麟	11,244	324,389.40	0.09
285	600030	中信证券	15,888	323,638.56	0.09
286	000301	东方盛虹	33,600	322,560.00	0.09
287	601318	中国平安	8,000	322,400.00	0.09
288	688169	石头科技	1,134	320,865.30	0.09
289	300832	新产业	4,100	320,620.00	0.09
290	601222	林洋能源	49,700	317,583.00	0.09
291	601628	中国人寿	11,200	317,520.00	0.09
292	601799	星宇股份	2,400	314,664.00	0.09
293	300501	海顺新材	21,800	314,574.00	0.09
294	002533	金杯电工	38,900	314,312.00	0.09
295	301062	上海艾录	29,000	313,780.00	0.09
296	300263	隆华科技	44,500	313,280.00	0.09
297	000895	双汇发展	11,700	312,507.00	0.09
298	001301	尚太科技	8,500	311,270.00	0.09
299	688016	心脉医疗	1,597	310,824.11	0.09
300	002318	久立特材	15,582	309,770.16	0.09
301	601688	华泰证券	22,200	309,690.00	0.09
302	688526	科前生物	15,002	305,740.76	0.09
303	600285	羚锐制药	17,800	304,558.00	0.09
304	603881	数据港	15,300	303,246.00	0.09
305	000059	华锦股份	55,100	302,499.00	0.09
306	688300	联瑞新材	5,700	301,815.00	0.09
307	002467	二六三	65,000	301,600.00	0.09
308	003012	东鹏控股	36,300	299,475.00	0.09
309	600989	宝丰能源	20,200	298,354.00	0.08

310	600874	创业环保	53,300	295,815.00	0.08
311	600195	中牧股份	24,800	294,128.00	0.08
312	301302	华如科技	11,700	293,787.00	0.08
313	000065	北方国际	26,100	292,842.00	0.08
314	300777	中简科技	9,800	292,334.00	0.08
315	300409	道氏技术	26,000	289,640.00	0.08
316	600351	亚宝药业	41,800	288,420.00	0.08
317	002851	麦格米特	11,600	285,360.00	0.08
318	600875	东方电气	19,400	283,628.00	0.08
319	301179	泽宇智能	10,900	282,855.00	0.08
320	688739	成大生物	8,700	282,837.00	0.08
321	000090	天健集团	60,600	278,760.00	0.08
322	688435	英方软件	5,800	278,516.00	0.08
323	002545	东方铁塔	38,900	278,135.00	0.08
324	603368	柳药集团	14,600	276,232.00	0.08
325	603989	艾华集团	12,700	273,304.00	0.08
326	600058	五矿发展	28,900	271,082.00	0.08
327	301286	侨源股份	9,300	270,258.00	0.08
328	601607	上海医药	16,100	269,353.00	0.08
329	688009	中国通号	61,300	268,494.00	0.08
330	603985	恒润股份	10,800	268,380.00	0.08
331	600774	汉商集团	27,200	268,192.00	0.08
332	000039	中集集团	35,000	267,750.00	0.08
333	002731	萃华珠宝	24,200	267,652.00	0.08
334	300768	迪普科技	18,100	267,518.00	0.08
335	000937	冀中能源	37,400	267,036.00	0.08
336	603920	世运电路	14,600	266,888.00	0.08
337	603558	健盛集团	27,400	265,506.00	0.08
338	601163	三角轮胎	18,300	263,703.00	0.07
339	603179	新泉股份	5,200	263,692.00	0.07
340	002011	盾安环境	19,100	262,625.00	0.07
341	300534	陇神戎发	26,400	260,568.00	0.07
342	603517	绝味食品	9,700	260,542.00	0.07
343	300004	南风股份	41,900	258,942.00	0.07
344	600035	楚天高速	67,700	258,614.00	0.07
345	688330	宏力达	9,100	258,531.00	0.07
346	601811	新华文轩	18,900	258,174.00	0.07
347	601788	光大证券	16,700	257,514.00	0.07
348	601918	新集能源	48,800	257,176.00	0.07
349	688255	凯尔达	10,500	256,725.00	0.07
350	300683	海特生物	7,100	256,381.00	0.07
351	300327	中颖电子	11,100	253,080.00	0.07
352	300671	富满微	7,800	252,174.00	0.07
353	600478	科力远	51,200	251,904.00	0.07

354	300527	中船应急	33,000	251,460.00	0.07
355	000913	钱江摩托	20,100	250,647.00	0.07
356	688613	奥精医疗	11,200	249,312.00	0.07
357	300109	新开源	13,800	248,952.00	0.07
358	000875	吉电股份	56,400	248,160.00	0.07
359	002217	合力泰	91,100	247,792.00	0.07
360	300414	中光防雷	25,700	247,491.00	0.07
361	300036	超图软件	11,800	246,620.00	0.07
362	300596	利安隆	8,300	245,348.00	0.07
363	300685	艾德生物	11,100	243,978.00	0.07
364	688080	映翰通	6,000	243,480.00	0.07
365	603197	保隆科技	4,300	242,520.00	0.07
366	300075	数字政通	13,700	241,120.00	0.07
367	601021	春秋航空	4,800	240,960.00	0.07
368	300166	东方国信	25,400	238,760.00	0.07
369	300323	华灿光电	32,500	237,900.00	0.07
370	603229	奥翔药业	18,000	237,780.00	0.07
371	000555	神州信息	21,000	237,090.00	0.07
372	600618	氯碱化工	26,000	236,600.00	0.07
373	000810	创维数字	15,000	235,650.00	0.07
374	301356	天振股份	12,900	234,651.00	0.07
375	603228	景旺电子	10,400	234,624.00	0.07
376	601019	山东出版	24,900	233,562.00	0.07
377	300382	斯莱克	23,500	233,355.00	0.07
378	300303	聚飞光电	39,300	233,049.00	0.07
379	002948	青岛银行	76,400	233,020.00	0.07
380	301071	力量钻石	7,200	232,560.00	0.07
381	603439	贵州三力	12,300	232,224.00	0.07
382	300377	赢时胜	29,900	232,024.00	0.07
383	002651	利君股份	33,500	231,820.00	0.07
384	601908	京运通	50,700	231,699.00	0.07
385	601608	中信重工	59,900	231,214.00	0.07
386	688575	亚辉龙	10,000	228,700.00	0.06
387	300170	汉得信息	26,900	223,539.00	0.06
388	603611	诺力股份	11,800	223,374.00	0.06
389	601326	秦港股份	77,900	222,015.00	0.06
390	605599	菜百股份	14,900	221,861.00	0.06
391	301361	众智科技	9,300	221,712.00	0.06
392	603298	杭叉集团	8,900	221,432.00	0.06
393	601058	赛轮轮胎	18,800	220,900.00	0.06
394	601038	一拖股份	15,100	220,007.00	0.06
395	688711	宏微科技	5,300	219,897.00	0.06
396	300247	融捷健康	61,600	219,296.00	0.06
397	603882	金域医学	3,500	218,995.00	0.06



398	300274	阳光电源	2,500	218,975.00	0.06
399	002724	海洋王	26,600	218,652.00	0.06
400	300155	安居宝	36,900	218,448.00	0.06
401	603112	华翔股份	17,900	217,485.00	0.06
402	603799	华友钴业	6,600	217,338.00	0.06
403	300440	运达科技	29,100	216,795.00	0.06
404	688598	金博股份	3,100	216,690.00	0.06
405	300963	中洲特材	16,500	216,480.00	0.06
406	688018	乐鑫科技	2,100	216,195.00	0.06
407	688696	极米科技	1,900	214,662.00	0.06
408	300244	迪安诊断	9,000	214,290.00	0.06
409	600446	金证股份	18,500	214,045.00	0.06
410	300272	开能健康	34,500	213,900.00	0.06
411	601088	中国神华	6,800	213,180.00	0.06
412	300128	锦富技术	46,200	212,982.00	0.06
413	600399	抚顺特钢	21,900	212,868.00	0.06
414	002025	航天电器	4,400	211,288.00	0.06
415	301217	铜冠铜箔	17,800	211,108.00	0.06
416	000612	焦作万方	36,700	211,025.00	0.06
417	002185	华天科技	24,700	210,444.00	0.06
418	002194	武汉凡谷	21,300	210,018.00	0.06
419	301257	普蕊斯	3,300	209,550.00	0.06
420	688083	中望软件	2,100	209,034.00	0.06
421	002540	亚太科技	31,600	208,876.00	0.06
422	600976	健民集团	3,200	208,800.00	0.06
423	605376	博迁新材	7,400	208,680.00	0.06
424	002737	葵花药业	8,000	207,840.00	0.06
425	301090	华润材料	19,100	207,426.00	0.06
426	688298	东方生物	5,800	207,408.00	0.06
427	000528	柳工	30,700	206,918.00	0.06
428	301258	富士莱	6,400	206,592.00	0.06
429	002023	海特高新	22,700	206,570.00	0.06
430	601212	白银有色	76,500	205,785.00	0.06
431	601168	西部矿业	14,400	205,488.00	0.06
432	301141	中科磁业	4,400	204,776.00	0.06
433	603507	振江股份	7,900	204,689.00	0.06
434	000767	晋控电力	68,000	204,680.00	0.06
435	601702	华峰铝业	11,400	204,630.00	0.06
436	601989	中国重工	49,500	204,435.00	0.06
437	000997	新大陆	10,400	203,944.00	0.06
438	000625	长安汽车	12,100	203,643.00	0.06
439	300398	飞凯材料	12,900	203,304.00	0.06
440	601577	长沙银行	29,800	203,236.00	0.06
441	603899	晨光股份	5,400	202,770.00	0.06

442	301162	国能日新	3,900	202,332.00	0.06
443	000603	盛达资源	18,300	202,215.00	0.06
444	002993	奥海科技	5,300	201,930.00	0.06
445	300579	数字认证	7,800	201,708.00	0.06
446	002145	中核钛白	45,000	201,600.00	0.06
447	600587	新华医疗	7,800	201,162.00	0.06
448	301026	浩通科技	6,600	200,970.00	0.06
449	600059	古越龙山	21,600	200,880.00	0.06
450	601888	中国中免	2,400	200,856.00	0.06
451	300088	长信科技	30,000	200,700.00	0.06
452	600859	王府井	12,500	199,625.00	0.06
453	603707	健友股份	13,300	199,500.00	0.06
454	002201	正威新材	27,500	198,825.00	0.06
455	600861	北京人力	10,600	198,644.00	0.06
456	000504	南华生物	17,100	198,360.00	0.06
457	600339	中油工程	65,400	198,162.00	0.06
458	300433	蓝思科技	15,000	198,000.00	0.06
459	601186	中国铁建	26,000	197,860.00	0.06
460	688333	铂力特	1,700	197,030.00	0.06
461	688661	和林微纳	4,300	197,026.00	0.06
462	688385	复旦微电	5,100	197,013.00	0.06
463	002918	蒙娜丽莎	14,500	196,330.00	0.06
464	000100	TCL 科技	45,600	196,080.00	0.06
465	300344	立方数科	34,400	195,736.00	0.06
466	000425	徐工机械	35,800	195,468.00	0.06
467	002195	岩山科技	63,600	195,252.00	0.06
468	688133	泰坦科技	4,200	194,670.00	0.06
469	002085	万丰奥威	39,400	194,636.00	0.06
470	603225	新凤鸣	13,700	194,540.00	0.06
471	600660	福耀玻璃	5,200	194,428.00	0.06
472	000933	神火股份	11,563	194,258.40	0.06
473	300773	拉卡拉	12,100	194,084.00	0.06
474	002505	鹏都农牧	121,300	194,080.00	0.06
475	000786	北新建材	8,300	193,888.00	0.06
476	000761	本钢板材	54,300	193,851.00	0.06
477	605507	国邦医药	11,000	193,160.00	0.05
478	300861	美畅股份	5,800	193,082.00	0.05
479	603136	天目湖	10,500	192,885.00	0.05
480	603529	爱玛科技	7,700	192,808.00	0.05
481	002092	中泰化学	31,600	192,760.00	0.05
482	605589	圣泉集团	8,600	192,468.00	0.05
483	000563	陕国投 A	63,200	192,128.00	0.05
484	688091	上海谊众	3,002	192,128.00	0.05
485	300253	卫宁健康	26,700	191,973.00	0.05

486	002378	章源钨业	33,900	191,874.00	0.05
487	688232	新点软件	5,300	191,860.00	0.05
488	603013	亚普股份	11,100	191,808.00	0.05
489	002051	中工国际	23,600	191,632.00	0.05
490	688097	博众精工	5,700	191,520.00	0.05
491	002739	万达电影	14,700	191,394.00	0.05
492	605368	蓝天燃气	17,760	191,275.20	0.05
493	601375	中原证券	49,900	191,117.00	0.05
494	600362	江西铜业	10,700	191,102.00	0.05
495	002985	北摩高科	5,500	190,740.00	0.05
496	600885	宏发股份	6,900	190,716.00	0.05
497	002019	亿帆医药	12,900	190,662.00	0.05
498	000063	中兴通讯	7,200	190,656.00	0.05
499	601233	桐昆股份	12,600	190,638.00	0.05
500	600741	华域汽车	11,700	190,476.00	0.05
501	600050	中国联通	43,400	190,092.00	0.05
502	002001	新 和 成	11,200	189,952.00	0.05
503	002807	江阴银行	53,500	189,925.00	0.05
504	002352	顺丰控股	4,700	189,880.00	0.05
505	688393	安必平	7,600	189,772.00	0.05
506	600575	淮河能源	78,600	189,426.00	0.05
507	002154	报 喜 鸟	33,300	189,144.00	0.05
508	300369	绿盟科技	20,000	188,600.00	0.05
509	601800	中国交建	24,800	188,480.00	0.05
510	601398	工商银行	39,400	188,332.00	0.05
511	600019	宝钢股份	31,700	187,981.00	0.05
512	601816	京沪高铁	38,200	187,944.00	0.05
513	000967	盈峰环境	39,500	187,625.00	0.05
514	000700	模塑科技	26,800	187,600.00	0.05
515	603966	法兰泰克	22,900	187,322.00	0.05
516	601766	中国中车	35,600	187,256.00	0.05
517	600015	华夏银行	33,300	187,146.00	0.05
518	600529	山东药玻	7,300	186,880.00	0.05
519	603199	九华旅游	7,200	186,840.00	0.05
520	600066	宇通客车	14,100	186,825.00	0.05
521	000651	格力电器	5,800	186,586.00	0.05
522	688175	高凌信息	6,673	186,376.89	0.05
523	600176	中国巨石	18,900	185,787.00	0.05
524	002873	新天药业	14,900	185,654.00	0.05
525	002398	垒知集团	38,900	185,553.00	0.05
526	002968	新大正	14,800	185,148.00	0.05
527	601818	光大银行	63,800	185,020.00	0.05
528	002601	龙佰集团	10,800	185,004.00	0.05
529	000910	大亚圣象	23,100	184,800.00	0.05

530	603165	荣晟环保	15,400	184,492.00	0.05
531	600016	民生银行	49,300	184,382.00	0.05
532	002887	绿茵生态	21,200	184,016.00	0.05
533	002078	太阳纸业	15,100	183,767.00	0.05
534	300999	金龙鱼	5,500	183,590.00	0.05
535	000531	穗恒运 A	27,400	183,306.00	0.05
536	600489	中金黄金	18,400	183,264.00	0.05
537	603601	再升科技	42,600	183,180.00	0.05
538	300408	三环集团	6,200	182,590.00	0.05
539	603259	药明康德	2,500	181,900.00	0.05
540	002215	诺普信	22,000	181,720.00	0.05
541	601158	重庆水务	32,000	181,440.00	0.05
542	600562	国睿科技	13,100	181,304.00	0.05
543	603681	永冠新材	12,000	181,200.00	0.05
544	300183	东软载波	12,000	181,080.00	0.05
545	000923	河钢资源	10,700	179,760.00	0.05
546	688310	迈得医疗	6,000	179,400.00	0.05
547	300193	佳士科技	23,000	178,710.00	0.05
548	002129	TCL 中环	11,400	178,296.00	0.05
549	300231	银信科技	17,300	178,017.00	0.05
550	603659	璞泰来	8,500	177,905.00	0.05
551	002932	明德生物	7,700	176,869.00	0.05
552	000060	中金岭南	40,900	176,688.00	0.05
553	688106	金宏气体	7,300	175,857.00	0.05
554	300285	国瓷材料	7,600	175,712.00	0.05
555	300332	天壕能源	22,100	175,695.00	0.05
556	300337	银邦股份	21,700	175,553.00	0.05
557	001696	宗申动力	26,200	173,706.00	0.05
558	300246	宝莱特	16,800	173,040.00	0.05
559	002788	鹭燕医药	19,200	172,608.00	0.05
560	002135	东南网架	29,800	172,244.00	0.05
561	603527	众源新材	15,900	171,879.00	0.05
562	688089	嘉必优	9,600	171,840.00	0.05
563	601633	长城汽车	6,800	171,496.00	0.05
564	002367	康力电梯	22,800	171,456.00	0.05
565	603360	百傲化学	16,200	171,234.00	0.05
566	301208	中亦科技	4,300	167,872.00	0.05
567	688351	微电生理	6,500	166,725.00	0.05
568	002746	仙坛股份	23,600	166,144.00	0.05
569	000938	紫光股份	8,500	164,475.00	0.05
570	300180	华峰超纤	36,900	163,098.00	0.05
571	603811	诚意药业	15,600	161,772.00	0.05
572	603866	桃李面包	21,000	160,860.00	0.05
573	600893	航发动力	4,300	160,734.00	0.05

574	600332	白云山	5,600	160,160.00	0.05
575	002917	金奥博	16,200	159,894.00	0.05
576	002488	金固股份	22,000	157,960.00	0.04
577	301231	荣信文化	6,200	157,790.00	0.04
578	000538	云南白药	3,200	157,280.00	0.04
579	000028	国药一致	5,400	156,546.00	0.04
580	300843	胜蓝股份	6,800	156,264.00	0.04
581	002112	三变科技	14,900	156,152.00	0.04
582	301197	工大科雅	8,300	155,957.00	0.04
583	688733	壹石通	5,300	155,131.00	0.04
584	000725	京东方 A	39,700	154,830.00	0.04
585	601231	环旭电子	10,200	154,122.00	0.04
586	603308	应流股份	10,700	153,331.00	0.04
587	601100	恒立液压	2,800	153,104.00	0.04
588	600477	杭萧钢构	46,200	151,998.00	0.04
589	000663	永安林业	18,800	151,904.00	0.04
590	688168	安博通	4,200	151,872.00	0.04
591	000960	锡业股份	10,600	151,792.00	0.04
592	600346	恒力石化	11,500	151,455.00	0.04
593	002967	广电计量	10,090	151,450.90	0.04
594	601555	东吴证券	20,700	151,317.00	0.04
595	300406	九强生物	7,900	150,890.00	0.04
596	600578	京能电力	50,900	150,664.00	0.04
597	601077	渝农商行	36,900	150,552.00	0.04
598	000728	国元证券	22,000	150,260.00	0.04
599	301123	奕东电子	6,400	150,144.00	0.04
600	601966	玲珑轮胎	7,800	149,994.00	0.04
601	002080	中材科技	9,400	149,648.00	0.04
602	002706	良信股份	16,900	149,227.00	0.04
603	688506	百利天恒	1,065	148,993.50	0.04
604	688126	沪硅产业	8,600	148,952.00	0.04
605	603017	中衡设计	14,800	148,148.00	0.04
606	002508	老板电器	6,800	148,104.00	0.04
607	600588	用友网络	8,300	147,657.00	0.04
608	300702	天宇股份	6,800	147,628.00	0.04
609	600377	宁沪高速	14,400	147,600.00	0.04
610	688707	振华新材	7,200	147,600.00	0.04
611	300896	爱美客	500	147,165.00	0.04
612	002614	奥佳华	19,600	147,000.00	0.04
613	301216	万凯新材	10,400	146,952.00	0.04
614	300750	宁德时代	900	146,934.00	0.04
615	601229	上海银行	24,600	146,862.00	0.04
616	605222	起帆电缆	7,600	146,528.00	0.04
617	603018	华设集团	19,200	145,920.00	0.04

618	600737	中粮糖业	17,700	145,848.00	0.04
619	002960	青鸟消防	10,500	145,320.00	0.04
620	600436	片仔癀	600	145,194.00	0.04
621	601208	东材科技	11,700	144,846.00	0.04
622	600998	九州通	20,600	144,406.00	0.04
623	601360	三六零	16,000	144,160.00	0.04
624	002271	东方雨虹	7,500	144,000.00	0.04
625	000568	泸州老窖	800	143,536.00	0.04
626	002695	煌上煌	13,700	143,439.00	0.04
627	000423	东阿阿胶	2,900	143,028.00	0.04
628	002038	双鹭药业	14,000	142,660.00	0.04
629	000582	北部湾港	18,900	141,939.00	0.04
630	688297	中无人机	3,700	141,821.00	0.04
631	603727	博迈科	11,300	141,589.00	0.04
632	600276	恒瑞医药	3,100	140,213.00	0.04
633	603877	太平鸟	8,200	140,056.00	0.04
634	002452	长高电新	19,700	139,870.00	0.04
635	600887	伊利股份	5,200	139,100.00	0.04
636	000058	深赛格	19,400	139,098.00	0.04
637	000893	亚钾国际	5,300	139,072.00	0.04
638	601881	中国银河	11,500	138,575.00	0.04
639	600271	航天信息	13,000	138,320.00	0.04
640	600415	小商品城	18,863	138,077.16	0.04
641	600977	中国电影	11,200	137,088.00	0.04
642	600675	中华企业	43,400	136,710.00	0.04
643	600320	振华重工	41,000	136,120.00	0.04
644	000915	华特达因	4,700	136,112.00	0.04
645	002340	格林美	24,900	135,954.00	0.04
646	600135	乐凯胶片	16,700	134,769.00	0.04
647	600496	精工钢构	43,700	133,285.00	0.04
648	603232	格尔软件	9,700	132,793.00	0.04
649	002563	森马服饰	22,900	132,133.00	0.04
650	688007	光峰科技	5,100	131,988.00	0.04
651	300476	胜宏科技	7,000	129,150.00	0.04
652	002007	华兰生物	5,800	128,354.00	0.04
653	600381	青海春天	16,500	127,545.00	0.04
654	601611	中国核建	18,400	127,512.00	0.04
655	002276	万马股份	12,100	123,662.00	0.04
656	603444	吉比特	500	122,560.00	0.03
657	300232	洲明科技	13,800	121,440.00	0.03
658	600999	招商证券	8,700	118,668.00	0.03
659	002142	宁波银行	5,900	118,649.00	0.03
660	688072	拓荆科技	508	117,500.40	0.03
661	000703	恒逸石化	17,200	115,584.00	0.03

662	601939	建设银行	17,700	115,227.00	0.03
663	300515	三德科技	9,800	113,092.00	0.03
664	300239	东宝生物	18,000	112,140.00	0.03
665	600392	盛和资源	11,000	111,980.00	0.03
666	002373	千方科技	9,700	108,737.00	0.03
667	300888	稳健医疗	2,900	108,025.00	0.03
668	601717	郑煤机	8,300	104,995.00	0.03
669	600879	航天电子	13,600	104,856.00	0.03
670	600987	航民股份	11,800	103,368.00	0.03
671	688006	杭可科技	4,400	103,312.00	0.03
672	001322	箭牌家居	8,600	101,996.00	0.03
673	300602	飞荣达	5,600	101,192.00	0.03
674	300142	沃森生物	4,200	98,742.00	0.03
675	605008	长鸿高科	6,200	98,394.00	0.03
676	600438	通威股份	3,900	97,617.00	0.03
677	002008	大族激光	4,700	97,384.00	0.03
678	600400	红豆股份	34,000	94,860.00	0.03
679	000795	英洛华	15,100	94,073.00	0.03
680	300623	捷捷微电	5,900	93,633.00	0.03
681	603609	禾丰股份	10,600	90,736.00	0.03
682	300435	中泰股份	6,300	90,594.00	0.03
683	002296	辉煌科技	10,600	87,450.00	0.02
684	688327	云从科技	5,100	85,986.00	0.02
685	688190	云路股份	1,200	85,956.00	0.02
686	300613	富瀚微	2,000	84,880.00	0.02
687	301096	百诚医药	1,300	84,630.00	0.02
688	002568	百润股份	3,400	83,674.00	0.02
689	601919	中远海控	8,700	83,346.00	0.02
690	600602	云赛智联	7,200	83,304.00	0.02
691	002223	鱼跃医疗	2,400	82,992.00	0.02
692	300558	贝达药业	1,600	82,480.00	0.02
693	603185	弘元绿能	2,400	79,872.00	0.02
694	002014	永新股份	9,500	79,325.00	0.02
695	300474	景嘉微	1,100	77,781.00	0.02
696	300719	安达维尔	5,800	77,314.00	0.02
697	301246	宏源药业	2,900	75,342.00	0.02
698	300821	东岳硅材	9,000	74,700.00	0.02
699	000036	华联控股	19,200	74,688.00	0.02
700	600583	海油工程	11,900	70,686.00	0.02
701	600665	天地源	18,400	69,552.00	0.02
702	300624	万兴科技	700	66,220.00	0.02
703	688088	虹软科技	1,600	65,664.00	0.02
704	300480	光力科技	3,000	64,050.00	0.02
705	300277	海联讯	7,100	61,415.00	0.02

706	300638	广和通	3,200	60,896.00	0.02
707	601369	陕鼓动力	7,400	59,052.00	0.02
708	600546	山煤国际	3,300	57,783.00	0.02
709	002264	新华都	10,400	57,304.00	0.02
710	688511	天微电子	1,800	56,646.00	0.02
711	002148	北纬科技	9,300	56,172.00	0.02
712	300573	兴齐眼药	300	54,696.00	0.02
713	300229	拓尔思	3,200	53,952.00	0.02
714	301345	涛涛车业	800	48,720.00	0.01
715	300188	美亚柏科	2,900	46,458.00	0.01
716	000062	深圳华强	4,100	46,207.00	0.01
717	002396	星网锐捷	2,500	45,175.00	0.01
718	300783	三只松鼠	2,400	43,320.00	0.01
719	002925	盈趣科技	1,900	36,993.00	0.01
720	688158	优刻得	2,000	32,900.00	0.01
721	002028	思源电气	600	31,224.00	0.01
722	300795	米奥会展	800	29,496.00	0.01
723	688400	凌云光	900	24,300.00	0.01
724	688563	航材股份	320	19,356.80	0.01
725	002831	裕同科技	700	19,257.00	0.01
726	688361	中科飞测	249	18,533.07	0.01
727	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.01
728	600810	神马股份	2,400	17,856.00	0.01
729	301291	明阳电气	614	17,413.04	0.00
730	688652	京仪装备	318	16,615.50	0.00
731	600863	内蒙华电	4,200	16,380.00	0.00
732	603505	金石资源	600	16,290.00	0.00
733	600984	建设机械	4,100	15,375.00	0.00
734	301498	乖宝宠物	373	14,476.13	0.00
735	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
736	688702	盛科通信	289	13,924.02	0.00
737	688798	艾为电子	200	13,806.00	0.00
738	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
739	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
740	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
741	688469	芯联集成	2,465	12,374.30	0.00
742	688631	莱斯信息	336	11,844.00	0.00
743	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
744	300815	玉禾田	800	11,680.00	0.00
745	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
746	688159	有方科技	300	11,295.00	0.00
747	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
748	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
749	600073	上海梅林	1,600	10,896.00	0.00



750	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
751	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
752	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
753	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
754	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
755	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
756	688418	震有科技	500	9,430.00	0.00
757	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
758	301371	敷尔佳	245	9,207.10	0.00
759	301559	中集环科	504	9,192.96	0.00
760	002079	苏州固锝	800	9,024.00	0.00
761	301500	飞南资源	428	8,940.92	0.00
762	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
763	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
764	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
765	301520	万邦医药	150	7,911.00	0.00
766	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
767	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
768	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
769	688429	时创能源	346	7,331.74	0.00
770	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
771	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
772	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
773	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
774	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
775	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
776	002214	大立科技	300	3,441.00	0.00
777	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
778	001965	招商公路	7	68.39	0.00

注：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。

## 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	601318	中国平安	13,501,819.00	1.56

2	000063	中兴通讯	7,338,160.00	0.85
3	600809	山西汾酒	6,758,125.00	0.78
4	002304	洋河股份	6,537,881.00	0.75
5	601668	中国建筑	6,444,834.00	0.74
6	300750	宁德时代	6,213,794.00	0.72
7	600941	中国移动	6,104,710.00	0.70
8	600325	华发股份	6,048,386.00	0.70
9	600519	贵州茅台	5,646,661.00	0.65
10	605168	三人行	5,486,418.20	0.63
11	000400	许继电气	5,431,717.00	0.63
12	002555	三七互娱	5,370,630.00	0.62
13	002139	拓邦股份	5,199,719.00	0.60
14	603444	吉比特	5,134,733.00	0.59
15	000921	海信家电	4,931,411.80	0.57
16	601601	中国太保	4,929,380.00	0.57
17	601126	四方股份	4,896,501.00	0.56
18	601728	中国电信	4,830,326.00	0.56
19	000811	冰轮环境	4,812,868.00	0.56
20	688128	中国电研	4,759,893.04	0.55

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	601318	中国平安	23,784,319.06	2.74
2	600519	贵州茅台	19,434,380.56	2.24
3	300750	宁德时代	16,576,263.46	1.91
4	000858	五粮液	14,375,018.85	1.66
5	601888	中国中免	13,557,973.16	1.56
6	300122	智飞生物	12,321,648.94	1.42
7	600036	招商银行	11,710,672.61	1.35
8	600919	江苏银行	9,884,464.58	1.14
9	601668	中国建筑	9,308,328.39	1.07
10	600887	伊利股份	9,280,403.33	1.07
11	300760	迈瑞医疗	8,823,050.18	1.02
12	002271	东方雨虹	8,797,464.89	1.02
13	600325	华发股份	8,694,617.60	1.00
14	600048	保利发展	8,638,339.28	1.00
15	300059	东方财富	8,213,945.32	0.95
16	000333	美的集团	7,859,282.07	0.91

17	600426	华鲁恒升	7,795,422.25	0.90
18	300274	阳光电源	7,645,762.35	0.88
19	002049	紫光国微	7,101,465.84	0.82
20	603300	华铁应急	7,057,420.25	0.81

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,487,926,367.43
卖出股票的收入（成交）总额	2,781,973,619.65

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	12,640,920.11	3.59
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	12,640,920.11	3.59

#### 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	124,000	12,640,920.11	3.59

### 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

本基金利用股指期货与股票现货组合之间进行对冲，并通过量化模型，构建市场中性阿尔法股票组合，同时采用安全有效的风险监控，在降低套利风险的同时，力争为投资者获取超额稳定的收益。

本基金投资于股指期货，通过对冲功能剥离股票现货部分的系统性风险，符合既定投资政策及投资目标。

### 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，本基金暂不投资国债期货。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

### 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 246,547,929.57 元，占基金资产净值的比例为 70.03%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-211,040,240.00 元，占基金资产净值的比例为-59.95%，空头合约市值占股票资产的比例为-85.60%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为-23,417,508.69 元，公允价值变动损益为 22,193,617.43 元。

### 8.13 投资组合报告附注

**8.13.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体中，安克创新科技股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到长沙市市场监督管理局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在本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	27,472,015.32
2	应收清算款	1,989,044.64
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	59,016.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,520,076.19

#### 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
海富通阿尔法对冲混合 A	136,757	2,259.22	43,718,093.32	14.15%	265,246,518.72	85.85%
海富通阿尔法对冲混合 C	4,083	4,976.74	1,271,457.70	6.26%	19,048,578.34	93.74%
合计	140,840	2,338.01	44,989,551.02	13.66%	284,295,097.06	86.34%

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	海富通阿尔法对冲混合 A	1,128,910.52	0.3654%
	海富通阿尔法对冲混合 C	137,071.96	0.6746%
	合计	1,265,982.48	0.3845%

## 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	海富通阿尔法对冲混合 A	50~100
	海富通阿尔法对冲混合 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通阿尔法对冲混合 A	50~100
	海富通阿尔法对冲混合 C	0
	合计	50~100

#### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金募集期间，本基金管理人运用固有资金作为发起资金总计 1000.10 万元认购了本基金，其中，认购费用为 1000 元，符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有不少于 3 年。截至 2017 年 11 月 20 日，发起份额承诺持有期限已经届满。2017 年 12 月公司赎回所有份额。截止报告期末，公司未持有本基金份额。

#### §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通阿尔法对冲混合 A	海富通阿尔法对冲混合 C
基金合同生效日（2014 年 11 月 20 日）基金份额总额	719,877,758.17	-
本报告期期初基金份额总额	743,706,885.57	50,755,429.52
本报告期基金总申购份额	79,292,469.71	16,462,929.28
减：本报告期基金总赎回份额	514,034,743.24	46,898,322.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	308,964,612.04	20,320,036.04

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 60,000.00 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国盛证券	2	671,817,816.72	12.78%	490,168.62	14.02%	-
国泰君安	2	670,948,604.60	12.76%	491,985.72	14.08%	-
国金证券	1	626,612,484.52	11.92%	340,543.85	9.74%	-
中信证券	4	596,813,209.60	11.35%	432,121.18	12.36%	-
华西证券	1	478,923,492.05	9.11%	350,818.60	10.04%	-
银河证券	1	447,769,454.05	8.52%	237,678.45	6.80%	-
太平洋证券	2	363,531,056.65	6.91%	267,520.72	7.65%	-
申万宏源	2	355,168,038.03	6.75%	149,701.87	4.28%	-
天风证券	2	315,830,052.33	6.01%	231,137.60	6.61%	-
开源证券	2	214,631,811.98	4.08%	156,530.07	4.48%	-
上海证券	1	185,070,592.34	3.52%	136,801.05	3.91%	-
招商证券	2	124,910,475.44	2.38%	93,115.08	2.66%	-
华创证券	1	99,995,817.79	1.90%	42,128.70	1.21%	-
野村东方国	1	86,391,878.83	1.64%	62,314.18	1.78%	-



际证券						
长江证券	1	19,691,101.83	0.37%	12,234.24	0.35%	-
中金公司	2	438,144.31	0.01%	326.81	0.01%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

## 2、(1)交易单元的选择标准

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

## (2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

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

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

## 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
国盛证券	11,027,643.50	8.13%	-	-	-	-
国泰君安	20,053,024.06	14.79%	-	-	-	-
国金证券	26,039,483.41	19.21%	30,000,000.00	75.00%	-	-
中信证券	210,694.70	0.16%	-	-	-	-
华西证券	12,502,995.89	9.22%	-	-	-	-
银河证券	235,074.48	0.17%	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	423,901.44	0.31%	-	-	-	-
天风证券	5,908,260.00	4.36%	-	-	-	-
开源证券	14,112,307	10.41%	-	-	-	-

	.00					
上海证券	45,050,095.52	33.23%	10,000,000.00	25.00%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-08
2	海富通基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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上海长量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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-02
4	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启富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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增新华信通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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
6	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
7	海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资	中国证券报、基金管	2023-04-11

	资基金基金经理变更公告	理人网站及中国证监会基金电子披露网站	
8	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-05
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海大智慧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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-08
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国工商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-18
11	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-07-14
12	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-07-19
13	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-25
14	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-26
15	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-11-09
16	海富通基金管理有限公司关于调整基金经理助理的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-11-24
17	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 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阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金的文件
- (二)海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金基金合同
- (三)海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金招募说明书
- (四)海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

### 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