

**华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混
合型发起式
证券投资基金
2022 年中期报告
2022 年 6 月 30 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	9
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	11
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 市场中性策略执行情况.....	49
7.13 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	54

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	华夏安泰对冲策略3个月定开混合
基金主代码	008856
交易代码	008856
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020年6月5日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
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	161,190,971.96份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制系统性风险的基础上,运用量化模型建立投资组合,通过衍生工具对冲市场风险,力争实现长期稳健的绝对收益。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、绝对收益策略、债券投资策略、股指期货和股票期权投资策略、国债期货投资策略、融资融券投资策略、存托凭证投资策略等。本基金所指的绝对收益策略包括 ALPHA 对冲策略、套利策略、衍生品交易策略、融资融券策略等。本基金以基金管理人自主开发的量化多因子模型为基础,灵活运用多种投资策略建立投资组合,在有效控制风险的前提下,通过金融衍生品工具对冲市场风险,力争实现长期稳健的绝对收益。
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率(税后)+2%。
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金,通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险,因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准,由于绝对收益策略投资结果的不确定性,因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。

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		华夏基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	许俊
	联系电话	400-818-6666	95566
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95566
传真		010-63136700	010-66594942
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街1号

邮政编码	100033	100818
法定代表人	杨明辉	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-15,312,881.70
本期利润	-9,103,478.90
加权平均基金份额本期利润	-0.0270
本期加权平均净值利润率	-2.59%
本期基金份额净值增长率	-0.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	9,086,660.37
期末可供分配基金份额利润	0.0564
期末基金资产净值	170,785,043.55
期末基金份额净值	1.0595
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	5.95%

注：①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。

②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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润为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。

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

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去一个月	0.17%	0.50%	0.29%	0.00%	-0.12%	0.50%
过去三个月	0.30%	0.52%	0.87%	0.00%	-0.57%	0.52%
过去六个月	-0.07%	0.46%	1.74%	0.00%	-1.81%	0.46%
过去一年	-2.21%	0.41%	3.50%	0.00%	-5.71%	0.41%
自基金合同生效起至今	5.95%	0.36%	7.24%	0.00%	-1.29%	0.36%

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

华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年6月5日至2022年6月30日)



§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

华夏基金管理有限公司成立于1998年4月9日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司,在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批QDII基金管理人、境内首只ETF基金管理人、境内首只沪港通ETF基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募FOF基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通ETF基金管理人,首批商品期货ETF基金管理人,以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人,香港子公司是首批RQFII基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内ETF基金资产管理规模最大的基金管理公司之一,在ETF基金管理方面积累了丰富的经验,形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础,尽力捕捉市场机会,为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》,截至2022年6月30日,华夏基金旗下多只产品近1年同类排名领先(基金排名不作为产品未来表现的保证),其中:

主动权益产品:在偏股型基金(股票上限95%)(A类)中华夏兴和混合排序第1/188、华夏兴华混合(A类)排序第16/188;在养老目标日期FOF(2040)(A类)中华夏养老2040三年持有混合(FOF)排序第2/14;在定开偏股型基金(A类)中华夏磐利一年定开混合(A类)排序第2/77、华夏磐锐一年定开混合(A类)排序第10/77、华夏磐益一年定开混合排序第11/77、华夏成长精选6个月定开混合(A类)排序第24/77;在医药医疗健康行业偏股型基金(股票上下限60%-95%)(A类)中华夏逸享健康混合(A类)排序第9/52;在消费行业偏股型基金(股票上下限60%-95%)(A类)中华夏网购精选混合(A类)排序第10/53;在偏股型基金(股票上限80%)(A类)中华夏经典混合排序第22/134;在偏股型基金(股票上下限60%-95%)(A类)中华夏行业景气混合排序第29/905、华夏产业升级混合(A类)排序第55/905、华夏盛世混合排序第67/905;在标准股票型基金(A类)中华夏智胜价值成长股票(A类)排序第59/286;在灵活配置型基金(基准股票比例60%-100%)(A类)中华夏圆和混合(A类)排序第74/436。

固收与固收+产品:在QDII债券型基金(A类)中华夏大中华信用债券(QDII)(A类)排序第1/25;在信用债指数债券型基金(A类)中华夏亚债中国指数(A类)排序第3/13;在利率债指数债券型基金(A类)中华夏中债3-5年政金债指数(A类)排序第7/98;在中短期纯债债券型基金(A类)中华夏中短债债券(A类)排序第21/84;在长期纯债债券型基金(A类)中华夏鼎航债券(A类)排序第28/642;在偏债型基金(A类)中华夏磐泰混合(LOF)(A类)排序第32/350、华夏睿磐泰盛混合排序第36/350、华夏永康添福混合(A类)排序第46/350、华夏睿磐泰利混合(A类)排序第63/350。

指数与量化产品：在 QDII 跨境股票 ETF 基金中华夏纳斯达克 100ETF (QDII) 排序第 4/19；在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 1000ETF 排序第 3/116、华夏中证 500ETF 排序第 18/116；在主题指数股票 ETF 联接基金(A类)中华夏中证四川国改 ETF 联接(A类)排序第 3/60、华夏中证央企 ETF 联接(A类)排序第 15/60；在行业指数股票 ETF 联接基金(A类)中华夏中证全指房地产 ETF 联接(A类)排序第 4/24、华夏中证银行 ETF 联接(A类)排序第 6/24；在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指房地产 ETF 排序第 7/41、华夏中证银行 ETF 排序第 10/41；在规模指数股票 ETF 联接基金(A类)中华夏中证 500ETF 联接(A类)排序第 15/80；在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源 ETF 排序第 14/169、华夏中证四川国改 ETF 排序第 17/169、华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 24/169。

在证券时报主办的第十七届中国基金业明星基金奖评选活动中，在最具含金量、最能体现基金公司综合实力的“年度十大明星基金公司奖”评选中，华夏基金凭借在多项业务中的优异中长期表现，成功获奖。此外，凭借 QDII 基金的良好业绩表现，以及在境内外市场的持续布局，华夏基金还获得“三年海外投资明星基金公司奖”。

在客户服务方面，2022 年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）华夏基金直销上线北京银行、广发银行快捷等支付方式，拓展支付渠道的同时交易额度也得到进一步提升，满足客户支付需求；（2）华夏基金管家客户端优化资料上传、定投收益展示等功能，增加客户操作便利性；（3）与兰州银行、九江银行、晋商银行、九州证券等代销机构合作，拓展更加丰富的客户理财渠道；（4）开展“压岁钱手账”、“基金视力表”、“与干饭人灵魂相认”、“童言童语话理财”、“FOF 产品不是小透明”等活动，为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

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		
孙蒙	本基金的基金经理	2020-06-05	-	8 年	硕士。曾任中信建投证券股份有限公司研究员、投资经理等。2017 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理。

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 54 次，其中 3 次为投资策略需要所致，为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理已根据公司管理要求提供决策依据；其余均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

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

上半年，外部形势较为复杂，全球通胀和衰退风险给中国外需带来了一定的压力。美国与欧洲均面临高通胀的困扰，全球 PMI 进入下降周期，多个指标表明全球经济面临衰退风险。国内方面，上半年疫情对经济带来了一定程度的冲击，但近期负面影响正在逐步消退。在克服了国际环境复杂多变、国内疫情反复冲击等诸多不利因素后，5 月主要经济指标降幅收窄，6 月多项经济数据企稳回升，二季度经济实现正增长。6 月我国消费增速由负转正，同比增长 3.1%；服务业生产指数同比增长 1.3%；总体来看，上半年国内生产总值同比增长 2.5%，其中二季度国内生产总值同比增长 0.4%。

市场方面，煤炭及稳增长相关行业表现较好，而科技成长行业表现较差。量化因子表现波动较大，市场下跌阶段大盘、价值表现较好，而市场反弹阶段小盘、成长表现较好。整体上估值、反转因子表现较好，而盈利、成长表现较差，量化策略表现处于历史平均水平。

基金投资运作方面，股票端以多因子量化投资策略为主，对冲端通过股指期货对冲市场风险，力争获取绝对收益表现。我们在依据量化模型进行股票投资决策之外，还积极参与了科创板、创业板新股申购，获取较为确定性的收益增厚机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0595 元，本报告期份额净值增长率为-0.07%，同期业绩比较基准增长率为 1.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国际方面，全球通胀水平持续攀升，主要经济体偿债压力不断加大，稳定外需难度也在明显增加，外部环境更趋复杂严峻。随着美联储等海外主要央行货币紧缩进程的加快，当前国际金融市场的关注焦点正从通胀转向衰退。国内方面，下半年外部不稳定、不确定的因素仍较多，但随着一系列稳增长政策措施的落地见效，以及高效统筹疫情防控和经济社会发展成效的持续显现，下半年我国经济有望继续回升并运行在合理区间。展望下半年，预计市场呈现震荡上行走势，行业或者风格板块呈现轮动特征。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§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”）在华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2022年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,980,002.84	5,144,367.77
结算备付金		4,749,556.09	57,591,651.25
存出保证金		16,930,739.55	57,222,507.73
交易性金融资产	6.4.7.2	148,024,457.11	532,150,614.10
其中：股票投资		147,984,749.63	532,118,680.90
基金投资		-	-
债券投资		39,707.48	31,933.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	7,600,000.00
应收清算款		18,406.88	476,931.71
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	26,553.49

资产总计		171,703,162.47	660,212,626.05
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		169,830.29	672,211.31
应付托管费		35,381.32	140,044.00
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.34	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	712,906.97	923,311.45
负债合计		918,118.92	1,735,566.76
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	161,190,971.96	621,101,684.93
未分配利润	6.4.7.8	9,594,071.59	37,375,374.36
净资产合计		170,785,043.55	658,477,059.29
负债和净资产总计		171,703,162.47	660,212,626.05

注：①报告截止日2022年6月30日，基金份额净值1.0595元，基金份额总额161,190,971.96份。

②以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在2022年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在2022年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年1月1日至 2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年6月30日
----	-----	--------------------------------	-------------------------------------

一、营业总收入		-6,228,509.58	52,133,141.47
1.利息收入		320,881.47	964,428.00
其中：存款利息收入	6.4.7.9	283,035.14	470,578.25
债券利息收入		-	320.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		37,846.33	493,529.22
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-13,256,945.23	46,771,929.71
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-55,129,469.62	104,091,921.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	6,491.91	54,440.68
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	40,551,538.43	-61,109,099.59
股利收益	6.4.7.14	1,314,494.05	3,734,666.90
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	6,209,402.80	3,825,253.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	498,151.38	571,530.73
减：二、营业总支出		2,874,969.32	7,471,215.61
1.管理人报酬		2,172,154.11	2,983,295.45
2.托管费		452,532.10	621,519.85
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		149,713.26	0.29
8.其他费用	6.4.7.18	100,569.85	3,866,400.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,103,478.90	44,661,925.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,103,478.90	44,661,925.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-9,103,478.90	44,661,925.86

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在2022年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	621,101,684.93	-	37,375,374.36	658,477,059.29
二、本期期初净资产（基金净值）	621,101,684.93	-	37,375,374.36	658,477,059.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-459,910,712.97	-	-27,781,302.77	-487,692,015.74
（一）、综合收益总额	-	-	-9,103,478.90	-9,103,478.90
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-459,910,712.97	-	-18,677,823.87	-478,588,536.84
其中：1.基金申购款	676,237.78	-	25,765.42	702,003.20
2.基金赎回款	-460,586,950.75	-	-18,703,589.29	-479,290,540.04
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	161,190,971.96	-	9,594,071.59	170,785,043.55
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	692,976,728.24	-	-2,798,181.20	690,178,547.04
二、本期期初净资产（基金净值）	692,976,728.24	-	-2,798,181.20	690,178,547.04

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-106,950,428.07	-	51,684,715.28	-55,265,712.79
（一）、综合收益总额	-	-	44,661,925.86	44,661,925.86
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-106,950,428.07	-	7,022,789.42	-99,927,638.65
其中：1.基金申购款	388,314,354.21	-	22,455,332.55	410,769,686.76
2.基金赎回款	-495,264,782.28	-	-15,432,543.13	-510,697,325.41
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	586,026,300.17	-	48,886,534.08	634,912,834.25

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]2892 号《关于准予华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，存续期限为不定期。本基金于 2020 年 5 月 13 日至 2020 年 6 月 2 日募集 1,153,584,795.34 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2020）验字第 60739337_A30 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2020 年 6 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,154,005,597.33 份基金份

额，其中认购资金利息折合 420,801.99 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本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（包括创业板、中小板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换公司债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具（含同业存单）、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权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相关规定)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《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>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“新金融工具准则”)、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则的累积影响数调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，将金融工具分类为以摊余成本计量的金融

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公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有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。

新金融工具准则要求对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于 2021 年 12 月 31 日，银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、交易性金融资产、卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款等科目项下列示，同时以摊余成本法计量的金融资产按照预期信用损失为基准，计提损失准备 0.00 元，对本基金期初未分配利润无影响。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 5,144,367.77 元、57,591,651.25 元、57,222,507.73 元、7,600,000.00 元、26,553.49 元和 476,931.71 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 5,145,152.52 元、57,620,935.43 元、57,222,592.32 元、7,596,390.14 元、0.00 元和 476,931.71 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 532,150,614.10 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 532,150,623.93 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 672,211.31 元、140,044.00 元、733,311.45 元和 190,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 672,211.31 元、140,044.00 元、733,311.45 元和 190,000.00 元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局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《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]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：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。
- (2) 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。
- (3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。
- (4) 存款利息收入不征收增值税。
- (5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。
- (6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- (7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所

得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，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，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。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

（9）基金在境内卖出股票按 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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

（10）基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

（11）本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	1,980,002.84
等于：本金	1,979,713.15
加：应计利息	289.69
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	1,980,002.84

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	142,412,559.38	-	147,984,749.63	5,572,190.25	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	39,700.00	7.48	39,707.48	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	39,700.00	7.48	39,707.48	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	142,452,259.38	7.48	148,024,457.11	5,572,190.25	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-124,257,072.23	-	-	-
其中：股指期货	-124,257,072.23	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-124,257,072.23	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2209	中证500期货 IC2209 合约	-4.00	-5,091,200.00	-460,813.33
IF2207	沪深300期货 IF2207 合约	-21.00	-28,181,160.00	-1,847,580.00
IC2207	中证500期货 IC2207 合约	-22.00	-28,312,240.00	-911,760.00
IF2209	沪深300期货 IF2209	-54.00	-72,044,640.00	-6,152,014.44

	合约			
合计	-	-	-	-9,372,167.77
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-9,372,167.77
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	548,687.42
其中：交易所市场	548,687.42
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	164,219.55
合计	712,906.97

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	621,101,684.93	621,101,684.93
本期申购	676,237.78	676,237.78
本期赎回（以“-”号填列）	-460,586,950.75	-460,586,950.75

本期末	161,190,971.96	161,190,971.96
-----	----------------	----------------

6.4.7.8 未分配利润

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
本期期初	43,553,620.07	-6,178,245.71	37,375,374.36
本期利润	-15,312,881.70	6,209,402.80	-9,103,478.90
本期基金份额交易产生的变动数	-19,154,078.00	476,254.13	-18,677,823.87
其中：基金申购款	25,159.15	606.27	25,765.42
基金赎回款	-19,179,237.15	475,647.86	-18,703,589.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,086,660.37	507,411.22	9,594,071.59

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	22,896.53
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	258,576.71
其他	1,561.90
合计	283,035.14

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	1,192,575,220.92
减：卖出股票成本总额	1,245,429,734.12
减：交易费用	2,274,956.42
买卖股票差价收入	-55,129,469.62

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	18.95
债券投资收益——买卖债券（债转股及	6,472.96

债券到期兑付) 差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	6,491.91

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	39,494.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	33,000.00
减：应计利息总额	21.73
减：交易费用	0.01
买卖债券差价收入	6,472.96

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	40,551,538.43

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,314,494.05
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,314,494.05

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	4,131,210.46
——股票投资	4,140,143.66
——债券投资	-8,933.20
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	2,078,192.34
——权证投资	-
——期货投资	2,078,192.34
4.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	6,209,402.80

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	498,151.38
基金申购费收入	-
合计	498,151.38

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	6,350.30
合计	100,569.85

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	724,737,741.45	35.52%	2,920,061,552.46	82.03%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	-	-	298,124.20	15.05%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例

		比例		
中信证券	106,800,000.00	26.14%	3,452,900,000.00	78.77%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	312,583.08	35.52%	193,920.07	35.34%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中信证券	1,259,451.47	82.03%	704,712.70	53.26%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,172,154.11	2,983,295.45
其中：支付销售机构的客户维护费	260,218.11	1,149,009.49

注：①支付基金管理人的基金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。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30 日
----	--------------------------------	-------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	452,532.10	621,519.85
----------------	------------	------------

注：①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。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
期初持有的基金份额	10,000,900.09	10,000,900.09
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,900.09	10,000,900.09
期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.20%	1.71%

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行活期存款	1,980,002.84	22,896.53	8,377,979.59	34,213.20

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	688223	晶科能源	新股发行	84,419	422,095.00
中信证券	301200	大族数控	新股发行	4,169	319,178.64
中信证券	688302	海创药业	新股发行	6,686	286,963.12
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	1,138	137,698.00
中信证券	301109	军信股份	新股发行	3,552	123,645.12
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60
中信证券	688150	莱特光电	新股发行	4,461	98,365.05
中信证券	301302	华如科技	新股发行	1,638	85,225.14
中信证券	600938	中国海油	新股发行	3,000	32,400.00
中信证券	603132	金徽股份	新股发行	1,342	14,493.60
中信证券	603191	望变电气	新股发行	1,149	13,627.14
中信证券	603209	兴通股份	新股发行	595	12,804.40
中信证券	001266	宏英智能	新股发行	247	9,536.67
中信证券	603215	比依股份	新股发行	575	7,187.50
中信证券	603051	鹿山新材	新股发行	272	7,014.88
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	600905	三峡能源	网下申购	1,296,803	3,436,527.95
中信证券	688819	天能股份	网下申购	11,495	480,376.05
中信证券	688617	惠泰医疗	网下申购	1,673	124,571.58
中信证券	688276	百克生物	网下申购	2,896	105,269.60
中信证券	688575	亚辉龙	网下申购	3,435	50,838.00
中信证券	300993	玉马遮阳	网下申购	4,097	49,573.70
中信证券	688315	诺禾致源	网下申购	3,711	47,352.36
中信证券	300997	欢乐家	网下申购	9,279	45,838.26
中信证券	688607	康众医疗	网下申购	1,890	43,866.90
中信证券	300930	屹通新材	网下申购	3,220	42,214.20
中信证券	603529	爱玛科技	网下申购	1,019	28,389.34
中信证券	688690	纳微科技	网下申购	3,477	28,059.39
中信证券	300966	共同药业	网下申购	2,858	23,549.92
中信证券	688565	力源科技	网下申购	2,464	23,136.96
中信证券	688226	威腾电气	网下申购	2,693	17,289.06
中信证券	600916	中国黄金	网下申购	3,371	16,821.29
中信证券	605060	联德股份	网下申购	883	13,765.97

中信证券	605488	福莱新材	网下申购	416	8,498.88
中信证券	001208	华菱线缆	网下申购	1,754	6,437.18
中信证券	003040	楚天龙	网下申购	1,101	5,086.62
中信证券	601279	英利汽车	网下申购	2,004	4,148.28

注：本期“网上申购”和“网下申购”两种发行方式合并披露为“新股发行”。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额为 574,210,420.00 元（上年度可比期间：659,258,100.00 元），支付给中信期货的佣金为 13,603.10 元（上年度可比期间为：15,617.87 元）。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2022年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600941	中国移动	2021-12-24	6个月	新发流通受限	57.58	60.26	87,363	5,030,361.54	5,264,494.38	-
688331	荣昌生物	2022-03-24	6个月	新发流通受限	48.00	42.94	3,841	184,368.00	164,932.54	-
688295	中复神鹰	2022-03-28	6个月	新发流通受限	29.33	34.42	4,300	126,119.00	148,006.00	-

301200	大族数控	2022-02-18	6 个月	新发 流通 受限	76.56	51.92	417	31,925.52	21,650.64	-
301122	采纳股份	2022-01-19	6 个月	新发 流通 受限	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301206	三元生物	2022-01-26	6 个月	新发 流通 受限	109.30	45.69	421	30,713.30	19,235.49	含 证 券 送 配
301123	奕东电子	2022-01-14	6 个月	新发 流通 受限	37.23	25.39	615	22,896.45	15,614.85	-
301286	侨源股份	2022-06-06	6 个月	新发 流通 受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6 个月	新发 流通 受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301298	东利机械	2022-05-27	6 个月	新发 流通 受限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301236	软通	2022-03-08	6 个月	新发	72.88	31.38	405	19,677.60	12,708.90	含 证

	动力			流通受限						券送配
301259	艾布鲁	2022-04-18	6个月	新发流通受限	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301097	天益医疗	2022-03-25	6个月	新发流通受限	52.37	47.83	239	12,516.43	11,431.37	-
301220	亚香股份	2022-06-15	6个月	新发流通受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301248	杰创智能	2022-04-13	6个月	新发流通受限	39.07	29.87	372	14,534.04	11,111.64	-
301196	唯科科技	2022-01-04	6个月	新发流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	6个月	新发流通受限	42.50	32.02	312	10,200.00	9,990.24	含证券送配
301150	中一科技	2022-04-14	6个月	新发流通	163.56	82.76	120	13,084.80	9,931.20	含证券送

				受限						配
301302	华如科技	2022-06-16	6个月	新发流通受限	52.03	56.42	164	8,532.92	9,252.88	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6个月	新发流通受限	39.88	31.09	294	11,724.72	9,140.46	-
301125	腾亚精工	2022-05-27	6个月	新发流通受限	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301163	宏德股份	2022-04-11	6个月	新发流通受限	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301130	西点药业	2022-02-16	6个月	新发流通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6个月	新发流通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301109	军信股份	2022-04-06	6个月	新发流通受限	34.81	16.14	534	12,392.36	8,618.76	含 证 券 送 配

301237	和顺科技	2022-03-16	6个月	新发流通受限	56.69	41.86	205	11,621.45	8,581.30	-
301148	嘉戎技术	2022-04-14	6个月	新发流通受限	38.39	23.90	342	13,129.38	8,173.80	-
301181	标榜股份	2022-02-11	6个月	新发流通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301228	实朴检测	2022-01-21	6个月	新发流通受限	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301219	腾远钴业	2022-03-10	6个月	新发流通受限	173.98	87.82	79	7,655.12	6,937.78	含 证 券 送 配
301279	金道科技	2022-04-06	6个月	新发流通受限	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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(张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127064	杭	2022-05-19	6个月	新	100.00	100.02	397	39,700.00	39,707.48	期

	氧 转 债		内(含)	发 流 通 受 限						未 估 值 单 价 为 含 息 价 格
--	-------------	--	------	-----------------------	--	--	--	--	--	--

注：①本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。本基金所认购非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

⑤基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，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。

截至本期末，综合考虑利率债、信用债、同业存单、资产支持证券等资产占基金资产净值的比例，利率变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人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进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	147,984,749.63	86.65	532,118,680.90	80.81
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	39,707.48	0.02	31,933.20	0.00
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	148,024,457.11	86.67	532,150,614.10	80.82

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	-5%	-7,135,623.44	-26,926,274.80
	+5%	7,135,623.44	26,926,274.80

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	142,129,593.02
第二层次	-
第三层次	5,894,864.09
合计	148,024,457.11

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至2022年6月30日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，其账面价值与公允价值差异很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	147,984,749.63	86.19
	其中：股票	147,984,749.63	86.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	39,707.48	0.02
	其中：债券	39,707.48	0.02
	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	6,729,558.93	3.92
8	其他各项资产	16,949,146.43	9.87
9	合计	171,703,162.47	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,410,700.00	0.83
B	采矿业	5,251,360.04	3.07

C	制造业	93,584,260.09	54.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,675,377.00	2.74
E	建筑业	1,950,630.00	1.14
F	批发和零售业	1,006,093.00	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	3,376,274.00	1.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,800,294.80	7.49
J	金融业	19,441,824.80	11.38
K	房地产业	1,350,926.00	0.79
L	租赁和商务服务业	2,337,592.46	1.37
M	科学研究和技术服务业	7,586.82	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	28,838.58	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,990.24	0.01
R	文化、体育和娱乐业	605,583.80	0.35
S	综合	147,418.00	0.09
	合计	147,984,749.63	86.65

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,090	8,364,050.00	4.90
2	600941	中国移动	87,363	5,264,494.38	3.08
3	300750	宁德时代	6,800	3,631,200.00	2.13
4	002594	比亚迪	10,700	3,568,343.00	2.09
5	601398	工商银行	567,400	2,706,498.00	1.58
6	605118	力鼎光电	187,000	2,662,880.00	1.56
7	601012	隆基绿能	39,900	2,658,537.00	1.56
8	600900	长江电力	101,600	2,348,992.00	1.38
9	600028	中国石化	552,400	2,253,792.00	1.32
10	603613	国联股份	24,725	2,190,635.00	1.28
11	601288	农业银行	675,900	2,041,218.00	1.20
12	601319	中国人保	395,500	2,001,230.00	1.17
13	002841	视源股份	23,300	1,754,956.00	1.03
14	601881	中国银河	177,100	1,712,557.00	1.00
15	600438	通威股份	28,400	1,700,024.00	1.00
16	600380	健康元	135,800	1,677,130.00	0.98
17	002203	海亮股份	144,000	1,663,200.00	0.97
18	600036	招商银行	38,635	1,630,397.00	0.95
19	601658	邮储银行	289,900	1,562,561.00	0.91
20	300769	德方纳米	3,800	1,552,984.00	0.91

21	002430	杭氧股份	49,500	1,547,370.00	0.91
22	002815	崇达技术	120,053	1,537,878.93	0.90
23	600085	同仁堂	28,400	1,501,792.00	0.88
24	002294	信立泰	53,400	1,500,540.00	0.88
25	600486	扬农化工	10,900	1,452,752.00	0.85
26	300316	晶盛机电	20,800	1,405,872.00	0.82
27	600845	宝信软件	25,330	1,383,018.00	0.81
28	300979	华利集团	17,440	1,274,515.20	0.75
29	601857	中国石油	238,300	1,262,990.00	0.74
30	601816	京沪高铁	250,100	1,255,502.00	0.74
31	601939	建设银行	206,636	1,252,214.16	0.73
32	000568	泸州老窖	4,900	1,208,046.00	0.71
33	300957	贝泰妮	5,500	1,196,415.00	0.70
34	300462	华铭智能	124,000	1,194,120.00	0.70
35	300498	温氏股份	55,000	1,170,950.00	0.69
36	002368	太极股份	60,500	1,162,205.00	0.68
37	688981	中芯国际	25,400	1,147,318.00	0.67
38	600299	安迪苏	119,100	1,140,978.00	0.67
39	601318	中国平安	23,822	1,112,249.18	0.65
40	002920	德赛西威	7,300	1,080,400.00	0.63
41	000050	深天马 A	106,900	1,065,793.00	0.62
42	601985	中国核电	153,700	1,054,382.00	0.62
43	000333	美的集团	17,300	1,044,747.00	0.61
44	603038	华立股份	122,600	1,038,422.00	0.61
45	600970	中材国际	106,400	1,031,016.00	0.60
46	002736	国信证券	106,000	1,014,420.00	0.59
47	601869	长飞光纤	31,800	983,256.00	0.58
48	002821	凯莱英	3,300	953,700.00	0.56
49	603868	飞科电器	12,202	924,301.50	0.54
50	688625	呈和科技	20,800	907,712.00	0.53
51	601211	国泰君安	59,062	897,742.40	0.53
52	300014	亿纬锂能	9,200	897,000.00	0.53
53	603659	璞泰来	10,420	879,448.00	0.51
54	002004	华邦健康	157,400	878,292.00	0.51
55	000785	居然之家	196,800	875,760.00	0.51
56	600195	中牧股份	71,400	875,364.00	0.51
57	600018	上港集团	145,100	845,933.00	0.50
58	300124	汇川技术	12,700	836,549.00	0.49
59	600563	法拉电子	3,800	779,608.00	0.46
60	603605	珀莱雅	4,700	776,346.00	0.45
61	600094	大名城	208,900	766,663.00	0.45
62	600835	上海机电	55,500	762,015.00	0.45
63	603669	灵康药业	115,900	757,986.00	0.44

64	600167	联美控股	100,500	752,745.00	0.44
65	300363	博腾股份	9,200	717,508.00	0.42
66	003033	征和工业	26,500	710,200.00	0.42
67	300450	先导智能	10,995	694,664.10	0.41
68	002459	晶澳科技	8,780	692,742.00	0.41
69	600580	卧龙电驱	47,700	687,834.00	0.40
70	600050	中国联通	198,500	686,810.00	0.40
71	601992	金隅集团	240,300	665,631.00	0.39
72	002281	光迅科技	37,200	653,976.00	0.38
73	300618	寒锐钴业	11,200	648,704.00	0.38
74	603786	科博达	10,400	640,328.00	0.37
75	603501	韦尔股份	3,600	622,908.00	0.36
76	600718	东软集团	47,600	547,876.00	0.32
77	688065	凯赛生物	4,871	544,577.80	0.32
78	300514	友讯达	52,100	543,403.00	0.32
79	300760	迈瑞医疗	1,700	532,440.00	0.31
80	000729	燕京啤酒	54,900	530,334.00	0.31
81	600089	特变电工	19,000	520,410.00	0.30
82	300805	电声股份	65,400	519,930.00	0.30
83	000559	万向钱潮	87,400	519,156.00	0.30
84	603515	欧普照明	29,400	513,030.00	0.30
85	002410	广联达	9,400	511,736.00	0.30
86	300539	横河精密	55,800	511,128.00	0.30
87	603489	八方股份	2,600	505,674.00	0.30
88	603195	公牛集团	3,300	504,603.00	0.30
89	603444	吉比特	1,300	504,400.00	0.30
90	688819	天能股份	14,379	497,225.82	0.29
91	000878	云南铜业	43,600	496,604.00	0.29
92	001216	华瓷股份	38,200	490,870.00	0.29
93	600039	四川路桥	46,600	490,698.00	0.29
94	000970	中科三环	26,100	490,158.00	0.29
95	300628	亿联网络	6,400	487,360.00	0.29
96	600901	江苏租赁	91,000	466,830.00	0.27
97	600120	浙江东方	116,300	466,363.00	0.27
98	601838	成都银行	27,900	462,582.00	0.27
99	002032	苏泊尔	8,100	456,354.00	0.27
100	002372	伟星新材	18,900	454,356.00	0.27
101	600435	北方导航	52,400	451,688.00	0.26
102	601888	中国中免	1,900	442,567.00	0.26
103	002120	韵达股份	25,800	440,148.00	0.26
104	002371	北方华创	1,546	428,427.52	0.25
105	000598	兴蓉环境	82,500	421,575.00	0.25
106	601668	中国建筑	79,000	420,280.00	0.25

107	600348	华阳股份	26,700	412,782.00	0.24
108	000060	中金岭南	91,800	409,428.00	0.24
109	600765	中航重机	12,660	407,398.80	0.24
110	002010	传化智联	63,100	405,733.00	0.24
111	300999	金龙鱼	7,500	405,150.00	0.24
112	603719	良品铺子	14,100	403,683.00	0.24
113	603879	永悦科技	58,556	400,523.04	0.23
114	002948	青岛银行	110,600	400,372.00	0.23
115	600456	宝钛股份	5,700	338,580.00	0.20
116	600851	海欣股份	48,500	338,530.00	0.20
117	603950	长源东谷	23,200	330,600.00	0.19
118	002745	木林森	33,500	327,295.00	0.19
119	000709	河钢股份	144,754	327,144.04	0.19
120	601098	中南传媒	33,600	317,184.00	0.19
121	000686	东北证券	44,694	312,411.06	0.18
122	002088	鲁阳节能	14,700	309,435.00	0.18
123	605499	东鹏饮料	1,800	307,548.00	0.18
124	300699	光威复材	5,200	306,124.00	0.18
125	300009	安科生物	29,700	300,267.00	0.18
126	688100	威胜信息	14,100	295,959.00	0.17
127	001965	招商公路	38,200	291,466.00	0.17
128	601328	交通银行	58,500	291,330.00	0.17
129	002733	雄韬股份	16,600	289,006.00	0.17
130	603499	翔港科技	36,800	288,512.00	0.17
131	688585	上纬新材	29,600	285,936.00	0.17
132	002128	电投能源	19,900	284,968.00	0.17
133	002465	海格通信	30,400	276,336.00	0.16
134	688093	世华科技	14,100	272,412.00	0.16
135	603638	艾迪精密	13,100	268,550.00	0.16
136	603899	晨光股份	4,700	263,576.00	0.15
137	002500	山西证券	45,900	263,466.00	0.15
138	601928	凤凰传媒	35,372	252,909.80	0.15
139	300689	澄天伟业	14,560	252,033.60	0.15
140	600130	波导股份	65,300	250,099.00	0.15
141	603379	三美股份	11,200	249,200.00	0.15
142	000717	韶钢松山	69,900	244,650.00	0.14
143	300151	昌红科技	12,700	240,030.00	0.14
144	002299	圣农发展	12,500	239,750.00	0.14
145	002460	赣锋锂业	1,600	237,920.00	0.14
146	600985	淮北矿业	16,300	237,328.00	0.14
147	601677	明泰铝业	9,600	228,480.00	0.13
148	601138	工业富联	23,200	228,288.00	0.13
149	300661	圣邦股份	1,200	218,424.00	0.13

150	002249	大洋电机	34,200	209,988.00	0.12
151	000028	国药一致	7,000	208,530.00	0.12
152	603979	金诚信	10,784	208,239.04	0.12
153	605088	冠盛股份	15,400	207,592.00	0.12
154	000963	华东医药	4,500	203,220.00	0.12
155	300030	阳普医疗	27,200	198,016.00	0.12
156	600967	内蒙一机	21,300	194,256.00	0.11
157	300713	英可瑞	12,100	185,130.00	0.11
158	002926	华西证券	23,300	182,672.00	0.11
159	002756	永兴材料	1,200	182,652.00	0.11
160	300896	爱美客	300	180,003.00	0.11
161	002690	美亚光电	8,300	179,944.00	0.11
162	601628	中国人寿	5,700	177,156.00	0.10
163	600219	南山铝业	47,900	176,751.00	0.10
164	600029	南方航空	23,900	174,709.00	0.10
165	688526	科前生物	6,700	174,133.00	0.10
166	002857	三晖电气	10,900	173,528.00	0.10
167	000062	深圳华强	13,600	172,720.00	0.10
168	603392	万泰生物	1,110	172,383.00	0.10
169	600329	达仁堂	6,900	169,602.00	0.10
170	688331	荣昌生物	3,841	164,932.54	0.10
171	002653	海思科	10,200	164,322.00	0.10
172	600339	中油工程	55,400	160,106.00	0.09
173	002701	奥瑞金	30,500	158,600.00	0.09
174	002301	齐心集团	23,600	155,760.00	0.09
175	600188	兖矿能源	3,800	150,024.00	0.09
176	605318	法狮龙	10,200	148,410.00	0.09
177	688295	中复神鹰	4,300	148,006.00	0.09
178	002191	劲嘉股份	13,800	147,936.00	0.09
179	603589	口子窖	2,500	146,525.00	0.09
180	601958	金铂股份	16,500	145,860.00	0.09
181	000009	中国宝安	10,800	145,692.00	0.09
182	688096	京源环保	10,700	145,092.00	0.08
183	600623	华谊集团	17,200	142,760.00	0.08
184	002244	滨江集团	16,400	141,860.00	0.08
185	601825	沪农商行	22,500	141,075.00	0.08
186	000631	顺发恒业	37,200	139,872.00	0.08
187	300211	亿通科技	16,100	138,621.00	0.08
188	600663	陆家嘴	12,800	132,608.00	0.08
189	002212	天融信	12,800	129,920.00	0.08
190	300424	航新科技	11,300	127,464.00	0.07
191	300296	利亚德	17,400	127,020.00	0.07
192	600064	南京高科	11,000	121,000.00	0.07

193	600728	佳都科技	18,300	118,218.00	0.07
194	603677	奇精机械	9,500	117,895.00	0.07
195	000153	丰原药业	13,700	114,532.00	0.07
196	000733	振华科技	800	108,776.00	0.06
197	600282	南钢股份	34,500	108,675.00	0.06
198	002615	哈尔斯	17,400	108,228.00	0.06
199	601518	吉林高速	40,400	107,868.00	0.06
200	600837	海通证券	10,400	102,024.00	0.06
201	002563	森马服饰	17,000	100,640.00	0.06
202	002399	海普瑞	5,700	100,206.00	0.06
203	300405	科隆股份	17,140	100,097.60	0.06
204	601688	华泰证券	7,000	99,400.00	0.06
205	600690	海尔智家	3,500	96,110.00	0.06
206	300522	世名科技	7,900	95,116.00	0.06
207	603787	新日股份	6,300	93,492.00	0.05
208	603806	福斯特	1,400	91,728.00	0.05
209	300694	蠡湖股份	8,400	91,308.00	0.05
210	600867	通化东宝	8,800	90,992.00	0.05
211	688109	品茗股份	2,900	89,610.00	0.05
212	601128	常熟银行	11,400	87,096.00	0.05
213	601088	中国神华	2,600	86,580.00	0.05
214	603790	雅运股份	7,900	83,977.00	0.05
215	688099	晶晨股份	809	81,709.00	0.05
216	603682	锦和商管	14,000	80,220.00	0.05
217	601000	唐山港	30,800	79,464.00	0.05
218	601717	郑煤机	5,500	79,255.00	0.05
219	600585	海螺水泥	2,200	77,616.00	0.05
220	002831	裕同科技	2,600	76,830.00	0.04
221	600398	海澜之家	16,000	76,000.00	0.04
222	600917	重庆燃气	10,200	73,644.00	0.04
223	002631	德尔未来	10,600	68,370.00	0.04
224	603355	莱克电气	2,700	68,121.00	0.04
225	600737	中粮糖业	8,500	63,920.00	0.04
226	600520	文一科技	7,100	62,338.00	0.04
227	601298	青岛港	11,300	61,811.00	0.04
228	002396	星网锐捷	2,700	61,128.00	0.04
229	002468	申通快递	5,000	59,600.00	0.03
230	003036	泰坦股份	5,300	56,763.00	0.03
231	688396	华润微	900	53,163.00	0.03
232	600152	维科技术	8,700	53,157.00	0.03
233	300529	健帆生物	1,000	50,890.00	0.03
234	000401	冀东水泥	4,600	48,392.00	0.03
235	603586	金麒麟	3,500	45,220.00	0.03

236	300419	浩丰科技	8,100	44,064.00	0.03
237	603956	威派格	4,000	43,400.00	0.03
238	600256	广汇能源	4,000	42,160.00	0.02
239	600377	宁沪高速	4,900	41,993.00	0.02
240	600376	首开股份	8,500	41,735.00	0.02
241	300136	信维通信	2,300	38,755.00	0.02
242	601369	陕鼓动力	4,000	38,400.00	0.02
243	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.02
244	600482	中国动力	2,300	36,133.00	0.02
245	603650	彤程新材	1,100	35,838.00	0.02
246	600436	片仔癀	100	35,673.00	0.02
247	002739	万达电影	2,600	35,490.00	0.02
248	000728	国元证券	5,700	35,454.00	0.02
249	601766	中国中车	6,700	34,840.00	0.02
250	605099	共创草坪	1,300	34,567.00	0.02
251	601568	北元集团	5,300	33,602.00	0.02
252	600132	重庆啤酒	200	29,320.00	0.02
253	002557	洽洽食品	500	28,465.00	0.02
254	300378	鼎捷软件	1,700	27,999.00	0.02
255	000988	华工科技	1,200	27,804.00	0.02
256	600795	国电电力	5,900	23,069.00	0.01
257	600768	宁波富邦	2,400	22,032.00	0.01
258	301200	大族数控	417	21,650.64	0.01
259	600060	海信视像	1,714	21,425.00	0.01
260	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.01
261	000581	威孚高科	1,000	19,250.00	0.01
262	301206	三元生物	421	19,235.49	0.01
263	000960	锡业股份	1,100	18,447.00	0.01
264	300789	唐源电气	900	18,153.00	0.01
265	002014	永新股份	2,700	18,063.00	0.01
266	601608	中信重工	4,300	16,297.00	0.01
267	301123	奕东电子	615	15,614.85	0.01
268	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.01
269	002048	宁波华翔	901	14,434.02	0.01
270	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.01
271	301298	东利机械	634	13,206.22	0.01
272	600875	东方电气	800	13,160.00	0.01
273	600232	金鹰股份	2,300	13,110.00	0.01
274	301236	软通动力	405	12,708.90	0.01
275	002423	中粮资本	1,800	12,078.00	0.01
276	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.01
277	301097	天益医疗	239	11,431.37	0.01
278	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01

279	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.01
280	301248	杰创智能	372	11,111.64	0.01
281	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.01
282	301103	何氏眼科	312	9,990.24	0.01
283	301150	中一科技	120	9,931.20	0.01
284	600717	天津港	2,400	9,624.00	0.01
285	301302	华如科技	164	9,252.88	0.01
286	301102	兆讯传媒	294	9,140.46	0.01
287	600582	天地科技	1,900	9,082.00	0.01
288	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.01
289	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.01
290	301130	西点药业	237	8,934.90	0.01
291	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.01
292	600176	中国巨石	500	8,705.00	0.01
293	002081	金螳螂	1,700	8,636.00	0.01
294	301109	军信股份	534	8,618.76	0.01
295	301237	和顺科技	205	8,581.30	0.01
296	603708	家家悦	600	8,544.00	0.01
297	002416	爱施德	900	8,370.00	0.00
298	301148	嘉戎技术	342	8,173.80	0.00
299	600233	圆通速递	400	8,156.00	0.00
300	601577	长沙银行	1,000	7,930.00	0.00
301	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
302	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
303	001914	招商积余	400	7,188.00	0.00
304	600362	江西铜业	400	7,132.00	0.00
305	301219	腾远钴业	79	6,937.78	0.00
306	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
307	601899	紫金矿业	700	6,531.00	0.00
308	688698	伟创电气	300	6,105.00	0.00
309	603958	哈森股份	900	5,508.00	0.00
310	600566	济川药业	200	5,432.00	0.00
311	000409	云鼎科技	1,000	5,430.00	0.00
312	603898	好莱客	500	5,160.00	0.00
313	002867	周大生	300	4,659.00	0.00
314	601828	美凯龙	700	4,242.00	0.00
315	603380	易德龙	100	3,890.00	0.00
316	300620	光库科技	100	3,319.00	0.00
317	000597	东北制药	600	3,300.00	0.00
318	002138	顺络电子	100	2,725.00	0.00
319	000811	冰轮环境	200	2,086.00	0.00
320	603676	卫信康	200	2,016.00	0.00
321	300196	长海股份	100	1,889.00	0.00

322	300341	麦克奥迪	200	1,818.00	0.00
323	000551	创元科技	200	1,726.00	0.00
324	300107	建新股份	300	1,593.00	0.00
325	300218	安利股份	100	1,427.00	0.00
326	601377	兴业证券	200	1,410.00	0.00
327	002214	大立科技	100	1,272.00	0.00
328	300466	赛摩智能	200	1,096.00	0.00
329	000750	国海证券	300	1,089.00	0.00
330	600796	钱江生化	200	1,084.00	0.00
331	603238	诺邦股份	100	1,060.00	0.00
332	600704	物产中大	200	1,026.00	0.00
333	300335	迪森股份	200	970.00	0.00
334	300168	万达信息	100	944.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	19,042,029.00	2.89
2	000333	美的集团	16,082,309.00	2.44
3	300014	亿纬锂能	10,097,026.00	1.53
4	000776	广发证券	10,021,076.00	1.52
5	002709	天赐材料	9,285,964.00	1.41
6	002050	三花智控	8,770,727.00	1.33
7	600919	江苏银行	8,175,996.96	1.24
8	603868	飞科电器	8,025,135.01	1.22
9	601633	长城汽车	7,294,714.00	1.11
10	002371	北方华创	7,107,381.00	1.08
11	300474	景嘉微	6,835,875.00	1.04
12	601668	中国建筑	6,738,337.00	1.02
13	002790	瑞尔特	6,595,119.00	1.00
14	603568	伟明环保	6,473,362.44	0.98
15	000519	中兵红箭	6,156,605.00	0.93
16	600011	华能国际	5,975,412.00	0.91
17	300751	迈为股份	5,849,617.00	0.89
18	003013	地铁设计	5,828,559.68	0.89
19	002014	永新股份	5,799,077.15	0.88
20	600803	新奥股份	5,780,595.00	0.88

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	20,203,046.00	3.07
2	600036	招商银行	14,901,215.00	2.26
3	601668	中国建筑	14,787,741.91	2.25
4	300059	东方财富	14,727,766.28	2.24
5	000333	美的集团	14,511,241.00	2.20
6	300750	宁德时代	14,315,819.96	2.17
7	300014	亿纬锂能	14,045,533.00	2.13
8	002129	TCL 中环	13,605,513.12	2.07
9	601328	交通银行	13,486,234.00	2.05
10	603260	合盛硅业	13,086,922.00	1.99
11	601857	中国石油	12,044,292.00	1.83
12	601658	邮储银行	11,528,498.00	1.75
13	002594	比亚迪	11,109,489.00	1.69
14	000568	泸州老窖	10,725,114.00	1.63
15	002371	北方华创	10,402,316.00	1.58
16	600887	伊利股份	10,155,772.00	1.54
17	603259	药明康德	10,037,744.76	1.52
18	000776	广发证券	9,460,973.00	1.44
19	600900	长江电力	9,202,583.00	1.40
20	002466	天齐锂业	8,944,297.34	1.36

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	857,155,659.19
卖出股票收入（成交）总额	1,192,575,220.92

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
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）	39,707.48	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,707.48	0.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127064	杭氧转债	397	39,707.48	0.02
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

（1）股指期货对冲策略

本基金参与股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。

（2）股指期货套利策略

股指期货套利策略是指积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系，进行套利，以获取绝对收益。股指期货套利包括以下两种方式：

①期现套利：期现套利过程中，由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动，套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

②跨期套利：跨期套利过程中，不同期货合约之间的价差不断变动，套利交易通过捕捉合约间价差进而获利。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 147,984,749.63 元，占基金资产净值的比例为 86.65%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-133,629,240.00 元，占基金资产净值的比例为-78.24%，空头合约市值占股票资产的比例为-90.30%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为-12,015,827.11 元，公允价值变动损益为 6,218,336.00 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.13.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	16,930,739.55
2	应收清算款	18,406.88
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,949,146.43

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600941	中国移动	5,264,494.38	3.08	新发流通受限

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
1,605	100,430.51	105,957,271.30	65.73%	55,233,700.66	34.27%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	671,601.09	0.42%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,900.09	6.20%	10,000,000.00	6.20%	不少于三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,900.09	6.20%	10,000,000.00	6.20%	不少于三年

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年6月5日）基金份额总额	1,154,005,597.33
本报告期期初基金份额总额	621,101,684.93
本报告期基金总申购份额	676,237.78
减：本报告期基金总赎回份额	460,586,950.75
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	161,190,971.96

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，桂勇先生担任华夏基金管理有限公司首席信息官，李一梅女士不再兼任。华夏基金管理有限公司已根据法律法规的规定完成财务负责人孙立强先生的有关备案工作。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

			交总额的 比例		量的比 例	
中信证券	22	724,737,741.45	35.52%	312,583.08	35.52%	-
海通证券	5	504,947,298.99	24.75%	217,783.24	24.75%	-
方正证券	4	217,681,078.27	10.67%	93,886.04	10.67%	-
华泰证券	3	216,351,953.65	10.60%	93,320.67	10.60%	-
国盛证券	2	169,786,472.88	8.32%	73,227.76	8.32%	-
长江证券	2	148,626,496.12	7.28%	64,103.36	7.28%	-
招商证券	4	39,814,633.21	1.95%	17,172.42	1.95%	-
银河证券	7	18,367,739.48	0.90%	7,921.16	0.90%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv有较强的全方位金融服务能力和水平：能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了东北证券、东方财富证券、东方证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、广发证券、国金证券、国泰君安证券、国信证券、华安证券、华西证券、金通证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、申万宏源证券、太平洋证券、万和证券、五矿证券、西部证券、西南证券、信达证券、兴业证券、野村东方国际、野村东方国际证券、中国银河证券、中金公司、中信建投证券、中信建投证券证券、中信证券(浙江)、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，华泰证券的部分交易单元、粤开证券的交易单元为本基金本期剔除的交易单元，本期没有新增的券商交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商 名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期 债券成	成交金额	占当期 债券回	成交金额	占当期 权证成	成交金额	占当期 基金成

		交总额的 比例		购成交 总额的 比例		交总额的 比例		交总额的 比例
中信 证券	-	-	106,800,000.00	26.14%	-	-	-	-
海通 证券	26,209.40	66.36%	56,400,000.00	13.80%	-	-	-	-
方正 证券	-	-	124,600,000.00	30.49%	-	-	-	-
华泰 证券	1,308.10	3.31%	80,600,000.00	19.73%	-	-	-	-
国盛 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	11,977.20	30.33%	40,200,000.00	9.84%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-21
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-12
3	华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-15
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-17
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-19
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-23
7	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-12
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-19
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-02
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-08
11	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关	中国证监会指定报刊及	2022-04-13

	关联方承销证券的公告	网站	
12	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-19
13	华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-17
14	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-18
15	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-24
16	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-25

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022-02-21至2022-05-22	88,285,415.88	-	88,285,415.88	-	-
	2	2022-05-23至2022-06-30	46,545,336.06	-	-	46,545,336.06	28.88%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；

- 3、《华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日