

海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金
2019 年年度报告
2019 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年四月十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 9 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 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
§6 审计报告	19
6.1 审计意见.....	19
6.2 形成审计意见的基础.....	20
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	20
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	20
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	53
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.....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64

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	65
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	65
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	65
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	65
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	65
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12	投资组合报告附注	66
§9	基金份额持有人信息	67
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
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	68
§10	开放式基金份额变动	68
§11	重大事件揭示	69
11.1	基金份额持有人大会决议	69
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	69
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
11.4	基金投资策略的改变	69
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	69
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	69
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8	其他重大事件	71
12	影响投资者决策的其他重要信息	73
§13	备查文件目录	74
13.1	备查文件目录	74
13.2	存放地点	75
13.3	查阅方式	75

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	海富通量化多因子混合	
基金主代码	005080	
交易代码	005080	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 4 月 23 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	219,701,897.47 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通量化多因子混合 A	海富通量化多因子混合 C
下属分级基金的交易代码	005081	005080
报告期末下属分级基金的份 额总额	42,137,469.40 份	177,564,428.07 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化多因子模型动态捕捉市场特征，精选优良个股进行投资，并结合量化择时模型进行仓位调整，力争控制回撤并获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	本基金在进行资产配置决策时，将依据量化择时模型，对宏观经济、政策预期、市场情绪、投资者行为等指标进行监控，精确把握市场方向、灵活调整组合仓位。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 ×60% + 上证国债指数收益率 ×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险及预期收益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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	奚万荣	郭明
	联系电话	021-38650891	010-66105799
	电子邮箱	wrx@hftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95588
传真		021-33830166	010-66105798
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴花园 石桥路66号东亚银行金融大 厦36-37层	北京市西城区复兴门内大街 55号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴花园 石桥路66 号东亚银行金融大 厦36-37层	北京市西城区复兴门内大街 55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		杨仓兵	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网 网址	http://www.hftfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道 中心 11 楼
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	2019 年		2018 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日	
	海富通量化多因子混合 A	海富通量化多因子混合 C	海富通量化多因子混合 A	海富通量化多因子混合 C
本期已实现收益	2,643,070.45	7,540,913.91	-1,332,242.25	-783,416.52
本期利润	8,785,123.35	24,370,486.28	-2,524,318.45	-837,577.99
加权平均基金份额本期利润	0.4071	0.2858	-0.1497	-0.0167
本期加权平均净值利润率	38.19%	26.08%	-16.10%	-2.17%
本期基金份额净值增长率	42.64%	43.04%	-18.03%	-17.35%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末		2018 年末	
	海富通量化多因子混合 A	海富通量化多因子混合 C	海富通量化多因子混合 A	海富通量化多因子混合 C
期末可供分配利润	2,963,001.23	14,489,618.00	-2,397,312.83	-2,733,891.59
期末可供分配基金份额利润	0.0703	0.0816	-0.1803	-0.1735
期末基金资产净值	49,266,849.87	209,911,804.88	10,901,620.05	13,025,906.59
期末基金份额净值	1.1692	1.1822	0.8197	0.8265
3.1.3 累计期末指标	2019 年末		2018 年末	
	海富通量化多因子混合 A	海富通量化多因子混合 C	海富通量化多因子混合 A	海富通量化多因子混合 C
基金份额累计净值增长率	16.92%	18.22%	-18.03%	-17.35%

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、本基金合同生效日为 2018 年 4 月 23 日,合同生效当年期间的数据和指标按实际存

续期计算。

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. 海富通量化多因子混合 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	9.28%	0.68%	4.84%	0.45%	4.44%	0.23%
过去六个月	10.87%	0.78%	5.20%	0.51%	5.67%	0.27%
过去一年	42.64%	1.11%	22.90%	0.75%	19.74%	0.36%
自基金合同生效起至今	16.92%	1.09%	7.34%	0.79%	9.58%	0.30%

2. 海富通量化多因子混合 C:

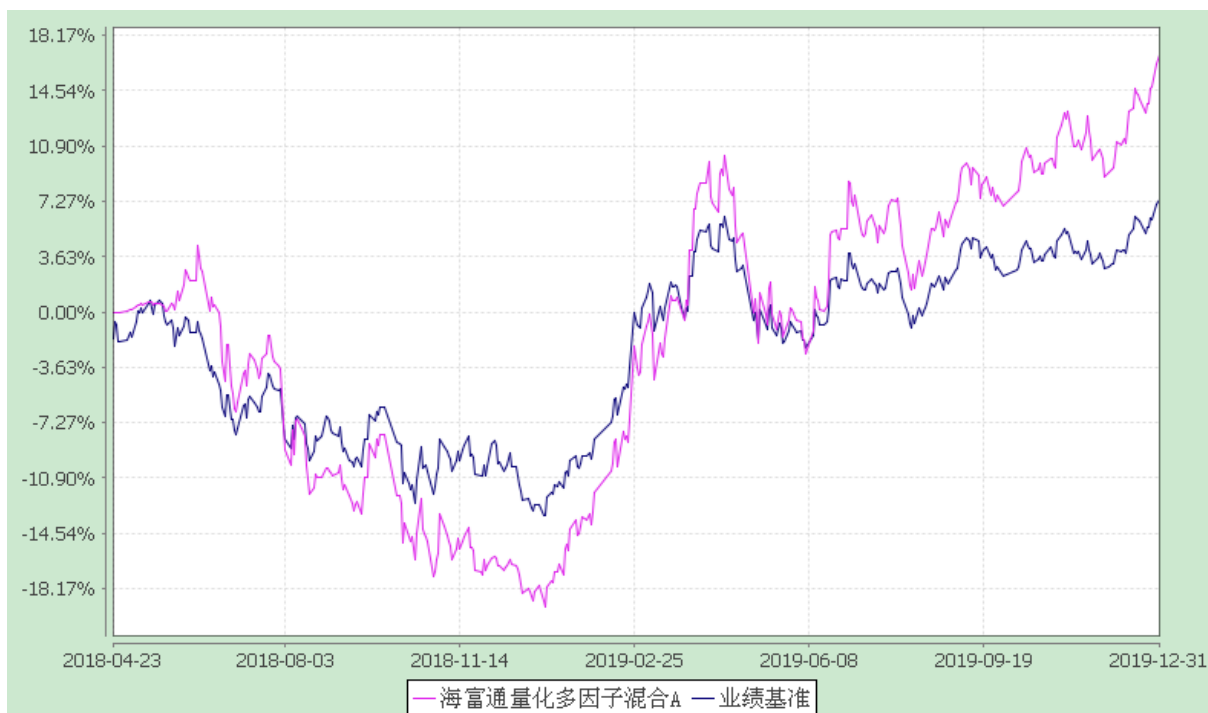
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.06%	0.68%	4.84%	0.45%	4.22%	0.23%
过去六个月	10.42%	0.78%	5.20%	0.51%	5.22%	0.27%
过去一年	43.04%	1.12%	22.90%	0.75%	20.14%	0.37%
自基金合同生效起至今	18.22%	1.10%	7.33%	0.79%	10.89%	0.31%

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

海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

1. 海富通量化多因子混合 A

(2018 年 4 月 23 日至 2019 年 12 月 31 日)



2. 海富通量化多因子混合 C

(2018 年 4 月 23 日至 2019 年 12 月 31 日)

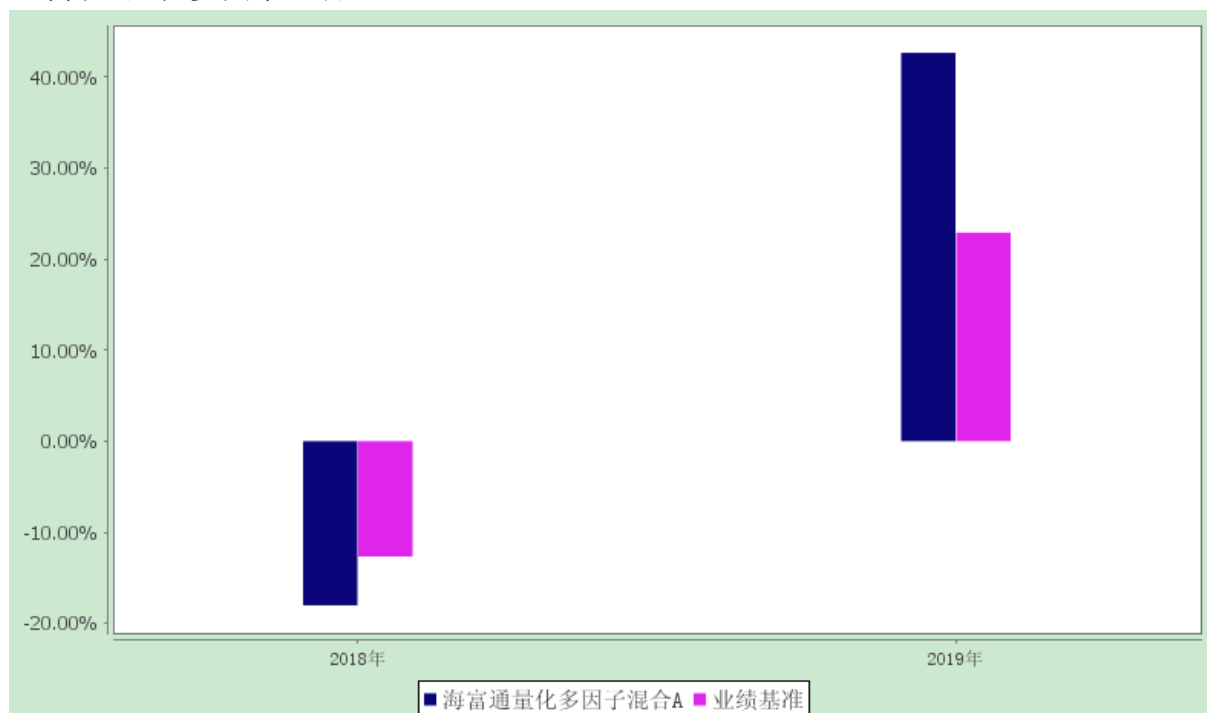


注：本基金合同于 2018 年 4 月 23 日生效，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

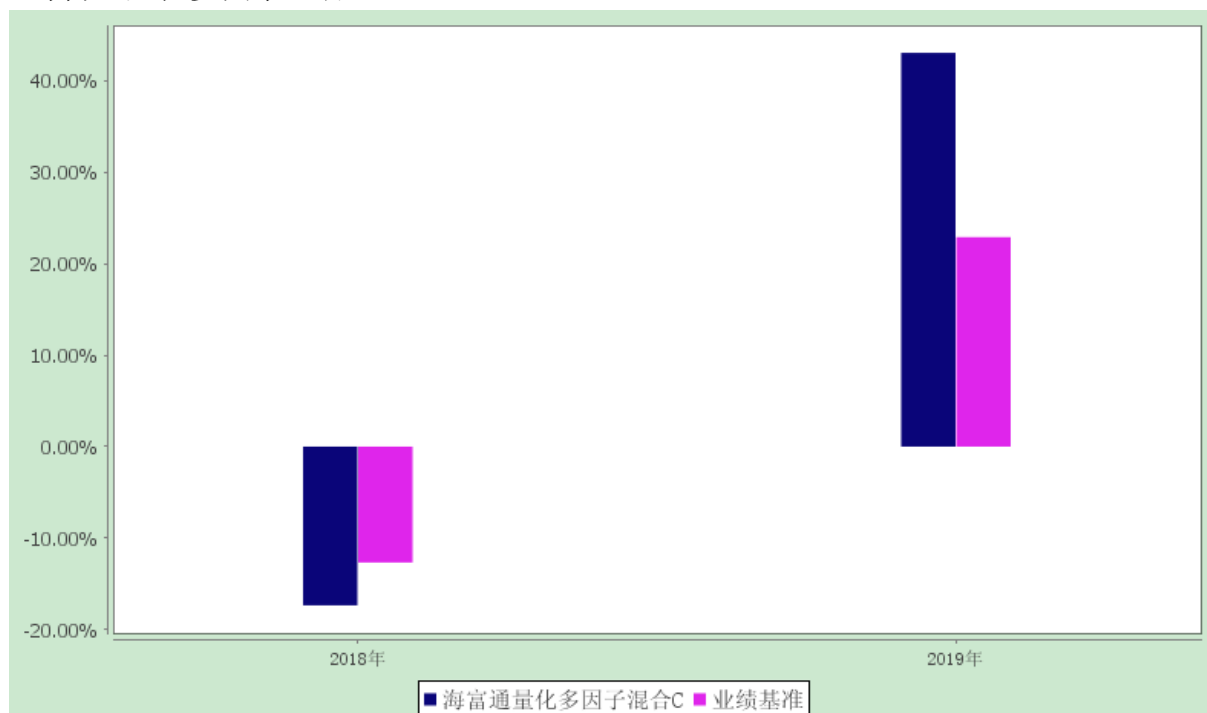
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金
自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

1. 海富通量化多因子混合 A



2. 海富通量化多因子混合 C



注：图中列示的 2018 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 4 月 23 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、海富通量化多因子混合 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
2019	-	-	-	-	-
2018	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

2、海富通量化多因子混合 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
2019	-	-	-	-	-
2018	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金合同于 2018 年 4 月 23 日生效，2018 年及 2019 年均未实施利润分配。

§ 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 2019 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 66 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、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、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、海富通可转债优选债券型证券投资基金、海富通季季增利理财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、海富通富祥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、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、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、海富通季季通利理财债券型证券投资基金、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、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、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。

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		
杜晓海	本基金的基金	2018-04-23	2019-10-15	19 年	硕士, 持有基金从业人员资格证书。历任

	<p>经理；海富通阿尔法对冲混合基金经理；海富通安颐收益混合基金经理；海富通创业板增强基金经理；海富通量化先锋股票基金经理；海富通稳固收益债券基金经理；海富通欣荣混合基金经理；海富通欣享混合基金经理；海富通新内需混合基金经理；海富通研究精选混合基金经理；量化投资部总监。</p>				<p>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量化投资部总监。2016 年 6 月起任海富通新内需混合和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 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 月兼任海富通沪深 300 增强（原海富通富睿混合）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、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 月起兼任海富通研究精选混合基金经理。</p>
朱斌全	<p>本基金的基金经理；海富通阿</p>	2019-10-15	-	12 年	<p>硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2006 年 8 月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交</p>

	尔法对冲混合基金经理；海富通富祥混合基金经理；海富通沪深 300 增强基金经理；海富通欣益混合基金经理。				易员。2007 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，历任交易员、高级交易员、量化分析师、投资经理、基金经理助理。2018 年 11 月起任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通富祥混合、海富通沪深 300 增强（原海富通富睿混合）、海富通量化多因子混合及海富通欣益混合的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

公司根据证监会 2011 年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》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。制度和流程覆盖了境内、境外上市股票、债券、基金的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，涵盖了授权、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。

公司建立了严格的投资交易行为监控制度，公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部门、督察稽核部和风险管理部组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控，保证本报告期内公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

交易制度的执行和实现。

报告期内，对公司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（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2019 年，A 股市场大幅上扬，所有指数均有较大幅度上涨。2019 年指数中表现最好的是深证成指、创业板指，全年分别上涨 44.08%、43.79%。而表现最弱的则是上证综指、中证 500，全年分别上涨 22.30%、26.38%。沪深 300、上证 50、中证 800 分别上涨 36.07%、33.58%、33.71%。

回顾全年走势，自从 1 月 4 日上证综指盘中触及近三年新低 2440.91 点之后，市场便开始温和反弹，整个一季度市场都处于快速反弹过程中。板块结构上，1 月份家电、食品饮料、保险、银行等价值权重板块率先企稳反弹，2 月份则转向以电子、通信、计算机为代表的成长股，3 月份经济数据回暖后相关的地产产业链和周期品也有一定的表现。进入二季度，由于贸易谈判陷入僵局，宏观调控政策也略有调整，指数出现回调；6 月份，中美重启贸易谈判的预期升温，市场逐步筑底回升，风险偏好开始回暖。

下半年总体分化加剧，以电子为代表的成长股表现持续突出，创业板指涨幅接近 19%，而上证综指只小幅上涨 2.39%；多只科技股中报业绩超预期使得科技成长的强势一直持续到年底，而消费价值类股票相对较弱，仅阶段性有所表现。8 月份由于中美贸易战短期升级，市场出现快速下跌，但随后迅速企稳并反弹，成长股、价值股同时表现，周期表现最差。9、10 月份市场领涨的依然是科技成长股，但同时以银行、地产为代表的低估值蓝筹和以家电、医药和食品饮料为代表的消费白马因三季报业绩稳健而有所表现，强周期的周期品表现落后。11 月份以电子、新能源、传媒为代表的科技成长个股领涨大盘，建材、汽车、有色、钢铁等周期股受益经济企稳预期也有突出表现，而泛消费领域的食品饮料、医药等个股出现滞涨甚至下跌。12 月份市场以大幅上涨收尾，经济企稳迹象不断验证、中美贸易谈判阶段性达成一致、国内货币政策持续推动融资成本稳步下行，这些均推动市场的经济预期和风险偏好不断修复，受益于经济预期改善和资金利率下行的建材、地产、有色、化工、汽车等表现突出，受益于风险偏好提升的传媒、电子、通信、计算机、券商等也表现较好。

全年看，在中信证券 29 个一级行业分类中，食品饮料（+72.84%）、电子元器件（+72.23%）、家电（+60.55%）、建材（+52.99%）、农林牧渔（+48.16%）涨幅最大。建筑（+0.28%）、钢铁（+2.82%）、电力及公用事业（+8.44%）、商贸零售（+8.72%）和石油石化（+8.85%）涨幅靠后。

本报告期，基金积极投资股票市场，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，海富通量化多因子混合 A 净值增长率为 42.64%，同期业绩比较基准收益率为 22.90%，基金净值跑赢业绩比较基准 19.74 个百分点。海富通量化多因子混合 C 净值增长率为 43.04%，同期业绩比较基准收益率为 22.90%，基金净值跑赢业绩比较基准 20.14 个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年全年，由于受到新型冠状病毒的影响，中国经济在一季度会受到冲击。但我们预计这属于一次性的非经常损益，不会影响中国经济增长的长期趋势。此外，为了对冲本次事件的影响，预计政府会出台更加积极的财政、货币政策，减少本次事件的损失。在疫情发生之前，我们预计 2020 年中国经济增长有望企稳，主要逻辑是：海外量宽持续，贸易争端缓和，有利于出口的缓慢恢复；基建有望部分对冲房地产投资的下滑，而 2019 年受汽车销量下滑拖累的消费在 2020 年有望见底回升。疫情发生后，我们认为对消费形势的判断需要下修，基建的抬升力度估计会更大一些。因此，我们对后续中国经济并不悲观，增长的绝对速度虽有所下移，但增长质量逐步提高，受益于工程师红利、进一步改革开放，我们在高端先进制造、生物医药技术、云业务等方面都已经或逐步具备国际竞争力。

宏观政策方面，预计“托底式”稳增长将被放在更重要的位置，确保经济运行在合理区间。积极的财政政策，预计将提升财政赤字率，适当增加广义赤字，新增地方政府专项债。稳健的货币政策，预计将更加灵活适度，保持货币信贷、社会融资规模增长同经济发展相适应。降低社会融资成本，MLF 利率仍将下调，并引导 LPR 利率下调，进一步降低企业融资成本，同时显著加大对受疫情影响较大的重点地区和重点行业的税费减免和补贴。宏观层面，为应对疫情给整体经济增速带来的负面影响，或需增加基建、地产投资等内需来弥补。

2019 年市场有较大涨幅，消费价值和科技成长均有良好表现。2020 年全年，我们预计市场会更多呈现结构性机会，指数整体表现不温不火。我们相对更看好受疫情影响较小的科技成长板块，如消费电子、半导体、5G 应用相关的游戏、短视频与高清视频；看好特斯拉带动下的全球新能源汽车渗透率加速提升。泛消费的大部分板块受到疫情影响，2020 年业绩会面临下调，因此预计 2020 年上半年难有突出表现，但优质消费价值龙头可能有超跌后的估值修复机会和长期持有机会。

本基金的投资思路将在控制风险的基础上，积极地捕捉市场的结构性机会，力争跑赢市场。本基金也将利用动态的仓位调整或者股指期货套保等风险管理工具来控制回撤风险。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2019 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、现场检查、系统监控、人员访谈、重点抽查等一系列方式开展工作，强化对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送监管机关、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、持续完善公司的规章制度，健全内部控制体系，落实内控责任。

督察稽核部围绕着法律法规和监管政策的发展和变化，自上而下地推动了内部控制机制的梳理和完善工作，组织各部门对多项内部制度和流程进行了更新，健全了公司内部控制制度体系，强化了各项内控职责，为公司各项业务合规开展提供有效的制度保障，为基金持有人利益最大化提供有力的保障。

二、加强对公司和基金日常运作的合规管理。

本报告期内，督察稽核部坚持以法律法规和公司管理制度为依据，对公司和基金日常运作的各项业务实施事前、事中、事后的合规性审核，对新产品和新业务进行合规性审核，确保了基金运作的诚信和合法合规性。此外，督察稽核部根据法规、监管要求并结合公司内部控制的需要，对公司各部门的业务有重点的开展了十多项专项检查和内部审计，对检查中发现的问题向公司经营管理层汇报，并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，加强并完善公司的内部控制状况。通过事前、事中、事后的全方位合规审核及内部审计，公司对治理结构、投资交易、销售及客户服务体系、信息安全控制、基金运营控制、分支机构管理及人力资源管理等方面的内部规章制度和各项业务流程予以了完善；同时强化了现有规章制度的执行力度，并很好的落实了相关建议。

三、有效推进反洗钱工作。

本报告期内，督察稽核部结合反洗钱法规及公司业务特点，根据新法规要求完善反洗钱制度及流程，组织多场反洗钱专项培训和考试，组织相关业务部门提请投资者及时提供或更新身份信息，对于直销投资者身份信息资料不完整、不准确、未在合理期限内补充完善的予以限制交易，持续加强对非自然人客户受益人信息的收集和识别，并牵头对反洗钱系统进行升级改造，强化对大额交易和可疑交易方面的监控。同时还按照法规规定，定期登陆反洗钱系统，对系统筛选的可疑交易进行人工识别和复核，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 2018 年度的反洗钱分类评级自评估工作，并聘请外部审计师事务所开展了机构洗钱风险评估。

四、加强投资者教育，培养投资者风险意识和投资理念。

本报告期内，督察稽核部会同相关部门鼓励投资者进行长期投资，持续不断的和投资者进行沟通，利用网络互动平台、主流媒体专栏及举办投资者交流会等多种渠道、多种媒介积极推进投资者教育工作，努力倡导“长期持有、理性投资”的投资理念，培养广大投资者的风险意识、切实加强保护了广大基金持有人的合法权益。

五、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，为加强公司合规文化建设，督察稽核部及时将新颁布的各项法律法规进行解读和落实，并组织全体员工开展各类内外部培训，剖析风险案例，培训内容主要包括新法规政策落实、监管精神传达、投资交易、市场销售业务、信息技术管理、廉洁从业管理、宣传推介合规管理、老鼠仓及内幕交易防控、反洗钱等方面。通过培训，增强了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，进一步提高督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，组成人员包括主管基金运营的公司领导、投资管理负责人、合规负责人、风险管理负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、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。估值委员会下设估值工作小组，估值工作小组对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，向估值委员会提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，基金收益分配后基金份额不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，但符合基金合同规定。

4.9 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

本基金自 2018 年 12 月 19 日至 2019 年 3 月 18 日，连续五十七个工作日出现基金

资产净值低于五千万元的情形；自 2019 年 3 月 26 日至 2019 年 6 月 20 日，连续五十八个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形；

本基金自 2019 年 9 月 5 日至 2019 年 11 月 19 日，连续四十八个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 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，本基金托管人在海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的管理人——海富通基金管理有限公司在海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2020)第 23442 号

海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“海富通量化多因子混合基金”)的财务报表,包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表,2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了海富通量化多因子混合基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

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。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。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于海富通量化多因子混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

海富通量化多因子混合基金的基金管理人海富通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,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,基金管理人管理层负责评估海富通量化多因子混合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,除非基金管理人管理层计划清算海富通量化多因子混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督海富通量化多因子混合基金的财务报告过程。

6.4 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：

(一) 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。

(二) 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。

(三) 评价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。

(四) 对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，就可能导致对海富通量化多因子混合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海富通量化多因子混合基金不能持续经营。

(五) 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。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师
薛竞 沈兆杰

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2020 年 4 月 9 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	11,443,617.85	3,370,529.50
结算备付金		3,577,915.68	1,031,221.22
存出保证金		67,751.26	107,428.01
交易性金融资产	7.4.7.2	253,599,447.06	19,801,582.87
其中：股票投资		242,304,349.58	16,794,372.47
基金投资		-	-
债券投资		11,295,097.48	3,007,210.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	2,000,000.00
应收证券清算款		4,079,280.28	-
应收利息	7.4.7.5	245,114.12	71,825.63
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		273,013,126.25	26,382,587.23
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,669,110.73	2,155,975.95
应付赎回款		11,399,231.91	-
应付管理人报酬		338,504.06	52,289.81
应付托管费		56,417.33	8,714.95

应付销售服务费		147,614.68	19,936.53
应付交易费用	7.4.7.7	173,592.54	18,107.33
应交税费		0.25	36.02
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	50,000.00	200,000.00
负债合计		13,834,471.50	2,455,060.59
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	219,701,897.47	29,058,731.06
未分配利润	7.4.7.10	39,476,757.28	-5,131,204.42
所有者权益合计		259,178,654.75	23,927,526.64
负债和所有者权益总计		273,013,126.25	26,382,587.23

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额总额 219,701,897.47 份，其中海富通量化多因子 A 类份额 42,137,469.40 份，海富通量化多因子 C 类份额 177,564,428.07 份。A 类份额净值 1.1692 元，C 类份额净值 1.1822 元。

7.2 利润表

会计主体：海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 4 月 23 日 (基金合同生效 日) 至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		36,620,652.83	-2,104,180.64
1.利息收入		231,277.68	662,622.52
其中：存款利息收入	7.4.7.11	85,667.36	241,611.11
债券利息收入		132,090.67	103,406.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		13,519.65	317,605.39
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		13,277,853.46	-1,848,926.12

其中：股票投资收益	7.4.7.12	11,022,794.80	-2,335,385.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	95,028.09	36,276.31
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	736,194.18	69,553.40
股利收益	7.4.7.16	1,423,836.39	380,630.10
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	22,971,625.27	-1,246,237.67
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	139,896.42	328,360.63
减：二、费用		3,465,043.20	1,257,715.80
1. 管理人报酬		1,737,320.55	570,070.93
2. 托管费		289,553.39	95,011.77
3. 销售服务费		741,267.29	216,838.50
4. 交易费用	7.4.7.19	643,522.01	174,354.38
5. 利息支出		25.43	-
其中：卖出回购金融资产支出		25.43	-
6. 税金及附加		2,621.53	236.22
7. 其他费用	7.4.7.20	50,733.00	201,204.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		33,155,609.63	-3,361,896.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		33,155,609.63	-3,361,896.44

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益	29,058,731.06	-5,131,204.42	23,927,526.64

(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	33,155,609.63	33,155,609.63
三、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)	190,643,166.41	11,452,352.07	202,095,518.48
其中：1.基金申购款	274,461,602.68	17,121,034.11	291,582,636.79
2.基金赎回款	-83,818,436.27	-5,668,682.04	-89,487,118.31
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	219,701,897.47	39,476,757.28	259,178,654.75
项目	上年度可比期间		
	2018年4月23日(基金合同生效日)至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	229,267,089.64	-	229,267,089.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,361,896.44	-3,361,896.44
三、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)	-200,208,358.58	-1,769,307.98	-201,977,666.56
其中：1.基金申购款	76,802,722.19	-10,548,003.29	66,254,718.90
2.基金赎回款	-277,011,080.77	8,778,695.31	-268,232,385.46
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	29,058,731.06	-5,131,204.42	23,927,526.64

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：陶网雄，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

海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]第 1276 号《关于准予海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册，由海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 229,225,413.15 元，已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0288 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 229,267,089.64 份，其中认购资金利息折合 41,676.49 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围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）、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、地方政府债、中小企业私募债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、金融衍生品（包括权证、股指期货等）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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 0%至 95%，权证资产占基金资产净值的 0%至 3%，在每个交易日日终，扣除股指期货合约须缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府

债券占基金资产净值的比例不低于 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。股指期货投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

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 2020 年 4 月 9 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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>》、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》、《海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年度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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2018 年 4 月 23 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融

资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具(主要为股指期货投资)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)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;或者(3)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。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具(主要为股指期货投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价

格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，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。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

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。由于申购和赎回引起的实收基金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

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证

券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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、债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)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。

(2)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。

(3)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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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：

(1) 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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日

活期存款	11,443,617.85	3,370,529.50
定期存款	-	-
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	-	-
合计	11,443,617.85	3,370,529.50

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	220,601,722.06	242,304,349.58	21,702,627.52	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	11,272,337.40	11,295,097.48	22,760.08
	银行间市场	-	-	-
	合计	11,272,337.40	11,295,097.48	22,760.08
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	231,874,059.46	253,599,447.06	21,725,387.60	
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	18,027,312.42	16,794,372.47	-1,232,939.95	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	3,011,028.12	3,007,210.40	-3,817.72
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,011,028.12	3,007,210.40	-3,817.72

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	21,038,340.54	19,801,582.87	-1,236,757.67

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2018 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	911,700.00	-	-	-
——股指期货	911,700.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	911,700.00	-	-	-

于 2019 年 12 月 31 日，本基金无股指期货持仓(2018 年 12 月 31 日：买入 IF1903 合约市值 902,220.00 元，公允价值变动-9,480.00 元)。

衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0 元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指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 元。

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 2019 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 2018 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,859.31	1,853.98
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,947.10	17,719.71
应收债券利息	241,277.21	52,244.14
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	30.50	7.80
合计	245,114.12	71,825.63

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末其他资产无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	173,592.54	18,107.33
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	173,592.54	18,107.33

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	50,000.00	200,000.00
合计	50,000.00	200,000.00

7.4.7.9 实收基金

海富通量化多因子混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,298,932.88	13,298,932.88
本期申购	39,882,854.62	39,882,854.62
本期赎回（以“-”号填列）	-11,044,318.10	-11,044,318.10
本期末	42,137,469.40	42,137,469.40

海富通量化多因子混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
----	-----------------------------	--

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,759,798.18	15,759,798.18
本期申购	234,578,748.06	234,578,748.06
本期赎回（以“-”号填列）	-72,774,118.17	-72,774,118.17
本期末	177,564,428.07	177,564,428.07

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

海富通量化多因子混合 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	-1,268,973.76	-1,128,339.07	-2,397,312.83
本期利润	2,643,070.45	6,142,052.90	8,785,123.35
本期基金份额交易产生的变动数	1,588,904.54	-847,334.59	741,569.95
其中：基金申购款	1,489,861.11	-366,934.92	1,122,926.19
基金赎回款	99,043.43	-480,399.67	-381,356.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,963,001.23	4,166,379.24	7,129,380.47

海富通量化多因子混合 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	-1,402,124.62	-1,331,766.97	-2,733,891.59
本期利润	7,540,913.91	16,829,572.37	24,370,486.28
本期基金份额交易产生的变动数	8,350,828.71	2,359,953.41	10,710,782.12
其中：基金申购款	9,539,235.58	6,458,872.34	15,998,107.92
基金赎回款	-1,188,406.87	-4,098,918.93	-5,287,325.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,489,618.00	17,857,758.81	32,347,376.81

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年4月23日（基金合同 生效日）至2018年12月31 日
活期存款利息收入	42,430.50	112,246.60
定期存款利息收入	-	105,777.78
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	35,795.34	21,552.28
其他	7,441.52	2,034.45
合计	85,667.36	241,611.11

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年4月23日（基金合同 生效日）至2018年12月31 日
卖出股票成交总额	174,351,455.22	53,479,587.83
减：卖出股票成本总额	163,328,660.42	55,814,973.76
买卖股票差价收入	11,022,794.80	-2,335,385.93

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年4月23日（基金合 同生效日）至2018年12 月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付） 成交总额	3,275,507.96	36,678,769.76
减：卖出债券（、债转股及债券到期 兑付）成本总额	3,116,467.70	35,766,887.08
减：应收利息总额	64,012.17	875,606.37
买卖债券差价收入	95,028.09	36,276.31

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年4月23日（基金合同生效日）至2018年12月31日
股指期货投资收益（税前）	758,280.00	71,640.00
股指期货差价收入应缴纳增值税额	-22,085.82	-2,086.60
合计	736,194.18	69,553.40

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年4月23日（基金合同生效日）至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,423,836.39	380,630.10
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,423,836.39	380,630.10

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年4月23日（基金合同生效日）至2018年12月31日
1.交易性金融资产	22,962,145.27	-1,236,757.67
——股票投资	22,935,567.47	-1,232,939.95
——债券投资	26,577.80	-3,817.72
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-

2.衍生工具	9,480.00	-9,480.00
——权证投资	-	-
——股指期货	9,480.00	-9,480.00
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	22,971,625.27	-1,246,237.67

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年4月23日（基金合同生效 日）至2018年12月31日
基金赎回费收入	139,896.38	328,360.63
基金转换费收入	0.04	-
合计	139,896.42	328,360.63

注：本基金赎回费收入、转换费收入归入基金财产部分具体见本基金基金合同、招募说明书（更新）等法律文件规定。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年4月23日（基金合同生效 日）至2018年12月31日
交易所市场交易费用	643,522.01	174,354.38
银行间市场交易费用	-	-
合计	643,522.01	174,354.38

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年4月23日（基金合同生效 日）至2018年12月31日
----	---------------------------------	--

审计费用	50,000.00	60,000.00
信息披露费	-	140,000.00
银行划款手续费	733.00	804.00
其他	-	400.00
合计	50,733.00	201,204.00

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
法国巴黎资产管理 BE 控股公司(BNP Paribas Asset Management BE Holding)	基金管理人的股东
上海富诚海富通资产管理有限公司	基金管理人的子公司
海富通资产管理(香港)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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年4月23日（基金合 同生效日）至2018年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,737,320.55	570,070.93
其中：支付销售机构的客户维护 费	100,412.69	253,780.33

注：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 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年4月23日（基金合 同生效日）至2018年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	289,553.39	95,011.77

注：支付基金托管人工商银行的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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 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 2019年1月1日至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通量化多因子混合 A	海富通量化多因子混合C	合计
中国工商银行	-	20,226.01	20,226.01
海通证券	-	270.43	270.43
海富通	-	714,137.67	714,137.67

合计	-	734,634.11	734,634.11
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年4月23日（基金合同生效日）至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通量化多因子混合 A	海富通量化多因子混合C	合计
中国工商银行	-	78,861.55	78,861.55
海通证券	-	1,063.01	1,063.01
海富通	-	89,181.02	89,181.02
合计	-	169,105.58	169,105.58

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额对应的资产净值} \times 0.8\% / \text{当年天数。}$$

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

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年4月23日（基金合同生效日）至2018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
工商银行	11,443,617.85	42,430.50	3,370,529.50	112,246.60

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

7.4.12 期末（2019 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	可流通日	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
002973	侨银环保	2019-12-27	2020-01-06	新股未上市	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
601077	渝农商行	2019-10-16	2020-04-29	新股锁定流通受限	7.36	6.26	73,889	543,823.04	462,545.14	-
601658	邮储银行	2019-12-02	2020-06-10	新股锁定流通受限	5.50	5.71	796,578	4,381,179.00	4,548,460.38	-
601916	浙商银行	2019-11-18	2020-05-26	新股锁定流通受限	4.94	4.66	294,195	1,453,323.30	1,370,948.70	-
688036	传音控股	2019-09-23	2020-03-30	新股锁定流通受限	35.15	42.95	15,377	540,501.55	660,442.15	-
688081	兴图新科	2019-12-26	2020-01-06	新股未上市	28.21	28.21	3,153	88,946.13	88,946.13	-
688111	金山办公	2019-11-11	2020-05-18	新股锁定流通	45.86	128.63	14,659	672,261.74	1,885,587.17	-

				受限						
688118	普元信息	2019-11-26	2020-06-04	新股锁定流通受限	26.90	35.30	4,028	108,353.20	142,188.40	-
688181	八亿时空	2019-12-27	2020-01-06	新股未上市	43.98	43.98	3,468	152,522.64	152,522.64	-
688399	硕世生物	2019-11-27	2020-06-05	新股锁定流通受限	46.78	54.51	2,290	107,126.20	124,827.90	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113556	至纯转债	2019-12-20	2020-01-09	老股东配债	100.00	100.00	610	61,000.00	61,000.00	-
123036	先导转债	2019-12-11	2020-01-10	老股东配债	100.00	100.00	141	14,100.00	14,100.00	-

注：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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603799	华友钴业	2019-12-31	重大资产重组	39.39	2020-01-02	40.43	9,400	235,073.00	370,266.00	-

注：本基金截至 2019 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

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

本基金是一只混合型的证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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以上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“风险和收益相匹配”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在本基金的托管行中国工商银行，因而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。

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 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债

券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.07%(2018 年 12 月 31 日: 5.36%)。

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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,597,354.60	-
合计	10,597,354.60	-

注: 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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
AAA	118,892.88	669,080.30
AAA 以下	75,100.00	612,570.90
未评级	503,750.00	1,725,559.20
合计	697,742.88	3,007,210.40

注: 未评级部分为政策性金融债。

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上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险, 本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求, 保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款, 约定在非常情况下赎回申请的处理方式, 控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险, 有效保障基金持有人利益。

于 2019 年 12 月 31 日, 本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个

月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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%。于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 3.79%。

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。于本报告期末，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	11,443,617.85	-	-	-	11,443,617.85
结算备付金	3,577,915.68	-	-	-	3,577,915.68
存出保证金	67,751.26	-	-	-	67,751.26
交易性金融资产	11,101,104.60	-	193,992.88	242,304,349.58	253,599,447.06
应收证券清算款	-	-	-	4,079,280.28	4,079,280.28
应收利息	-	-	-	245,114.12	245,114.12
资产总计	26,190,389.39	0.00	193,992.88	246,628,743.98	273,013,126.25
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,669,110.73	1,669,110.73
应付管理人报酬	-	-	-	338,504.06	338,504.06
应付销售服务费	-	-	-	147,614.68	147,614.68
应付托管费	-	-	-	56,417.33	56,417.33

应付交易费用	-	-	-	173,592.54	173,592.54
应付赎回款	-	-	-	11,399,231.91	11,399,231.91
应付税费	-	-	-	0.25	0.25
其他负债	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	0.00	13,834,471.50	13,834,471.50
利率敏感度缺口	26,190,389.39	-	193,992.88	232,794,272.48	259,178,654.75
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,370,529.50	-	-	-	3,370,529.50
结算备付金	1,031,221.22	-	-	-	1,031,221.22
存出保证金	107,428.01	-	-	-	107,428.01
交易性金融资产	1,725,559.20	1,211,812.20	69,839.00	16,794,372.47	19,801,582.87
买入返售金融资产	2,000,000.00	-	-	-	2,000,000.00
应收利息	-	-	-	71,825.63	71,825.63
资产总计	8,234,737.93	1,211,812.20	69,839.00	16,866,198.10	26,382,587.23
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,155,975.95	2,155,975.95
应付管理人报酬	-	-	-	52,289.81	52,289.81
应付托管费	-	-	-	8,714.95	8,714.95
应付销售服务费	-	-	-	19,936.53	19,936.53
应付交易费用	-	-	-	18,107.33	18,107.33
应交税费	-	-	-	36.02	36.02
其他负债	-	-	-	200,000.00	200,000.00
负债总计	-	-	-	2,455,060.59	2,455,060.59
利率敏感度缺口	8,234,737.93	1,211,812.20	69,839.00	14,411,137.51	23,927,526.64

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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-4,683.62	-13,533.97
	市场利率下降 25 个基点	4,736.11	13,698.71

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资 0%-95%、权证投资 0%-3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日		上年度末 2018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	242,304,349.58	93.49	16,794,372.47	70.19
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	-	-	-	-
合计	242,304,349.58	93.49	16,794,372.47	70.19

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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
	业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	12,361,255.42	942,338.24
	业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-12,361,255.42	-942,338.24

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)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。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 232,609,929.81 元，属于第二层次的余额为 20,989,517.25 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为 17,644,342.67 元，属于第二层次的余额为 2,157,240.20 元，无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	242,304,349.58	88.75
	其中：股票	242,304,349.58	88.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,295,097.48	4.14
	其中：债券	11,295,097.48	4.14
	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	15,021,533.53	5.50
8	其他各项资产	4,392,145.66	1.61
9	合计	273,013,126.25	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	5,430,011.50	2.10
B	采矿业	3,924,644.28	1.51
C	制造业	122,192,826.41	47.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应 业	2,385,112.00	0.92
E	建筑业	3,796,998.00	1.47

F	批发和零售业	2,502,503.00	0.97
G	交通运输、仓储和邮政业	5,492,820.00	2.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,308,182.57	3.21
J	金融业	66,797,148.84	25.77
K	房地产业	17,500,510.34	6.75
L	租赁和商务服务业	1,133,514.00	0.44
M	科学研究和技术服务业	1,730,013.60	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,103,487.00	0.43
S	综合	-	-
	合计	242,304,349.58	93.49

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	601318	中国平安	244,837	20,923,770.02	8.07
2	600519	贵州茅台	13,595	16,082,885.00	6.21
3	600036	招商银行	362,800	13,634,024.00	5.26
4	000002	万科 A	286,713	9,226,424.34	3.56
5	000651	格力电器	139,150	9,125,457.00	3.52
6	600276	恒瑞医药	80,017	7,003,087.84	2.70
7	600585	海螺水泥	109,966	6,026,136.80	2.33
8	002475	立讯精密	155,630	5,680,495.00	2.19
9	601166	兴业银行	283,300	5,609,340.00	2.16
10	000858	五粮液	36,356	4,835,711.56	1.87
11	000001	平安银行	287,100	4,722,795.00	1.82
12	601658	邮储银行	796,578	4,548,460.38	1.75
13	600048	保利地产	244,100	3,949,538.00	1.52

14	600031	三一重工	214,938	3,664,692.90	1.41
15	600030	中信证券	144,300	3,650,790.00	1.41
16	000338	潍柴动力	223,100	3,542,828.00	1.37
17	000333	美的集团	59,861	3,486,903.25	1.35
18	300498	温氏股份	101,200	3,400,320.00	1.31
19	600104	上汽集团	135,400	3,229,290.00	1.25
20	600009	上海机场	40,500	3,189,375.00	1.23
21	000568	泸州老窖	34,747	3,011,869.96	1.16
22	601186	中国铁建	290,500	2,945,670.00	1.14
23	000661	长春高新	6,300	2,816,100.00	1.09
24	600887	伊利股份	86,657	2,681,167.58	1.03
25	000063	中兴通讯	73,700	2,608,243.00	1.01
26	600309	万华化学	45,000	2,527,650.00	0.98
27	002415	海康威视	74,290	2,432,254.60	0.94
28	601899	紫金矿业	499,500	2,292,705.00	0.88
29	600406	国电南瑞	104,700	2,217,546.00	0.86
30	601211	国泰君安	118,260	2,186,627.40	0.84
31	601009	南京银行	248,900	2,182,853.00	0.84
32	603899	晨光文具	41,300	2,012,962.00	0.78
33	603369	今世缘	60,600	1,982,832.00	0.77
34	002353	杰瑞股份	52,800	1,951,488.00	0.75
35	600741	华域汽车	72,700	1,889,473.00	0.73
36	688111	金山办公	14,659	1,885,587.17	0.73
37	300760	迈瑞医疗	9,700	1,764,430.00	0.68
38	603259	药明康德	18,780	1,730,013.60	0.67
39	000961	中南建设	158,400	1,671,120.00	0.64
40	603939	益丰药房	21,500	1,574,230.00	0.61
41	600690	海尔智家	79,123	1,542,898.50	0.60
42	601939	建设银行	207,300	1,498,779.00	0.58
43	601601	中国太保	39,000	1,475,760.00	0.57
44	002299	圣农发展	61,200	1,473,696.00	0.57
45	600886	国投电力	153,100	1,405,458.00	0.54
46	601916	浙商银行	294,195	1,370,948.70	0.53
47	688008	澜起科技	19,106	1,368,180.66	0.53
48	002001	新和成	58,100	1,351,406.00	0.52
49	002008	大族激光	33,100	1,324,000.00	0.51
50	300122	智飞生物	26,400	1,311,024.00	0.51
51	601688	华泰证券	63,000	1,279,530.00	0.49
52	600332	白云山	35,900	1,278,399.00	0.49
53	000157	中联重科	188,600	1,259,848.00	0.49
54	002410	广联达	37,000	1,257,260.00	0.49
55	002032	苏泊尔	16,340	1,254,585.20	0.48
56	000625	长安汽车	116,100	1,164,483.00	0.45
57	300144	宋城演艺	35,700	1,103,487.00	0.43

58	300059	东方财富	69,560	1,096,961.20	0.42
59	600000	浦发银行	84,800	1,048,976.00	0.40
60	600900	长江电力	53,300	979,654.00	0.38
61	600176	中国巨石	89,740	978,166.00	0.38
62	300747	锐科激光	8,300	977,740.00	0.38
63	603886	元祖股份	54,600	966,966.00	0.37
64	601225	陕西煤业	103,372	929,314.28	0.36
65	002050	三花智控	53,490	926,981.70	0.36
66	600340	华夏幸福	31,900	915,530.00	0.35
67	002007	华兰生物	25,900	910,385.00	0.35
68	001979	招商蛇口	45,400	902,098.00	0.35
69	603690	至纯科技	26,000	847,340.00	0.33
70	002557	洽洽食品	24,900	845,853.00	0.33
71	600570	恒生电子	10,800	839,484.00	0.32
72	600383	金地集团	57,400	832,300.00	0.32
73	601006	大秦铁路	96,200	789,802.00	0.30
74	601111	中国国航	80,100	776,169.00	0.30
75	601668	中国建筑	130,800	735,096.00	0.28
76	002727	一心堂	29,800	693,148.00	0.27
77	300383	光环新网	33,700	676,359.00	0.26
78	688036	传音控股	15,377	660,442.15	0.25
79	002597	金禾实业	26,900	608,209.00	0.23
80	002142	宁波银行	20,000	563,000.00	0.22
81	603026	石大胜华	16,000	560,320.00	0.22
82	601818	光大银行	122,900	541,989.00	0.21
83	002311	海大集团	15,000	540,000.00	0.21
84	300470	中密控股	19,200	518,784.00	0.20
85	601088	中国神华	27,300	498,225.00	0.19
86	300253	卫宁健康	31,800	476,364.00	0.18
87	002236	大华股份	23,800	473,144.00	0.18
88	600285	羚锐制药	47,500	470,250.00	0.18
89	601077	渝农商行	73,889	462,545.14	0.18
90	600801	华新水泥	17,203	454,675.29	0.18
91	002234	民和股份	13,850	440,568.50	0.17
92	002531	天顺风能	69,600	439,872.00	0.17
93	000538	云南白药	4,600	411,378.00	0.16
94	601966	玲珑轮胎	17,900	410,447.00	0.16
95	002127	南极电商	35,100	382,941.00	0.15
96	601888	中国国旅	4,300	382,485.00	0.15
97	002478	常宝股份	64,000	378,880.00	0.15
98	603799	华友钴业	9,400	370,266.00	0.14
99	002027	分众传媒	58,800	368,088.00	0.14
100	300146	汤臣倍健	21,400	348,606.00	0.13
101	603585	苏利股份	16,500	346,830.00	0.13

102	002812	恩捷股份	6,600	333,300.00	0.13
103	601012	隆基股份	12,500	310,375.00	0.12
104	600298	安琪酵母	10,100	309,767.00	0.12
105	600352	浙江龙盛	21,100	305,317.00	0.12
106	600004	白云机场	17,400	303,630.00	0.12
107	600885	宏发股份	8,800	303,160.00	0.12
108	601233	桐昆股份	20,000	299,800.00	0.12
109	002643	万润股份	19,700	299,243.00	0.12
110	600019	宝钢股份	49,700	285,278.00	0.11
111	600377	宁沪高速	25,100	281,622.00	0.11
112	300450	先导智能	6,200	278,628.00	0.11
113	002271	东方雨虹	10,100	265,731.00	0.10
114	300570	太辰光	9,400	255,962.00	0.10
115	688166	博瑞医药	8,041	255,462.57	0.10
116	600529	山东药玻	9,200	254,288.00	0.10
117	600426	华鲁恒升	12,700	252,349.00	0.10
118	002648	卫星石化	15,300	250,155.00	0.10
119	002153	石基信息	6,200	241,800.00	0.09
120	603233	大参林	4,500	235,125.00	0.09
121	300271	华宇软件	9,200	233,680.00	0.09
122	002511	中顺洁柔	18,200	230,412.00	0.09
123	603587	地素时尚	8,800	223,344.00	0.09
124	002179	中航光电	5,700	222,642.00	0.09
125	300525	博思软件	5,700	221,730.00	0.09
126	000049	德赛电池	5,200	211,848.00	0.08
127	601058	赛轮轮胎	46,100	206,067.00	0.08
128	600028	中国石化	40,000	204,400.00	0.08
129	688363	华熙生物	2,450	204,330.00	0.08
130	002734	利民股份	14,500	200,680.00	0.08
131	300618	寒锐钴业	2,400	197,736.00	0.08
132	603218	日月股份	9,400	195,238.00	0.08
133	603985	恒润股份	12,300	191,880.00	0.07
134	002241	歌尔股份	7,800	155,376.00	0.06
135	688181	八亿时空	3,468	152,522.64	0.06
136	600115	东方航空	26,200	152,222.00	0.06
137	688118	普元信息	4,028	142,188.40	0.05
138	603208	江山欧派	2,700	137,592.00	0.05
139	688399	硕世生物	2,290	124,827.90	0.05
140	002202	金风科技	10,400	124,280.00	0.05
141	300316	晶盛机电	7,500	117,900.00	0.05
142	300750	宁德时代	1,100	117,040.00	0.05
143	600068	葛洲坝	17,400	116,232.00	0.04
144	002714	牧原股份	1,300	115,427.00	0.04
145	000725	京东方 A	25,200	114,408.00	0.04

146	300454	深信服	1,000	114,390.00	0.04
147	300590	移为通信	3,000	108,540.00	0.04
148	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.03
149	603589	口子窖	1,600	87,856.00	0.03
150	002124	天邦股份	7,000	87,850.00	0.03
151	300207	欣旺达	4,200	81,984.00	0.03
152	600612	老凤祥	1,700	80,937.00	0.03
153	000786	北新建材	3,073	78,207.85	0.03
154	600872	中炬高新	1,900	74,765.00	0.03
155	300685	艾德生物	1,000	66,820.00	0.03
156	002773	康弘药业	1,500	55,455.00	0.02
157	000596	古井贡酒	400	54,368.00	0.02
158	000425	徐工机械	9,600	52,512.00	0.02
159	600782	新钢股份	8,700	44,631.00	0.02
160	688123	聚辰股份	530	37,990.40	0.01
161	002690	美亚光电	800	31,280.00	0.01
162	300003	乐普医疗	800	26,464.00	0.01
163	002508	老板电器	700	23,667.00	0.01
164	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.01
165	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.01
166	603387	基蛋生物	500	11,525.00	0.00
167	603515	欧普照明	400	11,244.00	0.00
168	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00
169	600007	中国国贸	200	3,500.00	0.00
170	002798	帝欧家居	100	2,505.00	0.00
171	601877	正泰电器	89	2,385.20	0.00
172	300451	创业慧康	100	1,794.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	21,964,785.00	91.80
2	600036	招商银行	15,746,540.00	65.81
3	600519	贵州茅台	15,196,995.35	63.51
4	000333	美的集团	10,234,235.93	42.77
5	000651	格力电器	10,208,865.00	42.67
6	601166	兴业银行	9,933,843.75	41.52

7	000002	万科 A	8,715,966.00	36.43
8	600276	恒瑞医药	7,134,423.00	29.82
9	600887	伊利股份	7,005,312.39	29.28
10	000858	五粮液	6,682,184.33	27.93
11	600030	中信证券	6,659,812.00	27.83
12	601939	建设银行	6,374,090.00	26.64
13	601658	邮储银行	6,258,824.00	26.16
14	300498	温氏股份	5,803,667.42	24.26
15	000001	平安银行	5,543,338.24	23.17
16	600585	海螺水泥	5,015,018.00	20.96
17	002475	立讯精密	4,943,684.88	20.66
18	600104	上汽集团	4,086,414.00	17.08
19	601211	国泰君安	3,998,406.99	16.71
20	600048	保利地产	3,988,494.00	16.67
21	000568	泸州老窖	3,867,626.00	16.16
22	601009	南京银行	3,765,063.00	15.74
23	601668	中国建筑	3,325,636.00	13.90
24	002415	海康威视	3,317,000.20	13.86
25	601186	中国铁建	3,290,661.00	13.75
26	600031	三一重工	3,290,352.00	13.75
27	600309	万华化学	3,188,458.00	13.33
28	600009	上海机场	3,104,128.00	12.97
29	601899	紫金矿业	3,080,055.00	12.87
30	000063	中兴通讯	3,006,140.00	12.56
31	002594	比亚迪	2,957,745.70	12.36
32	000538	云南白药	2,799,262.00	11.70
33	000338	潍柴动力	2,628,790.00	10.99
34	601012	隆基股份	2,473,104.00	10.34
35	000661	长春高新	2,408,611.00	10.07
36	603259	药明康德	2,348,792.00	9.82
37	603939	益丰药房	2,310,415.00	9.66
38	002353	杰瑞股份	2,269,217.00	9.48
39	601601	中国太保	2,256,776.00	9.43
40	600570	恒生电子	2,173,823.00	9.09
41	600406	国电南瑞	2,159,561.96	9.03
42	601916	浙商银行	2,076,173.32	8.68
43	600741	华域汽车	2,050,158.00	8.57
44	601688	华泰证券	2,042,253.00	8.54
45	600690	海尔智家	2,033,745.78	8.50
46	300525	博思软件	1,983,756.60	8.29
47	001979	招商蛇口	1,966,458.00	8.22
48	300122	智飞生物	1,943,060.00	8.12
49	603369	今世缘	1,929,003.00	8.06
50	300253	卫宁健康	1,890,258.68	7.90

51	002299	圣农发展	1,857,241.00	7.76
52	002422	科伦药业	1,811,546.00	7.57
53	600383	金地集团	1,805,715.88	7.55
54	603899	晨光文具	1,797,975.00	7.51
55	601006	大秦铁路	1,777,807.00	7.43
56	300760	迈瑞医疗	1,754,653.00	7.33
57	600332	白云山	1,682,284.00	7.03
58	601111	中国国航	1,616,438.00	6.76
59	002798	帝欧家居	1,605,413.00	6.71
60	600886	国投电力	1,566,186.00	6.55
61	002008	大族激光	1,557,422.00	6.51
62	600340	华夏幸福	1,552,668.00	6.49
63	002410	广联达	1,539,977.40	6.44
64	300144	宋城演艺	1,522,729.00	6.36
65	002142	宁波银行	1,452,536.00	6.07
66	000961	中南建设	1,399,129.00	5.85
67	603444	吉比特	1,342,488.00	5.61
68	300059	东方财富	1,325,467.00	5.54
69	002032	苏泊尔	1,252,359.40	5.23
70	600016	民生银行	1,234,000.00	5.16
71	601288	农业银行	1,226,933.00	5.13
72	002001	新和成	1,190,276.00	4.97
73	603886	元祖股份	1,182,814.00	4.94
74	000157	中联重科	1,178,021.00	4.92
75	688008	澜起科技	1,170,152.38	4.89
76	300383	光环新网	1,161,144.00	4.85
77	601328	交通银行	1,148,180.00	4.80
78	603986	兆易创新	1,140,619.44	4.77
79	600028	中国石化	1,115,065.00	4.66
80	000786	北新建材	1,077,011.74	4.50
81	603690	至纯科技	1,064,790.00	4.45
82	601877	正泰电器	1,051,128.06	4.39
83	600000	浦发银行	1,048,211.00	4.38
84	601088	中国神华	1,021,614.00	4.27
85	300014	亿纬锂能	1,002,139.00	4.19
86	601988	中国银行	1,001,643.00	4.19
87	000625	长安汽车	969,076.00	4.05
88	600900	长江电力	960,303.00	4.01
89	002007	华兰生物	950,122.00	3.97
90	300316	晶盛机电	949,568.00	3.97
91	601225	陕西煤业	903,831.00	3.78
92	603026	石大胜华	887,844.00	3.71
93	002050	三花智控	878,004.00	3.67
94	300747	锐科激光	863,253.00	3.61

95	300271	华宇软件	846,651.00	3.54
96	600176	中国巨石	840,437.00	3.51
97	002372	伟星新材	823,140.00	3.44
98	002179	中航光电	804,618.00	3.36
99	601077	渝农商行	776,884.80	3.25
100	601231	环旭电子	768,879.00	3.21
101	600885	宏发股份	764,210.00	3.19
102	002727	一心堂	757,990.00	3.17
103	002463	沪电股份	739,886.00	3.09
104	000100	TCL 集团	720,000.00	3.01
105	300012	华测检测	719,314.00	3.01
106	002597	金禾实业	708,812.00	2.96
107	601766	中国中车	697,810.00	2.92
108	000028	国药一致	673,545.00	2.81
109	688111	金山办公	672,261.74	2.81
110	002304	洋河股份	667,986.00	2.79
111	002557	洽洽食品	604,087.00	2.52
112	603589	口子窖	603,957.00	2.52
113	002643	万润股份	587,173.00	2.45
114	002812	恩捷股份	570,524.00	2.38
115	002478	常宝股份	568,738.00	2.38
116	600050	中国联通	568,405.00	2.38
117	002024	苏宁易购	566,560.00	2.37
118	002236	大华股份	563,610.00	2.36
119	002146	荣盛发展	557,218.00	2.33
120	002234	民和股份	555,068.00	2.32
121	600529	山东药玻	540,861.20	2.26
122	688036	传音控股	540,501.55	2.26
123	601888	中国国旅	532,836.00	2.23
124	002531	天顺风能	530,026.00	2.22
125	600285	羚锐制药	525,535.26	2.20
126	002511	中顺洁柔	523,509.00	2.19
127	002439	启明星辰	522,436.00	2.18
128	300451	创业慧康	513,900.00	2.15
129	600196	复星医药	497,187.00	2.08
130	002371	北方华创	491,351.00	2.05
131	002153	石基信息	487,935.00	2.04
132	601818	光大银行	484,767.00	2.03
133	300037	新宙邦	479,653.00	2.00

注：1. “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。

2. 根据 TCL 科技集团股份有限公司于 2020 年 2 月 7 日发布的《关于更名工商变更登记完成及变更证券简称的公告》，经公司申请，并经深圳证券交易所核准，公司证券简称自 2020 年 2 月 7 日起由“TCL 集团”变更为“TCL 科技”，英文简称由“TCL CORP”变更为

“TCL TECH”，公司证券代码不变，仍为“000100”。

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	000333	美的集团	7,621,226.00	31.85
2	601939	建设银行	5,109,911.40	21.36
3	601166	兴业银行	4,911,565.00	20.53
4	600887	伊利股份	4,750,297.30	19.85
5	600036	招商银行	4,577,841.72	19.13
6	600030	中信证券	3,540,207.00	14.80
7	000651	格力电器	3,312,019.00	13.84
8	600519	贵州茅台	3,237,451.25	13.53
9	000538	云南白药	3,143,870.93	13.14
10	601668	中国建筑	3,100,632.00	12.96
11	002594	比亚迪	3,084,550.84	12.89
12	300525	博思软件	2,689,774.60	11.24
13	601211	国泰君安	2,300,387.62	9.61
14	601318	中国平安	2,287,222.13	9.56
15	601012	隆基股份	2,084,518.63	8.71
16	000858	五粮液	2,052,781.90	8.58
17	601658	邮储银行	1,907,232.20	7.97
18	002798	帝欧家居	1,813,324.06	7.58
19	601009	南京银行	1,677,300.00	7.01
20	300498	温氏股份	1,596,366.70	6.67
21	002415	海康威视	1,566,472.40	6.55
22	002422	科伦药业	1,562,018.26	6.53
23	000001	平安银行	1,549,472.00	6.48
24	000002	万科 A	1,526,529.73	6.38
25	601288	农业银行	1,526,369.00	6.38
26	600309	万华化学	1,388,127.00	5.80
27	300253	卫宁健康	1,374,512.00	5.74
28	603444	吉比特	1,360,946.00	5.69
29	603986	兆易创新	1,320,657.00	5.52
30	600570	恒生电子	1,279,689.20	5.35
31	002475	立讯精密	1,272,999.06	5.32
32	000786	北新建材	1,253,841.33	5.24
33	002142	宁波银行	1,244,133.41	5.20
34	300014	亿纬锂能	1,213,255.98	5.07
35	600016	民生银行	1,212,000.00	5.07

36	601877	正泰电器	1,176,872.10	4.92
37	000568	泸州老窖	1,165,883.50	4.87
38	001979	招商蛇口	1,134,055.00	4.74
39	600104	上汽集团	1,132,229.37	4.73
40	601328	交通银行	1,119,160.00	4.68
41	601899	紫金矿业	1,103,428.00	4.61
42	601006	大秦铁路	1,101,819.80	4.60
43	600276	恒瑞医药	1,082,609.26	4.52
44	600383	金地集团	1,079,554.00	4.51
45	002353	杰瑞股份	1,070,793.56	4.48
46	601988	中国银行	999,856.00	4.18
47	600048	保利地产	999,687.00	4.18
48	601231	环旭电子	967,830.09	4.04
49	600585	海螺水泥	950,410.00	3.97
50	002304	洋河股份	948,961.85	3.97
51	002463	沪电股份	946,988.00	3.96
52	603259	药明康德	938,027.00	3.92
53	300316	晶盛机电	899,236.00	3.76
54	600028	中国石化	892,538.80	3.73
55	601111	中国国航	887,908.00	3.71
56	601688	华泰证券	836,584.00	3.50
57	601601	中国太保	833,954.42	3.49
58	603939	益丰药房	787,909.00	3.29
59	300012	华测检测	775,871.00	3.24
60	300144	宋城演艺	749,686.44	3.13
61	000100	TCL 集团	738,000.00	3.08
62	300271	华宇软件	732,002.53	3.06
63	002146	荣盛发展	731,656.85	3.06
64	600885	宏发股份	727,928.00	3.04
65	000063	中兴通讯	719,291.00	3.01
66	600050	中国联通	710,575.00	2.97
67	300037	新宙邦	709,752.00	2.97
68	002372	伟星新材	708,250.00	2.96
69	600690	海尔智家	708,030.39	2.96
70	000028	国药一致	655,454.00	2.74
71	002179	中航光电	651,750.50	2.72
72	300383	光环新网	648,378.00	2.71
73	603690	至纯科技	648,315.00	2.71
74	601766	中国中车	644,408.00	2.69
75	601186	中国铁建	635,692.00	2.66
76	002439	启明星辰	610,726.00	2.55
77	688363	华熙生物	608,282.15	2.54
78	300122	智飞生物	595,508.00	2.49
79	601916	浙商银行	583,764.29	2.44

80	688196	卓越新能	582,004.28	2.43
81	600196	复星医药	558,409.16	2.33
82	002268	卫士通	548,756.00	2.29
83	000776	广发证券	531,957.62	2.22
84	002812	恩捷股份	531,808.06	2.22
85	300451	创业慧康	529,037.00	2.21
86	600031	三一重工	526,505.60	2.20
87	002024	苏宁易购	525,088.00	2.19
88	601088	中国神华	524,180.22	2.19
89	600340	华夏幸福	520,426.00	2.18
90	600073	上海梅林	520,416.00	2.17
91	603589	口子窖	504,687.00	2.11
92	002371	北方华创	493,610.00	2.06

注：1. “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。
2. 根据 TCL 科技集团股份有限公司于 2020 年 2 月 7 日发布的《关于更名工商变更登记完成及变更证券简称的公告》，经公司申请，并经深圳证券交易所核准，公司证券简称自 2020 年 2 月 7 日起由“TCL 集团”变更为“TCL 科技”，英文简称由“TCL CORP”变更为“TCL TECH”，公司证券代码不变，仍为“000100”。

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	365,903,070.06
卖出股票的收入（成交）总额	174,351,455.22

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	10,597,354.60	4.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	503,750.00	0.19
	其中：政策性金融债	503,750.00	0.19
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）	193,992.88	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,295,097.48	4.36

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	019611	19 国债 01	105,910	10,597,354.60	4.09
2	018007	国开 1801	5,000	503,750.00	0.19
3	110059	浦发转债	600	65,544.00	0.03
4	113556	至纯转债	610	61,000.00	0.02
5	110061	川投转债	310	37,736.30	0.01

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投资。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。本基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 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 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的兴业银行（601166）因严重违反审慎经营规则办理票据业务，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》等相关规定，于 2019 年 10 月 15 日被中国银行保险监督管理委员会辽宁银保监局罚款人民币 2250 万元。

公司因违规向房地产开发企业提供融资、违规通过同业投资规避监管指标、违规修改理财协议文本、违规向企业权益性投资提供融资、违规向普通客户销售投向非上市公司股权的理财产品，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》等相关规定，于 2019 年 10 月 8 日被中国银行保险监督管理委员会北京银保监局处以合计 600 万元罚款的行政处罚，并责令公司北京分行改正。

对该证券的投资决策程序的说明：公司资产质量夯实稳健，拨备相对充足，信用成本保持较低水平且相对稳定；整体息差未来在经营转型深化和资产负债结构改善下具备提升的空间。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程，该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余九名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

8.12.2 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。

8.12.3 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	67,751.26
2	应收证券清算款	4,079,280.28
3	应收股利	-
4	应收利息	245,114.12
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,392,145.66

8.12.4 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。

8.12.5 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的情况。

§ 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
海富通量化多因子混合 A	77	547,239.86	38,907,840.19	92.34%	3,229,629.21	7.66%
海富通量化多因子混合 C	117	1,517,644.68	176,169,205.02	99.21%	1,395,223.05	0.79%
合计	194	1,132,484.01	215,077,045.21	97.89%	4,624,852.26	2.11%

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	海富通量化多因子混合 A	75,547.44	0.1793%
	海富通量化多因子混合 C	958.06	0.0005%
	合计	76,505.50	0.0348%

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	海富通量化多因子混合 A	0
	海富通量化多因子混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通量化多因子混合 A	0
	海富通量化多因子混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通量化多因子混合 A	海富通量化多因子混合 C
基金合同生效日（2018 年 4 月 23 日）基金份额总额	25,595,406.97	203,671,682.67
本报告期期初基金份额总额	13,298,932.88	15,759,798.18
本报告期基金总申购份额	39,882,854.62	234,578,748.06
减：本报告期基金总赎回份额	11,044,318.10	72,774,118.17
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	42,137,469.40	177,564,428.07

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

1、2019 年 3 月 29 日，海富通基金管理有限公司发布公告，因第五届董事会任期届满，经公司 2019 年第一次临时股东会审议通过，选举杨仓兵先生、吴淑琨先生、芮政先先生、任志强先生、Ligia TORRES (陶乐斯)女士、Alexandre WERNO (韦历山)先生、张馨先生、杨文斌 (Philip YOUNG Wen Binn)先生、刘正东先生、陈静女士担任公司第六届董事会董事，其中张馨先生、杨文斌(Philip YOUNG Wen Binn)先生、刘正东先生、陈静女士为独立董事。原第五届董事会成员张文伟先生、杨明先生、杨国平先生、Marc Bayot (巴约特)先生、郑国汉 (Leonard K.CHENG) 先生不再担任公司董事职务。

2、2019 年 3 月 29 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第一次会议审议通过，张文伟先生不再担任公司董事长职务，并决定由公司总经理任志强先生代为履行董事长职务，代为履行董事长职务的期限不超过 90 日。

3、2019 年 4 月 29 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第一次会议审议通过，聘请杨仓兵先生担任公司董事长职务。自杨仓兵先生任董事长职务之日起，公司总经理任志强先生不再代行董事长职务。

4、2019 年 12 月 14 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第六届董事会第五次临时会议审议通过，聘请魏峻先生担任公司副总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内,本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本年度应支付的审计费用是 50,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 2 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

报告期内，本基金的管理人、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	
中泰证券(原齐鲁)	2	187,922,236.50	35.87%	137,426.98	35.50%	-
申万宏源	2	110,039,446.95	21.01%	45,334.10	11.71%	-
东方证券	1	107,463,085.63	20.51%	100,079.94	25.85%	-
方正证券	1	90,123,427.50	17.20%	82,129.87	21.21%	-
东北证券	1	18,515,063.00	3.53%	13,169.66	3.40%	-
中信建投	1	7,121,281.78	1.36%	6,489.65	1.68%	-
华泰证券	1	1,806,466.00	0.34%	1,682.29	0.43%	-
东兴证券	2	880,304.09	0.17%	819.89	0.21%	-
中金公司	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内退租方正证券(原民族证券)两个券商交易单元。

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评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见。

（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，经投资部部门会议讨论，形成重点评估的证券公司备选池，从中进行甄选。原则上，备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的 200%。

<2> 甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见，并报公司总经理办公会核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，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
中泰证券(原齐鲁)	11,309,636.10	85.87%	123,300,000.00	92.71%	-	-
申万宏源	430,061.41	3.27%	8,700,000.00	6.54%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	31,647.00	0.24%	-	-	-	-
东北证券	182,754.83	1.39%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	1,216,203.80	9.23%	1,000,000.00	0.75%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

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基金2018年年度基金资产净值和基金份额净值公告	《证券时报》	2019-01-01
2	海富通基金管理有限公司关于董事会成员换届变更的公告	《证券时报》	2019-03-29
3	海富通基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《证券时报》	2019-03-29
4	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《证券时报》	2019-04-29
5	海富通基金管理有限公司关于开展旗下部分基金直销柜台费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019-06-13
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增西部证券股份有限公司为销售机构的公告	《证券时报》	2019-06-13
7	海富通基金管理有限公司关于调整旗下基金直销柜台最低申购金额的公告	《证券时报》	2019-06-18

8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《证券时报》	2019-06-21
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加部分销售机构申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019-06-28
10	海富通基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年上半年度基金资产净值和基金份额净值公告	《证券时报》	2019-07-01
11	关于提请投资者及时提供或更新身份信息公告	《证券时报》	2019-07-05
12	海富通基金管理有限公司关于暂停旗下部分基金直销柜台费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019-07-25
13	海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购和转换转入业务的公告	《证券时报》	2019-07-26
14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增联储证券有限责任公司为销售机构的公告	《证券时报》	2019-08-15
15	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加海通证券认购、申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019-08-28
16	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏汇林保大基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019-09-28
17	海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	《证券时报》	2019-10-17
18	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同、托管协议的公告	《证券时报》	2019-10-31
19	关于提请投资者及时提供或更新身份信息以免影响业务办理的公告	《证券时报》	2019-11-21
20	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《证券时报》	2019-12-14
21	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行“2020 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	《证券时报》	2019-12-27
22	海富通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金继续在中国工商银行股份有限公司开展个人电子银行（含 AI 投服务）基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》	2019-12-27
23	海富通基金管理有限公司关于进一步提请投资者及时提供或更新身份信息以免影响业务办理的公告	《证券时报》	2019-12-30

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019/1/1-2019/6/23	7,211,538.46	-	-	7,211,538.46	3.28%
	2	2019/3/19-2019/3/26	-	24,589,357.73	24,589,357.73	0.00	0.00%
	3	2019/6/24-2019/8/22	-	37,938,989.69	-	37,938,989.69	17.27%
	4	2019/6/27-2019/8/7	-	47,577,429.85	22,388,512.97	25,188,916.88	11.47%
	5	2019/7/24-2019/8/7	-	27,616,506.33	9,800,000.00	17,816,506.33	8.11%

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：

- 1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；
- 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。
- 3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。
- 4、其他可能的风险。

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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 74 只公募基金。截至 2019 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1114 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，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2011 年 12 月，海富通全资子公司——海富通资产管理（香港）有限公司获得证监会核准批复 RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012 年 9 月，中国保险监督管理委员会（现中国银行保险监督管理委员会）公告确认海富通基金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，海富通基金管理有限公司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。

2018 年 3 月，国内权威财经媒体《证券时报》授予海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金为第十三届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金。2019 年 3 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金再度被权威媒体《证券时报》授予第十四届中国基金业明星基金奖——三年持续回报绝对收益明星基金和 2018 年度绝对收益明星基金。2019 年 4 月，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金被权威财经媒体《中国证券报》和《上海证券报》分别评选为第十六届中国基金业金牛奖——三年期开放式混合型持续优胜金牛基金和第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·灵活配置型基金奖（三年期）。同时，海富通基金管理有限公司荣获《上海证券报》第十六届中国基金业“金基金”奖——金基金·成长基金管理公司奖。

§ 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量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的文件
- （二）海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- （三）海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- （五）中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

(六) 报告期内海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

13.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 36—37 层本基金管理人办公地址。

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
二〇二〇年四月十一日