

华富量子生命力混合型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：华富基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 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。本半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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	42

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	42
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	42
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	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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情况	43
§ 9 开放式基金份额变动	43
§ 10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	46
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§ 12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华富量子生命力混合型证券投资基金
基金简称	华富量子生命力混合
基金主代码	410009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 4 月 1 日
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	42,583,959.77 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要采用数量化投资方法，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在进行资产配置时，主要根据基金管理人开发的“估值驱动战略资产配置模型”，通过对市场未来 1-3 个月整体估值水平进行预测，实现基金在股票、债券及现金之间的合理配置。模型从市场估值的驱动因素出发，通过寻找与市场走势相关性最大的因子组合，构建市场趋势预测模型。该因子库包括的驱动因子包括但不限于：经济面因子、供求面因子、政策面因子、估值面因子、情绪面因子、盈利面因子。模型结果最终汇总为一个综合的配置指标，通过对市场未来走势的预测结果，调整基金在各类资产之间的配置比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

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		华富基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	满志弘	李帅帅
	联系电话	021-68886996	0755-25878287
	电子邮箱	manzh@hffund.com	LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-700-8001	95511-3
传真		021-68887997	0755-82080387
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区栖霞路 26 弄 1 号 3 层、4 层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		上海市浦东新区栖霞路 18 号陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼	深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码		200120	518001
法定代表人		赵万里	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.hffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华富基金管理有限公司	上海市浦东新区栖霞路 18 号 陆家嘴富汇大厦 A 座 3 楼、5 楼

§ 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(2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	7,583,438.31
本期利润	11,784,874.25
加权平均基金份额本期利润	0.2383
本期加权平均净值利润率	22.63%
本期基金份额净值增长率	26.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	4,888,737.79
期末可供分配基金份额利润	0.1148
期末基金资产净值	50,739,932.93
期末基金份额净值	1.1915
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	29.66%

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) 以上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（例如，开放式基金的申购赎回费等），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，表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日。

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

过去一个月	12.49%	0.85%	5.49%	0.67%	7.00%	0.18%
过去三个月	29.51%	1.22%	9.52%	0.67%	19.99%	0.55%
过去六个月	26.47%	1.89%	2.14%	1.13%	24.33%	0.76%
过去一年	45.31%	1.47%	8.37%	0.91%	36.94%	0.56%
过去三年	27.48%	1.24%	15.70%	0.94%	11.78%	0.30%
自基金合同生效起至今	29.66%	1.71%	41.43%	1.08%	-11.77%	0.63%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

华富量子生命力混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据《华富量子生命力混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金股票投资占基金资产的比例为 60%-95%，债券、货币市场工具以及国家证券监管机构允许基金投资的其它金融工具占基金资产的 0%-40%，权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%，基金保留的现金以及投资于到期日

一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期为 2011 年 4 月 1 日到 2011 年 10 月 1 日，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内，本基金严格执行了《华富量子生命力混合型证券投资基金基金合同》的规定。

§ 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

基金管理人华富基金管理有限公司于 2004 年 3 月 29 日经中国证监会证监基金字[2004]47 号文核准开业，4 月 19 日在上海正式注册成立。注册资本 2.5 亿元，公司股东为华安证券股份有限公司、安徽省信用担保集团有限公司和合肥兴泰金融控股（集团）有限公司。截止 2020 年 6 月 30 日，本基金管理人管理了华富竞争力优选混合型证券投资基金、华富货币市场基金、华富成长趋势混合型证券投资基金、华富收益增强债券型证券投资基金、华富策略精选灵活配置混合型证券投资基金、华富价值增长灵活配置混合型证券投资基金、华富中证 100 指数证券投资基金、华富强化回报债券型证券投资基金、华富量子生命力混合型证券投资基金、华富中小板指数增强型证券投资基金、华富安鑫债券型证券投资基金、华富灵活配置混合型证券投资基金、华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金、华富恒稳纯债债券型证券投资基金、华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金、华富永鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、华富恒利债券型证券投资基金、华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金、华富安享债券型证券投资基金、华富安福债券型证券投资基金、华富益鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富华鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富弘鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金、华富天益货币市场基金、华富天盈货币市场基金、华富产业升级灵活配置混合型证券投资基金、华富恒富 18 个月定期开放债券型证券投资基金、华富星玉衡一年定期开放混合型证券投资基金、华富富瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华富可转债债券型证券投资基金、华富恒盛纯债债券型证券投资基金、华富中证 5 年恒定久期国开债指数型证券投资基金、华富恒欣纯债债券型证券投资基金、华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华富科技动能混合型证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金、华富中债-0-5 年中高等级信用债收益平衡指数证券投资基金、华富中证人工智能产业交易型开放式指数证券投资基金共四十只基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理	证券从	说明
----	----	-----------	-----	----

		(助理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
龚炜	华富竞争力优选混合型基金经理、华富科技动能混合型证券投资基金基金经理、公司公募投资决策委员会主席、公司副总经理	2017 年 9 月 12 日	2020 年 2 月 27 日	16 年	安徽财经大学金融学硕士，研究生学历。历任湘财证券有限责任公司研究发展部行业研究员、中国证监会安徽监管局机构处科员、天治基金管理有限公司研究发展部行业研究员、投资管理部基金经理助理、天治创新先锋股票型基金和天治成长精选股票型基金的基金经理、权益投资部总监，2012 年 9 月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展部金融工程研究员、公司投研副总监、基金投资部总监、投研总监、公司总经理助理，2014 年 8 月 7 日至 2015 年 2 月 11 日任华富灵活配置混合型基金经理，2018 年 7 月 27 日至 2018 年 12 月 21 日任华富元鑫灵活配置混合型基金经理，2012 年 12 月 21 日至 2019 年 7 月 17 日任华富成长趋势混合型基金经理。2017 年 9 月 12 日至 2020 年 2 月 27 日任华富量子生命力混合型基金经理，2014 年 10 月 31 日至 2020 年 2 月 27 日任华富智慧城市灵活配置混合型基金经理，2015 年 2 月 4 日至 2020 年 2 月 27 日任华富国泰民安灵活配置混合型基金经理，2017 年 5 月 9 日至 2020 年 2 月 27 日任华富物联世界灵活配置混合型基金经理，2017 年 5 月 9 日至 2020 年 2 月 27 日任华富天鑫灵活配置混合型基金经理，2017 年 5 月 9 日至 2020 年 2 月 27 日任华富灵活配置混合型基金经理。
郦彬	华富量子生命力混合型基金经理，基金投资部副总监	2019 年 6 月 10 日	-	15 年	复旦大学金融学博士，博士研究生学历。曾任中国国际金融股份有限公司策略分析师、宏源证券股份有限公司首席策略分析师、中信证券股份有限公司首席策略分析师、国信证券股份有限公司首席策略分析师，2017 年 4 月加入华富基金管理有限公司，曾任研究发展部总监。

注：这里的任职日期指公司作出决定之日。证券从业年限的计算标准上，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

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》及相关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，基金运作合法合规，不存在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

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求，结合实际情况，制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中，实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价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% 的情形。

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

展望下半年，新冠肺炎疫情对经济的负面冲击逐步消退，国内经济步入正常修复的通道，中国作为最先走出疫情困扰，率先复工复产的经济体，经济基本面最为扎实。A 股作为中国经济最具代表性的资产具备配置价值，加上人民币汇率预期趋于稳定，对全球投资人而言都具有足够的吸引力，而海外疫情影响仍有焦灼反复之势，各国为了应对疫情采取的不同宽松程度的货币政策很难在下半年看到转变的迹象，货币宽松的局面将持续，进一步推升了金融资产的价格泡沫。

下半年的风险在于，货币宽松的局面下，当全市场预期形成一致的情况下，以金融、房地产、周期品等低估值滞涨板块出现快速补涨，带动市场指数快速上升。股价、房价等金融资产价格出现快速泡沫化的情况下，资金快速脱实入虚的状况并不利于宏观经济的修复，货币政策出现明显回撤，市场牛市预期将面临较大的挑战。

未来我们将依然在遵循量化选股的基本投资方法基础上，适当增加行业及风格的主动选择配置的因素，加强了对个股的研究，以规避市场不利状况下的波动风险，不断优化我们的投资组合，为投资者提供更稳健增长的收益。我们更看重的是资产的回报率，业绩成长性和确定性必然是最

重要的筛选条件。

从行业配置角度来看，上半年重点配置的医药、消费和科技板块依然是我们未来配置的主要方向。我们首先看中的是行业景气度持续提升、政府政策重点支持的产业，例如目前市场普遍看好的半导体及芯片产业、医疗信息化、光通信、消费电子设备、氢能源运用等等；医药板块上半年涨幅较大，未来从绝对配置权重上可能会考虑降低，但是作为未来成长性稳定的长期赛道，我们仍然会维持相当数量的配置比例，例如疫苗、眼科相关、CXO、医疗检测等子行业值得关注。随着下半年经济复苏进程，我们也会增加部分低估值但行业景气度在提升的周期龙头个股进行配置，包括化工、建材、金属材料、机械等周期性成长股。最后，我们继续看好水电、城市环卫服务等领域的龙头公司，因为他们兼具高现金流和资产扩张的特征。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金基金合同 2011 年 4 月 1 日生效，截止 2020 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.1915 元，累计份额净值为 1.2915 元。本报告期，本基金份额净值增长率为 26.47%，同期业绩比较基准收益率为 2.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年上半年，新冠疫情先后在国内外爆发，整个宏观经济环境主线为公共卫生危机与疫情冲击后的复工复产。由于疫情在春节期间爆发升温，导致整个 2 月国内生产接近停滞，2 月制造业 PMI 和非制造业 PMI 分别 35.7 和 29.6，创了有记录以来新低，前 2 个月的工业增加值、社会消费品零售以及固定资产投资均负增长逾 20%。随着三月国内疫情控制较为有效且复工逐渐爬坡，生产恢复情况较好，3 月制造业和非制造业 PMI 均回到 50 以上，一季度实际 GDP 同比录得-6.8%，为有数据以来首次负增长。进入二季度，整个宏观经济呈现从疫情冲击中爬坡态势，4、5、6 月制造业 PMI 分别录得 50.8%、50.4%以及 50.9%，基本完成疫情 v 型冲击的修复，二季度实际 GDP 同比录得+3.2%，回到正增长区间。生产端基本已经回到疫情之前的水平，4、5、6 月的工业增加值持续提速、固定资产投资也呈现单月正增长，发电耗煤量回到去年同期水平以上，需求端恢复相对较慢，但也结构上呈现积极的一面，房地产为代表的可选消费，日用消费品、消费电子产品等行业已经重回增长区间，而主要拖累总体消费增速的主要是旅游消费和餐饮消费，因此需求端也并不用太过悲观。外需方面，今年贸易顺差走阔、出口对于 GDP 正向拉动，主要原因在于“衰退式顺差”以及救灾物资。随着二季度末 PMI 数据显示出企业订单持续向好、库存有序去化、工业品原材料价格回升等积极迹象，经济逐渐进入弱复苏阶段。

货币信用环境方面，在信贷扩张、债券融资宽松和地方政府专项债下的共振作用下，社会融

资余额增速持续高增，上半年新增社融融资规模逾 20 万亿，同时央行上半年累计下调公开市场操作利率 30BP，整体货币政策维持宽松。下半年预计政策面呈现“宽财政、稳货币”的导向。

海外方面，上半年疫情的加剧成为海外经济主线，二季度中后期各国陆续复工复产，但美国等地区仍有疫情反复迹象。此外，疫情对于经济造成压力的同时，民粹主义迹象也进一步显露，各国贸易摩擦也一直未平息。下半年美国临近大选，中美两国摩擦博弈预计难以平复。

2020 年上半年，沪深 300 指数累计上涨 1.64%，创业板指累计上涨 35.6%，价值风格和成长风格的行业和个股股价表现迥异。从行业层面看，相对表现最好的三个行业为医药、消费者服务、食品饮料，表现最差的三个行业为石油石化、煤炭、银行。

量子生命力主要遵循的是量化选股的投资方法，适当辅助了从行业与公司基本面角度出发的主动行业配置和选股策略。本基金上半年持仓中重点配置行业包括医药、科技、新能源汽车和公用事业相关板块等。医药行业是为数不多增长确定性较高的行业之一，符合高 ROE 高成长量化策略的选股结果，我们重点选择了原料药、疫苗、眼科相关、CXO、医疗检测等子行业领域的龙头公司进行配置。我们还看好科技板块，在传统经济增速放缓的背景下，科技板块的高成长性能够给组合提供超额收益，我们选取了半导体及芯片、医疗信息化、光通信、苹果链消费电子等领域进行配置。另外，我们还对氢能源运用、水电、城市环卫服务等具备估值成长高性价比的板块有一定的配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为了有效控制基金估值流程，按照相关法律法规的规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度和流程。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，保证估值未被歪曲以免对基金持有人产生不利影响。公司估值委员会主席为公司总经理，成员包括总经理、副总经理、运作保障部负责人、监察稽核部负责人以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会所有相关人员均具有丰富的行业分析经验和会计核算经验等证券投资基金行业从业经验和专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《华富量子生命力混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本期利润为 11,784,874.25 元，期末可供分配利润为 4,888,737.79 元。本报告期共实施一次利润分配，分配金额为 5,541,781.11 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

从 2020 年 03 月 23 日起至 2020 年 06 月 23 日，本基金基金资产净值存在连续六十个工作日低于 5000 万元的情形。本基金管理人根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》，积极采取了相关措施，并严格按照有关法规的要求对本基金进行监控和操作，2020 年 06 月 24 日至本报告期末（2020 年 06 月 30 日）基金资产净值已高于 5000 万元。

本报告期内，本基金不存在连续二十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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华富量子生命力混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,478,446.61	13,400,662.55
结算备付金		142,430.20	37,899.46
存出保证金		83,753.87	44,031.70
交易性金融资产	6.4.7.2	40,159,440.44	44,619,253.84
其中：股票投资		38,876,080.44	44,306,691.84

基金投资		-	-
债券投资		1,283,360.00	312,562.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,062,563.06	1,502,083.54
应收利息	6.4.7.5	4,532.05	5,853.63
应收股利		-	-
应收申购款		26,583.14	8,529.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		51,957,749.37	59,618,314.56
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019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		-	-
应付证券清算款		833,559.78	1,424,555.03
应付赎回款		130,980.59	15,315.51
应付管理人报酬		59,536.41	72,404.52
应付托管费		9,922.75	12,067.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	80,911.92	54,898.80
应交税费		161.36	72.57
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	102,743.63	90,418.15
负债合计		1,217,816.44	1,669,732.01
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	42,583,959.77	56,524,786.69
未分配利润	6.4.7.10	8,155,973.16	1,423,795.86
所有者权益合计		50,739,932.93	57,948,582.55
负债和所有者权益总计		51,957,749.37	59,618,314.56

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1915 元，基金份额总额 42583959.77 份。

后附报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体：华富量子生命力混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年1月1日至2020年 6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
一、收入		12,709,931.81	7,886,488.27
1. 利息收入		62,685.13	96,558.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11	59,982.65	93,146.19
债券利息收入		2,702.48	3,412.50
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,439,817.33	151,040.28
其中：股票投资收益	6.4.7.12	8,208,018.82	-54,422.55
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	115,621.39	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	116,177.12	205,462.83
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,201,435.94	7,636,949.18
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	5,993.41	1,940.12
减：二、费用		925,057.56	643,883.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	389,122.22	368,055.11
2. 托管费	6.4.10.2.2	64,853.69	61,342.56
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	418,858.16	165,709.67
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		9.51	0.30
7. 其他费用	6.4.7.20	52,213.98	48,775.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,784,874.25	7,242,604.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		11,784,874.25	7,242,604.91

号填列)			
------	--	--	--

注：后附表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华富量子生命力混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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）	56,524,786.69	1,423,795.86	57,948,582.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,784,874.25	11,784,874.25
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）	-13,940,826.92	489,084.16	-13,451,742.76
其中：1. 基金申购款	4,587,159.56	324,929.84	4,912,089.40
2. 基金赎回款	-18,527,986.48	164,154.32	-18,363,832.16
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）	-	-5,541,781.11	-5,541,781.11
五、期末所有者权益（基金净值）	42,583,959.77	8,155,973.16	50,739,932.93
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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）	58,259,855.07	-13,481,634.44	44,778,220.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,242,604.91	7,242,604.91

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）	-1,209,110.18	95,791.24	-1,113,318.94
其中：1. 基金申购款	1,397,702.27	-169,806.96	1,227,895.31
2. 基金赎回款	-2,606,812.45	265,598.20	-2,341,214.25
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）	57,050,744.89	-6,143,238.29	50,907,506.60

注：后附报表附注为本财务报表的组成部分。

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：

赵万里

曹华玮

邵恒

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华富量子生命力混合型证券投资基金（以下简称本基金或基金）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）（证监基金字【2010】1585号）核准，基金合同于2011年4月1日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集资金到位情况经天健正信会计师事务所审验，并出具《验资报告》（天健正信验（2011）综字第020032号）。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《华富量子生命力混合型证券投资基金基金合同》的规定，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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他产品，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为编制基础。

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，同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

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

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。

6.4.5 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》(财税〔2008〕1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〔2012〕85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〕101号)、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税〔2016〕36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〕46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〔2016〕140号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税〔2017〕56号)、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》(财税〔2016〕70号)、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税〔2017〕90号)及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(一) 自 2018 年 1 月 1 日起，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。

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收企业所得税；

(三) 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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。

主要税种及税率列示如下：

税 种	计 税 依 据	税 率
增值税	金融服务销售额	3%

城市维护建设税 应缴流转税税额 7%

教育费附加 应缴流转税税额 3%

地方教育附加[注] 应缴流转税税额 1%、2%

[注]：接地方税务局通知，自 2019 年 7 月 1 日起调整地方教育附加税税率，由原来的 1%调整为 2%。

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	10,478,446.61
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	10,478,446.61

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	31,384,074.40	38,876,080.44	7,492,006.04
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,430,397.08	1,283,360.00
	银行间市场	-	-
	-	-	-
	合计	1,430,397.08	1,283,360.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	32,814,471.48	40,159,440.44	7,344,968.96

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

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

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	1,626.35
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	64.10
应收债券利息	2,803.73
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	0.17
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	37.70
合计	4,532.05

注：本表列示的其他为应收权证保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	80,911.92
银行间市场应付交易费用	-
-	-
合计	80,911.92

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	145.48
应付证券出借违约金	-
预提费用	-
应付审计费	12,432.42
应付信息披露费	89,781.56
其他	384.17
合计	102,743.63

注：其他所列金额为应缴纳股息红利税款。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	56,524,786.69	56,524,786.69
本期申购	4,587,159.56	4,587,159.56
本期赎回（以“-”号填列）	-18,527,986.48	-18,527,986.48
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	42,583,959.77	42,583,959.77

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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
上年度末	3,628,557.43	-2,204,761.57	1,423,795.86
本期利润	7,583,438.31	4,201,435.94	11,784,874.25
本期基金份额交易产生的变动数	-781,476.84	1,270,561.00	489,084.16
其中：基金申购款	323,044.82	1,885.02	324,929.84
基金赎回款	-1,104,521.66	1,268,675.98	164,154.32
本期已分配利润	-5,541,781.11	-	-5,541,781.11
本期末	4,888,737.79	3,267,235.37	8,155,973.16

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	57,783.73
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,641.40
其他	557.52
合计	59,982.65

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,208,018.82
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	8,208,018.82

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	145,224,635.76
减：卖出股票成本总额	137,016,616.94
买卖股票差价收入	8,208,018.82

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	115,621.39
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	115,621.39

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,201,613.47
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,083,436.35
减：应收利息总额	2,555.73
买卖债券差价收入	115,621.39

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	116,177.12
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	116,177.12

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	4,201,435.94

股票投资	4,372,035.02
债券投资	-170,599.08
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
-	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	4,201,435.94

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	5,984.10
基金转换费收入	9.31
合计	5,993.41

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	418,858.16
银行间市场交易费用	-
-	-
合计	418,858.16

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	12,432.42
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
-	-
合计	52,213.98

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

无

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
平安银行股份有限公司（“平安银行股份有限公司”）	基金托管人、基金销售机构
华安证券股份有限公司（“华安证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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 (%)
华安证券	271,877,831.93	100.00	108,550,809.97	99.03

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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 (%)
华安证券	5,386,847.25	100.00	3,027,388.90	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期和上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

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 2020年1月1日至2020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 (%)
华安证券	249,452.26	100.00	80,911.92	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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 (%)
华安证券	99,926.55	99.04	51,369.17	100.00

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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	389,122.22	368,055.11
其中：支付销售机构的客户维护费	75,786.41	74,155.37

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.50%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	64,853.69	61,342.56

注：基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

本期

2020年1月1日至2020年6月30日

银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

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

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务。

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金合同生效日(2011 年 4 月 1 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	40,612,151.56	40,612,151.56
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00

报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	11,000,000.00	0.00
报告期末持有的基金份额	29,612,151.56	40,612,151.56
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	69.5400%	71.1900%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求，申购买入总份额里包含红利再投、转换入份额。

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

注：本基金本报告期和上年度可比期间基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
平安银行股份有限公司	10,478,446.61	57,783.73	9,452,498.61	92,154.60

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2020年2月25日	-	2020年2月25日	1.0000	5,307,889.81	233,891.30	5,541,781.11	-
合计	-	-	-	1.0000	5,307,889.81	233,891.30	5,541,781.11	-

6.4.12 期末(2020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	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
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	5.94	5.94	675	4,009.50	4,009.50	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股流通受限	10.01	10.01	714	7,147.14	7,147.14	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流通受限	17.63	17.63	329	5,800.27	5,800.27	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
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	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.4 受限证券类别：权证										
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：份)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：实际可流通日以该证券公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金在日常经营活动中面临的的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人已建立董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

董事会下设风险管理委员会，负责对公司风险管理制度进行审查并提供咨询和建议。总经理下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和监控。公司设督察长，组织、指导公司监察稽核工作，监督检查基金及公司运作的合法合规情况和公司的内部风险控制情况。公司设有独立的监察稽核部门，监察稽核部有权对公司各部门内部风险控制制度的建立和落实情况进行检查，对公司的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进意见，上报总经理，通报督察长。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有信用债券

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单

6.4.13.2.4 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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	0.00	278,562.00
AAA 以下	1,283,360.00	34,000.00
其中低于 AA 以下	1,283,360.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	1,283,360.00	312,562.00

注：数据按市值计算，未包括应收利息。列示对象包括期末本基金所投资的所有信用产品，具体包括短期融资券、公司债、企业债、可转债、公募可交换债、商业银行债、非银行金融债等债券基金可投资的信用产品，不包括国债、地方政府债、政策性金融债等利率债产品。短期信用产品的长期信用评级指主体评级，长期信用产品的长期信用评级指债券评级。信用等级按期末评级结果列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可银行间同业市场交易。因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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。本基金所持有的金融负债的合同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。

6.4.13.4 本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，对流动性指标进行持续的监测和分析。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，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	10,478,446.61	-	-	-	-	-	10,478,446.61
结算备付金	142,430.20	-	-	-	-	-	142,430.20
存出保证金	83,753.87	-	-	-	-	-	83,753.87
交易性金融资产	-	-	1,283,360.00	-	-	38,876,080.44	40,159,440.44

买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	4,532.05	4,532.05
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	26,583.14	26,583.14
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,062,563.06	1,062,563.06
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	10,704,630.68	-	1,283,360.00	-	-	39,969,758.69	51,957,749.37
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	130,980.59	130,980.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	59,536.41	59,536.41
应付托管费	-	-	-	-	-	9,922.75	9,922.75
应付证券清算款	-	-	-	-	-	833,559.78	833,559.78
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	80,911.92	80,911.92
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	161.36	161.36
其他负债	-	-	-	-	-	102,743.63	102,743.63
负债总计	-	-	-	-	-	1,217,816.44	1,217,816.44
利率敏感度缺口	10,704,630.68	-	1,283,360.00	-	-	38,751,942.25	50,739,932.93
上年度末							
2019年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	13,400,662.55	-	-	-	-	-	13,400,662.55
结算备付金	37,899.46	-	-	-	-	-	37,899.46
存出保证金	44,031.70	-	-	-	-	-	44,031.70
交易性金融资产	-	-	312,562.00	-	-	44,306,691.84	44,619,253.84
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-

应收利息	-	-	-	-	5,853.63	5,853.63
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	8,529.84	8,529.84
应收证券清算款	-	-	-	-	1,502,083.54	1,502,083.54
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,482,593.71	-	312,562.00	-	45,823,158.85	59,618,314.56
负债	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	15,315.51	15,315.51
应付管理人报酬	-	-	-	-	72,404.52	72,404.52
应付托管费	-	-	-	-	12,067.43	12,067.43
应付证券清算款	-	-	-	-	1,424,555.03	1,424,555.03
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	54,898.80	54,898.80
应付利息	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	72.57	72.57
其他负债	-	-	-	-	90,418.15	90,418.15
负债总计	-	-	-	-	1,669,732.01	1,669,732.01
利率敏感度缺口	13,482,593.71	-	312,562.00	-	44,153,426.84	57,948,582.55

注：本表按照金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者作为期限分类标准。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除利率外其他市场变量保持不变		
	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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	市场利率下降 25 基点	13,988.62	4,295.33
	市场利率上升 25 基点	-13,988.62	-4,268.86

6.4.13.4.2 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其他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，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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	38,876,080.44	76.62	44,306,691.84	76.46
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,283,360.00	2.53	312,562.00	0.54
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	40,159,440.44	79.15	44,619,253.84	77.00

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数外其他市场变量保持不变		
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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）	
分析	沪深 300 指数上升百分之五	1,804,632.49	1,632,276.28

	沪深 300 指数下 降百分之五	-1,804,632.49	-1,632,276.28
--	---------------------	---------------	---------------

6.4.13.4.3 采用风险价值法管理风险

假设	1. 置信区间 (95%)		
	2. 观察期 (1 年)		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末 (2020 年 6 月 30 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
	合计	13,036,668.64	13261842.96

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 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	38,876,080.44	74.82
	其中: 股票	38,876,080.44	74.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,283,360.00	2.47
	其中: 债券	1,283,360.00	2.47
	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	10,620,876.81	20.44
-	-	-	-
8	其他各项资产	1,177,432.12	2.27
9	合计	51,957,749.37	100.00

注: 本表列示的其他各项资产详见 7.12.3 期末其他各项资产构成。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	481,600.00	0.95
C	制造业	27,854,105.34	54.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,846,463.36	5.61
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,087,500.00	2.14
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,687,311.74	7.27
J	金融业	-	-
K	房地产业	560,500.00	1.10
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,839,600.00	3.63
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	519,000.00	1.02
S	综合	-	-
	合计	38,876,080.44	76.62

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603158	腾龙股份	180,000	4,055,400.00	7.99
2	600900	长江电力	150,000	2,841,000.00	5.60
3	603986	兆易创新	10,000	2,359,100.00	4.65
4	002507	涪陵榨菜	60,000	2,160,600.00	4.26
5	300363	博腾股份	60,000	2,073,600.00	4.09
6	002975	博杰股份	11,000	1,966,470.00	3.88
7	300815	玉禾田	15,000	1,839,600.00	3.63

8	300529	健帆生物	25,000	1,737,500.00	3.42
9	603658	安图生物	10,000	1,624,400.00	3.20
10	300639	凯普生物	30,000	1,557,900.00	3.07
11	300122	智飞生物	15,000	1,502,250.00	2.96
12	300253	卫宁健康	65,000	1,491,100.00	2.94
13	300548	博创科技	24,000	1,435,200.00	2.83
14	300595	欧普康视	20,000	1,386,800.00	2.73
15	601238	广汽集团	150,000	1,350,000.00	2.66
16	603520	司太立	16,000	1,344,960.00	2.65
17	000661	长春高新	3,000	1,305,900.00	2.57
18	002439	启明星辰	30,000	1,262,100.00	2.49
19	000032	深桑达A	50,000	1,087,500.00	2.14
20	603583	捷昌驱动	15,000	1,025,700.00	2.02
21	300451	创业慧康	50,000	924,500.00	1.82
22	600276	恒瑞医药	10,000	923,000.00	1.82
23	600663	陆家嘴	50,000	560,500.00	1.10
24	300144	宋城演艺	30,000	519,000.00	1.02
25	000426	兴业矿业	70,000	481,600.00	0.95
26	300842	帝科股份	319	12,989.68	0.03
27	603087	甘李药业	129	12,938.70	0.03
28	300839	博汇股份	352	8,240.32	0.02
29	300843	胜蓝股份	714	7,147.14	0.01
30	300845	捷安高科	329	5,800.27	0.01
31	600956	新天绿能	1,084	5,463.36	0.01
32	300840	酷特智能	675	4,009.50	0.01
33	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.01

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	603158	腾龙股份	4,356,871.00	7.52
2	300601	康泰生物	3,645,898.00	6.29
3	300815	玉禾田	3,377,540.40	5.83
4	300136	信维通信	3,322,116.00	5.73
5	002174	游族网络	3,206,519.00	5.53
6	300709	精研科技	2,902,310.00	5.01
7	600114	东睦股份	2,636,082.00	4.55
8	600900	长江电力	2,616,500.00	4.52
9	300595	欧普康视	2,585,480.00	4.46
10	300529	健帆生物	2,368,665.00	4.09
11	002489	浙江永强	2,284,798.00	3.94

12	002507	涪陵榨菜	2,282,710.30	3.94
13	600519	贵州茅台	2,188,435.00	3.78
14	002518	科士达	2,156,166.00	3.72
15	002912	中新赛克	2,055,000.00	3.55
16	300347	泰格医药	1,921,180.00	3.32
17	002475	立讯精密	1,920,515.00	3.31
18	300054	鼎龙股份	1,870,413.00	3.23
19	002352	顺丰控股	1,790,679.97	3.09
20	002036	联创电子	1,786,162.00	3.08
21	000977	浪潮信息	1,774,363.88	3.06
22	002241	歌尔股份	1,769,526.00	3.05
23	002080	中材科技	1,718,433.00	2.97
24	002126	银轮股份	1,669,900.00	2.88
25	688111	金山办公	1,650,179.42	2.85
26	300363	博腾股份	1,608,496.00	2.78
27	300559	佳发教育	1,591,338.00	2.75
28	002970	锐明技术	1,590,540.00	2.74
29	601238	广汽集团	1,574,400.00	2.72
30	603658	安图生物	1,506,810.00	2.60
31	601966	玲珑轮胎	1,480,040.00	2.55
32	000661	长春高新	1,457,339.00	2.51
33	300781	因赛集团	1,438,969.00	2.48
34	603520	司太立	1,436,252.00	2.48
35	000858	五粮液	1,420,393.00	2.45
36	300750	宁德时代	1,389,299.00	2.40
37	300357	我武生物	1,382,400.00	2.39
38	603259	药明康德	1,381,870.00	2.38
39	002975	博杰股份	1,380,404.00	2.38
40	300118	东方日升	1,309,700.00	2.26
41	300639	凯普生物	1,250,608.00	2.16
42	300122	智飞生物	1,239,850.00	2.14
43	300548	博创科技	1,239,600.00	2.14
44	600233	圆通速递	1,237,163.00	2.13
45	603986	兆易创新	1,231,380.00	2.12
46	002402	和而泰	1,197,600.00	2.07
47	002439	启明星辰	1,196,456.00	2.06
48	002250	联化科技	1,192,900.00	2.06

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300601	康泰生物	4,294,393.11	7.41
2	600273	嘉化能源	3,184,393.00	5.50
3	002422	科伦药业	2,932,360.38	5.06
4	300136	信维通信	2,866,279.24	4.95
5	600030	中信证券	2,809,617.00	4.85
6	002174	游族网络	2,785,090.00	4.81
7	002594	比亚迪	2,725,256.09	4.70
8	000100	TCL 科技	2,643,000.00	4.56
9	300595	欧普康视	2,620,851.00	4.52
10	688111	金山办公	2,570,394.31	4.44
11	002912	中新赛克	2,470,035.00	4.26
12	002489	浙江永强	2,463,463.00	4.25
13	300451	创业慧康	2,395,868.48	4.13
14	300724	捷佳伟创	2,230,335.00	3.85
15	600519	贵州茅台	2,161,500.00	3.73
16	002475	立讯精密	2,050,984.00	3.54
17	300054	鼎龙股份	2,036,742.00	3.51
18	300709	精研科技	2,032,903.00	3.51
19	002518	科士达	2,015,505.00	3.48
20	300347	泰格医药	2,004,852.00	3.46
21	601688	华泰证券	2,002,549.00	3.46
22	300815	玉禾田	1,984,890.56	3.43
23	600276	恒瑞医药	1,931,404.00	3.33
24	002648	卫星石化	1,929,373.17	3.33
25	600114	东睦股份	1,894,549.00	3.27
26	600000	浦发银行	1,850,634.10	3.19
27	000858	五粮液	1,841,510.00	3.18
28	002507	涪陵榨菜	1,839,020.76	3.17
29	600201	生物股份	1,748,700.00	3.02
30	600760	中航沈飞	1,742,017.00	3.01
31	300750	宁德时代	1,741,411.00	3.01
32	002352	顺丰控股	1,739,390.00	3.00
33	002080	中材科技	1,721,600.00	2.97
34	300253	卫宁健康	1,687,879.50	2.91
35	000977	浪潮信息	1,654,673.56	2.86
36	300559	佳发教育	1,640,161.37	2.83
37	300685	艾德生物	1,625,070.10	2.80
38	603939	益丰药房	1,582,498.00	2.73
39	603986	兆易创新	1,580,277.00	2.73

40	600195	中牧股份	1,571,507.00	2.71
41	600837	海通证券	1,556,517.00	2.69
42	601601	中国太保	1,545,377.00	2.67
43	601966	玲珑轮胎	1,540,569.00	2.66
44	603259	药明康德	1,531,039.00	2.64
45	002036	联创电子	1,522,811.00	2.63
46	300118	东方日升	1,514,409.02	2.61
47	002142	宁波银行	1,450,000.00	2.50
48	600036	招商银行	1,408,800.00	2.43
49	002402	和而泰	1,372,058.00	2.37
50	002970	锐明技术	1,367,415.00	2.36
51	300357	我武生物	1,316,162.00	2.27
52	002241	歌尔股份	1,278,646.00	2.21
53	600233	圆通速递	1,263,140.00	2.18
54	002126	银轮股份	1,236,488.00	2.13
55	300433	蓝思科技	1,191,740.09	2.06
56	002250	联化科技	1,190,000.00	2.05

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

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	127,213,970.52
卖出股票收入（成交）总额	145,224,635.76

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、配股、债转股及行权等获得的股票。

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）	1,283,360.00	2.53
8	同业存单	-	-
-	-	-	-

9	其他	-	-
10	合计	1,283,360.00	2.53

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	128056	今飞转债	13,000	1,283,360.00	2.53

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本报告期内基金投资的前十名证券中的发行主体包括重庆博腾制药科技股份有限公司。中国证监会重庆监管局于 2020 年 5 月 15 日对重庆博腾制药科技股份有限公司作出了处罚决定。但本基金投资相关证券的投资决策程序符合相关法律、法规的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 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	83,753.87
2	应收证券清算款	1,062,563.06
3	应收股利	-
4	应收利息	4,532.05
5	应收申购款	26,583.14

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	1,177,432.12

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128056	今飞转债	1,283,360.00	2.53

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告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 (%)
1,073	39,686.82	29,612,151.56	69.54	12,971,808.21	30.46

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	1,594,460.14	3.7443

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	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2011 年 4 月 1 日) 基	293,654,904.54
----------------------------	----------------

基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	56,524,786.69
本报告期基金总申购份额	4,587,159.56
减：本报告期基金总赎回份额	18,527,986.48
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	42,583,959.77

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 2020年2月27日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜先生不再担任华富国泰民安灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
- 2020年2月27日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜先生不再担任华富量子生命力混合型证券投资基金基金经理的职务。
- 2020年2月27日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜先生不再担任华富灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
- 2020年2月27日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜先生不再担任华富天鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
- 2020年2月27日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜先生不再担任华富物联世界灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
- 2020年2月27日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，龚炜先生不再担任华富智慧城市灵活配置混合型证券投资基金基金经理的职务。
- 2020年4月21日，华富基金管理有限公司第六届董事会第六次会议审议通过，因工作需要，聘任邵恒先生担任公司副总经理职务。
- 2020年5月11日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作安排，倪莉莎女士不再担任华富天盈货币市场基金基金经理的职务。
- 2020年5月11日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增聘陶祺先生为华富富瑞3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
- 2020年5月11日，经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过，因工作需要，增

聘陶祺先生为华富恒盛纯债债券型证券投资基金基金经理。

11. 2020 年 5 月 11 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作需要, 增聘陶祺先生为华富货币市场基金基金经理。

12. 2020 年 5 月 11 日, 经华富基金管理有限公司总经理办公会议审议通过, 因工作需要, 增聘陶祺先生为华富安兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

13. 2020 年 6 月 28 日, 华富基金管理有限公司第六届董事会第七次会议审议通过, 因工作需要, 章宏韬先生不再担任公司董事长职务, 聘任赵万利先生担任公司董事长。

14. 本基金本报告期内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

基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内, 本基金未有改聘为其审计的会计师事务所情况。

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

本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华安证券	2	271,877,831.93	100.00%	249,452.26	100.00%	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

世纪证券	1	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注：1)根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）， 我公司修订了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序，在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，选择了研究能力强、内部管理规范、信息资讯服务能力强的券商租用了基金专用交易单元。

2)本报告期本基金无席位变化。

3)此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

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	
	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
华安证券	5,386,847.25	100.00%	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

注：债券交易中企业债及可分离债券的成交金额按净价统计，可转债的成交金额按全价统计。

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	《华富基金管理有限公司关于公司住所变更的公告》	中国证监会指定媒介	2020年1月8日
2	《华富基金管理有限公司旗下全部基金2019年第四季度报告提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020年1月21日
3	《华富量子生命力混合型证券投资基金2019年第4季度报告》	中国证监会指定媒介	2020年1月21日
4	《华富量子生命力混合型证券投资基金2019年第4季度报告》	中国证监会指定媒介	2020年1月21日
5	《关于华富量子生命力混合型证券投资基金暂停大额申购、定投及转换转入业务的公告》	中国证监会指定媒介	2020年2月21日
6	《华富量子生命力混合型证券投资基	中国证监会指定媒介	2020年2月24日

	金 2020 年分红公告》		
7	《关于华富量子生命力混合型证券投资基金恢复大额申购、定投及转换转入业务的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 2 月 26 日
8	《华富基金管理有限公司关于旗下部分基金招募说明书（更新）的提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 2 月 29 日
9	《华富量子生命力混合型证券投资基金招募说明书（更新）（摘要）》	中国证监会指定媒介	2020 年 2 月 29 日
10	《华富量子生命力混合型证券投资基金招募说明书（更新）》	中国证监会指定媒介	2020 年 2 月 29 日
11	《华富基金管理有限公司关于基金经理变更的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 2 月 29 日
12	《华富基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 3 月 13 日
13	《华富基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 3 月 26 日
14	《华富基金管理有限公司关于系统暂停服务的通知》	中国证监会指定媒介	2020 年 3 月 28 日
15	《华富基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 4 月 22 日
16	《华富基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第一季度报告提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 4 月 22 日
17	《华富量子生命力混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告》	中国证监会指定媒介	2020 年 4 月 22 日
18	《华富量子生命力混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告》	中国证监会指定媒介	2020 年 4 月 22 日
19	《华富基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年年度报告提示性公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 4 月 29 日
20	《华富量子生命力混合型证券投资基金 2019 年年度报告》	中国证监会指定媒介	2020 年 4 月 29 日
21	《华富量子生命力混合型证券投资基金 2019 年年度报告》	中国证监会指定媒介	2020 年 4 月 29 日
22	《华富基金管理有限公司关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理相关销售业务的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 5 月 8 日
23	《华富基金管理有限公司关于恢复银联支付通道服务的公告》	中国证监会指定媒介	2020 年 6 月 1 日

§ 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	2020.1.1-2020.6.30	40,612,151.56	0.00	11,000,000.00	29,612,151.56	69.54
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
无							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华富量子生命力混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华富量子生命力混合型证券投资基金托管协议》

3、《华富量子生命力混合型证券投资基金招募说明书》

4、报告期内华富量子生命力混合型证券投资基金在指定媒介上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,相关公开披露信息也可以登录基金管理人网站查阅。

华富基金管理有限公司

2020 年 8 月 31 日