

海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金
2022 年年度报告
2022 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：二〇二三年三月三十一日

§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 2023 年 3 月 29 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 2022 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	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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 净资产（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	60
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	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	76

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	77
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	77
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	77
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	77
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	78
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
8.12	投资组合报告附注	78
§9	基金份额持有人信息	79
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	79
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	80
§10	开放式基金份额变动	80
§11	重大事件揭示	81
11.1	基金份额持有人大会决议	81
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	81
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	81
11.4	基金投资策略的改变	81
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	81
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	81
11.6.1	管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	81
11.6.2	托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	82
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	82
11.8	其他重大事件	84
12	影响投资者决策的其他重要信息	86
§13	备查文件目录	88
13.1	备查文件目录	88
13.2	存放地点	88
13.3	查阅方式	88

§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	186,543,320.92 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	59,184,385.64 份	127,358,935.28 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。本基金的股票投资组合比例将根据市场整体估值水平评估系统性风险进行调整。具体而言,本基金将采用沪深 300 指数作为市场代表指数,根据该指数的估值(PE)自发布以来所处的历史水平位置来调整股票资产比例配置。具体策略方面,包括股票投资策略、债券投资策略、杠杆策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率(按估值

	汇率折算) ×20% + 上证国债指数收益率 ×20%
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。本基金将投资港股通标的股票, 需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

注: 本基金于 2021 年 11 月 19 日至 2021 年 12 月 21 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会, 于 2021 年 12 月 22 日表决通过了《关于变更注册海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的议案》。2021 年 12 月 23 日起, 本基金的业绩比较基准变更为沪深 300 指数收益率 ×60% + 恒生指数收益率 (按估值汇率折算) ×20% + 上证国债指数收益率 ×20%。

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	岳冲	郭明
	联系电话	021-38650788	010-66105799
	电子邮箱	chongyue@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		中国(上海)自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京市西城区复兴门内大街 55号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	北京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	http://www.hftfund.com

网址	
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)	上海市浦东新区东育路 588 号 前滩中心 42 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	2022 年		2021 年		2020 年	
	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	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	-16,890,835.97	-47,778,549.94	4,727,907.66	44,391,514.34	6,182,688.49	51,248,657.19
本期利润	-15,381,245.98	-62,105,313.32	1,749,873.65	18,643,079.29	7,334,767.24	65,239,994.70
加权平均基金份额本期利润	-0.1759	-0.3738	0.0934	0.1020	0.4003	0.4572
本期加权平均净值利	-12.38%	-25.82%	5.23%	5.71%	30.20%	33.07%

润率						
本期基金份额净值增长率	-20.10%	-20.73%	7.74%	6.89%	46.16%	45.05%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 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	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	12,021,008.41	23,366,354.83	34,852,862.36	142,728,744.79	8,646,316.88	70,467,540.52
期末可供分配基金份额利润	0.2031	0.1835	0.7337	0.7234	0.4688	0.4724
期末基金资产净值	74,488,024.24	158,098,225.58	87,459,973.23	361,662,242.82	31,519,230.30	255,809,291.99
期末基金份额净值	1.2586	1.2414	1.8411	1.8330	1.7089	1.7148
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 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	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	47.11%	45.30%	84.11%	83.30%	70.89%	71.48%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 海富通量化多因子混合 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	-0.93%	0.97%	4.15%	1.19%	-5.08%	-0.22%
过去六个月	-12.49%	0.93%	-8.68%	0.99%	-3.81%	-0.06%
过去一年	-20.10%	1.16%	-13.64%	1.09%	-6.46%	0.07%
过去三年	25.82%	1.25%	0.17%	0.90%	25.65%	0.35%
自基金合同生效起至今	47.11%	1.19%	7.52%	0.86%	39.59%	0.33%

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	-1.12%	0.97%	4.15%	1.19%	-5.27%	-0.22%
过去六个月	-12.84%	0.93%	-8.68%	0.99%	-4.16%	-0.06%
过去一年	-20.73%	1.16%	-13.64%	1.09%	-7.09%	0.07%
过去三年	22.91%	1.25%	0.17%	0.90%	22.74%	0.35%
自基金合	45.30%	1.20%	7.52%	0.86%	37.78%	0.34%

同生效起 至今						
------------	--	--	--	--	--	--

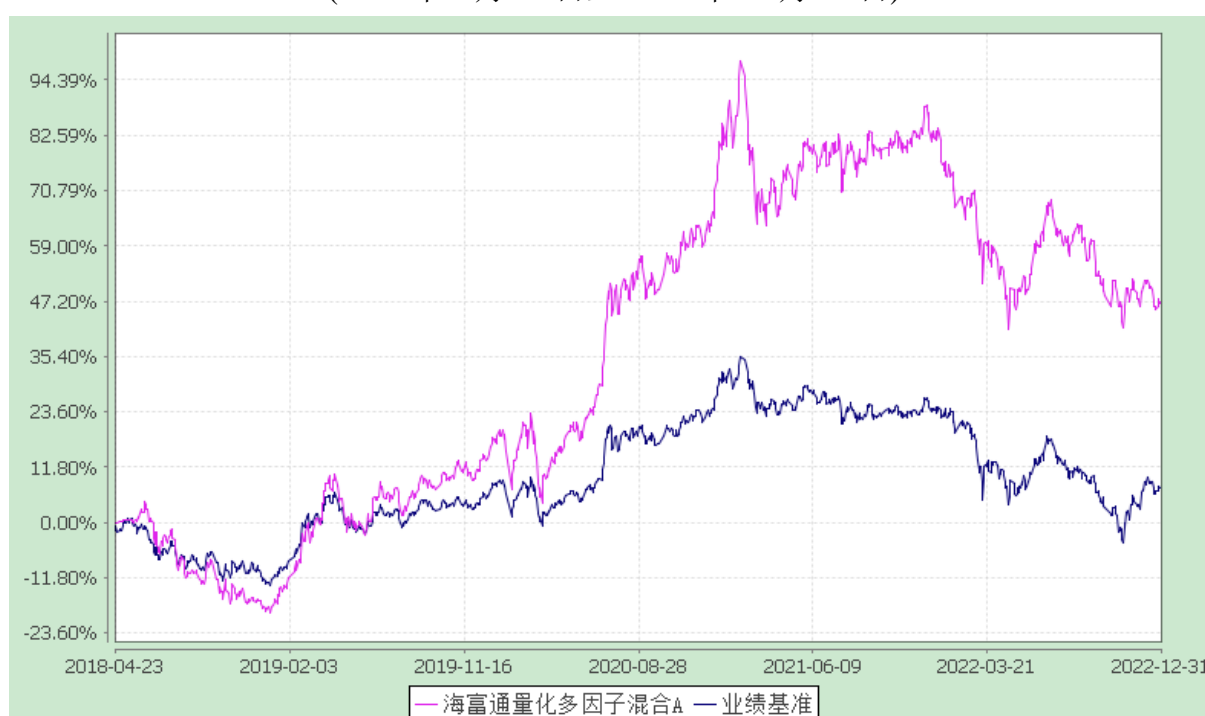
2021 年 12 月 23 日起，本基金的业绩比较基准变更为沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）×20%+上证国债指数收益率×20%。

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

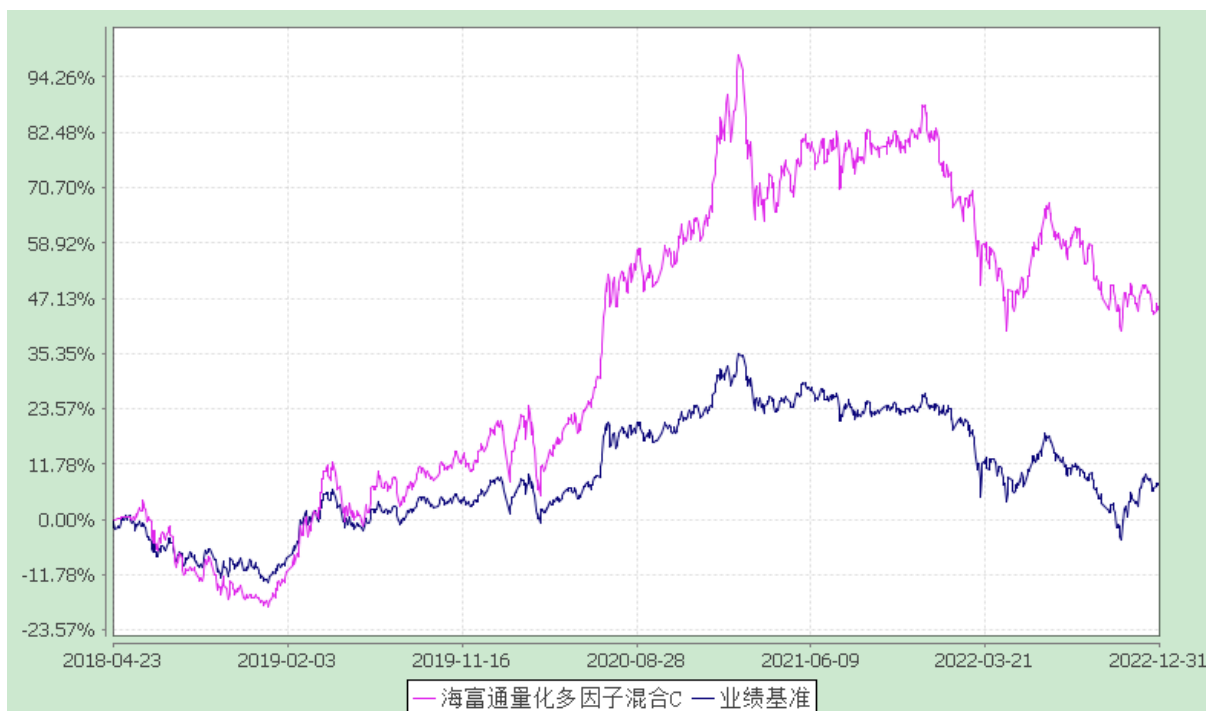
1. 海富通量化多因子混合 A

(2018 年 4 月 23 日至 2022 年 12 月 31 日)



2. 海富通量化多因子混合 C

(2018 年 4 月 23 日至 2022 年 12 月 31 日)



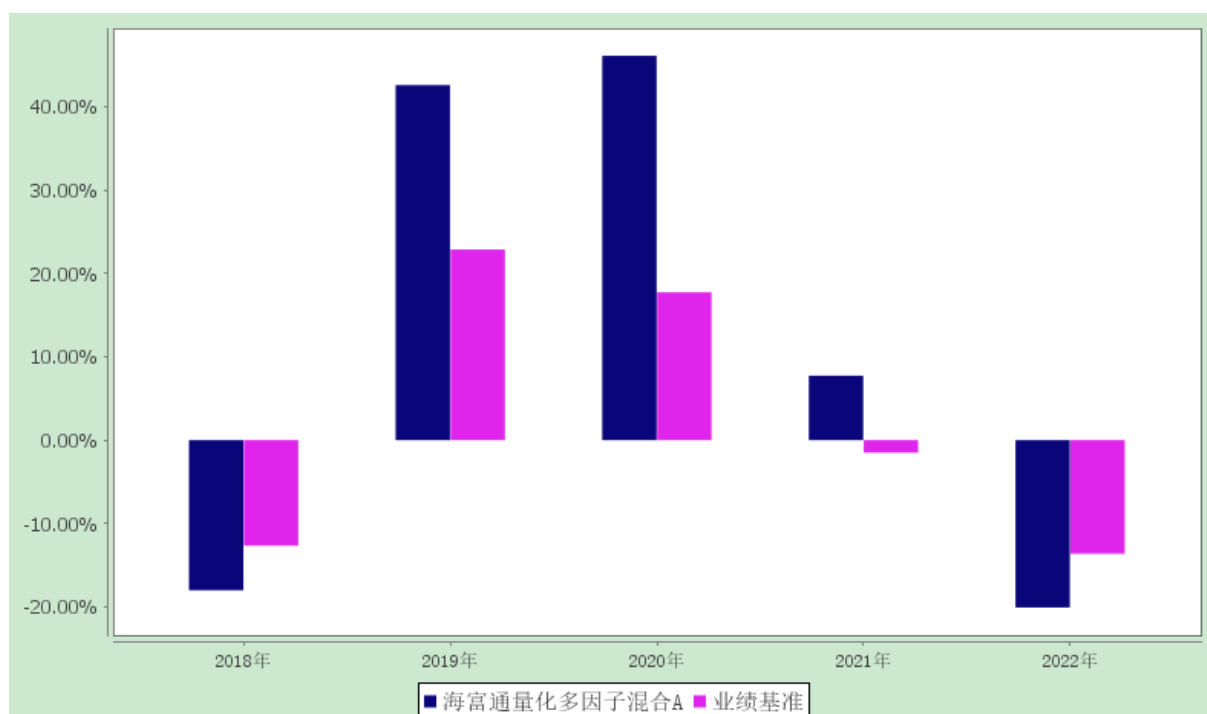
注：本基金合同于 2018 年 4 月 23 日生效，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。2021 年 12 月 23 日起，本基金的业绩比较基准变更为沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（按估值汇率折算）×20%+上证国债指数收益率×20%。

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

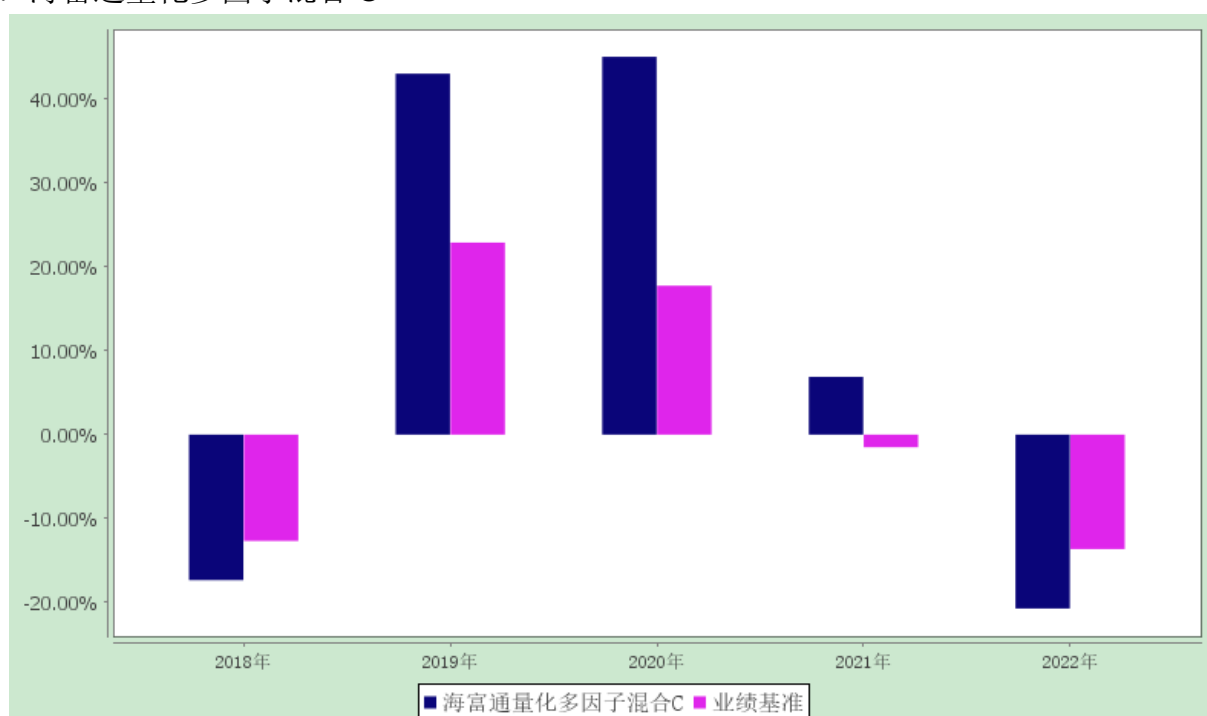
海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

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
2022 年	2.400	18,027,893.49	10,343,678.19	28,371,571.68	-
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	2.400	18,027,893.49	10,343,678.19	28,371,571.68	-

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
2022 年	2.400	31,760,503.91	8,755,052.21	40,515,556.12	-
2021 年	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	2.400	31,760,503.91	8,755,052.21	40,515,556.12	-

§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 2022 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 94 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 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通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、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证长三角领先交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱斌全	本基金的基金经理	2019-10-15	-	15 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2006 年 8 月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交易员。2007 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，历任交易员、高级交易员、量化分析师、投资经理、基金经理助理。2018 年 11 月至 2022 年 8 月任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019 年 10 月至 2022 年 12 月兼任海富通富祥混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通沪深 300 增强（原海富通富睿混合）、海富通量化多因子混合及海富通欣益混合的基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通欣享混合的基金经理。2020 年 10 月至 2022 年 8 月兼任海富通新内需混合基金经理。2022 年 8 月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2022 年 12 月起兼任海富通量化先锋股票、海富通中证 500 增强基金经理。

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，

没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了一级市场和二级市场的所有投资交易管理活动以及公司内部的证券分配，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

因子方面，价值因子 2022 年度表现强于成长因子，市值因子波动较大，我们的组合风格相对均衡，在业绩和估值匹配的公司中寻找投资机会。

回顾本报告期的投资操作，本基金用量化方法构建以沪深 300 为基准的股票组合，同时构建以中证 1000 为基准的辅助增强策略，在波动较大的市场环境下，尽量控制组合的下行风险。

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-20.10%，同期业绩比较基准收

益率为-13.64%，基金净值跑输业绩比较基准 6.46 个百分点。海富通量化多因子混合 C 净值增长率为-20.73%，同期业绩比较基准收益率为-13.64%，基金净值跑输业绩比较基准 7.09 个百分点。报告期内股票市场下跌较多，基金股票仓位较重，导致基金跑输基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济在 2022 年经历了一段时间的低迷，但随着国内需求的逐步恢复，2023 年经济增长有望逐步回升。同时，政府也将继续采取相应财政和货币政策以支持经济增长，消费需求也将逐渐回升。预计未来几年，中国消费市场将保持稳健增长，数字化和智能化的趋势进一步加速，新一代人工智能有望提升全要素生产率。综上，随着政策支持和各个产业的逐步恢复，中国经济和股市有望实现高质量发展。

2023 年，本基金将使用量化方法配置行业及个股，均衡配置，控制组合的整体估值水平和流动性，力争实现稳定的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2022 年，基金管理人监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，通过业务审核、合规检查、系统监控、重点抽查、专项稽核等一系列方式开展工作，强化基金运作和公司运营的合规性，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、加强合规管理，持续完善公司的规章制度，健全内控体系，落实内控责任。

报告期内，坚持以法律法规和公司制度为依据，对公司和基金运作的各项业务开展提供全面的合规咨询、审核、监测与检查，确保基金运作的合法合规性。根据法律法规、监管政策的变化及公司管理需要，新增和修订了多项内部制度和流程，并持续倡导合规文化建设，提升了公司内部控制环境建设。

二、客观开展内外部内控评估，进一步完善内控措施。

根据法规、监管要求并结合风险导向和全覆盖原则，公司进一步加强了日常业务的定期合规检查，重点关注规章制度的执行情况、第一道防线风险控制的有效性。同时，对各部门的业务有重点的开展了多项专项检查和内部审计。另外，根据法规要求，公司聘请律师事务所、会计师事务所等外部专业机构分别对公司开展了合规有效性评估和内部控制评价审计。针对上述内外部评估检查中发现的问题，公司相关业务部门均认真进行整改。通过及时跟踪落实各项问题的整改情况，严格控制了各部门的主要风险，加强并完善了公司的内部控制状况。

三、有效推进反洗钱与反恐怖融资工作。

报告期内，结合反洗钱法规及公司业务特点完善了反洗钱制度及流程，组织多场反洗钱专项培训、考试和宣传活动；基于风险为本的工作思路，继续开展客户信息核查清

理工作，稳步推进代销机构分类管理工作，全面升级反洗钱系统，持续优化监测模型，强化对大额交易和可疑交易方面的监控，并按时向中国反洗钱监测分析中心报送相关数据。报告期内，公司根据监管要求完成了 2021 年度洗钱固有风险自评估工作、机构洗钱和恐怖融资风险自评估工作。

四、强化法规学习，组织开展内外部培训，提升员工的合规及风险意识。

本报告期内，为提高公司全员的合规意识，加大了合规培训力度，强化主动合规意识培育。公司进一步加强组织各类合规培训频率，及时对法规、监管精神和公司要求进行宣导，并通过制作合规法务月刊、举办合规知识竞赛等多样化的合规宣传培训方式进一步提高法律法规宣导工作的及时性，丰富合规宣导工作的形式，激发全体员工学习合规内控政策的积极性，营造合规文化浓厚氛围。通过培训，增强了全体员工的合规意识和风险防范意识，提升了员工的主动识别和控制业务风险的积极性和能力。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金财产安全、合规、诚信运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括分管基金运营业务的高级管理人员、分管投资业务的高级管理人员、督察稽核部负责人、风险管理部负责人、研究部负责人及基金运营部负责人等，以上人员具有丰富的合规、风控、证券研究、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会对经济环境发生重大变化或发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，基金收益分配后基金份额不能低于面值。

本基金报告期内进行过一次利润分配，以截止 2022 年 06 月 22 日本基金的可供分配利润为基准。本次分红于 2022 年 06 月 28 日完成权益登记，海富通量化多因子混合 A 单位分红金额为 0.2400 元，海富通量化多因子混合 C 单位分红金额为 0.2400 元。合计利润分配金额为 68,887,127.80 元。符合基金合同规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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。

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 2022 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(2023)第 21647 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 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产(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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则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

朱宏宇 胡莲莲

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2023 年 3 月 29 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：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
----	-----	-------------------------	--------------------------

资产：			
银行存款	7.4.7.1	14,269,049.30	23,866,516.11
结算备付金		10,181,349.76	28,384,533.24
存出保证金		1,269,282.96	117,021.56
交易性金融资产	7.4.7.2	208,219,904.50	402,861,039.89
其中：股票投资		193,293,103.64	379,348,471.55
基金投资		-	-
债券投资		14,926,800.86	23,512,568.34
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		73,861.45	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,004.01	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	131,313.89
资产总计		234,016,451.98	455,360,424.69
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	4,744,942.09
应付赎回款		31,045.10	2,014.62
应付管理人报酬		331,444.19	502,844.50
应付托管费		55,240.68	83,807.40
应付销售服务费		125,518.22	240,415.02
应付投资顾问费		-	-
应交税费		25,856.78	2.02
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	861,097.19	664,182.99
负债合计		1,430,202.16	6,238,208.64
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	186,543,320.92	244,806,617.46
未分配利润	7.4.7.8	46,042,928.90	204,315,598.59
净资产合计		232,586,249.82	449,122,216.05
负债和净资产总计		234,016,451.98	455,360,424.69

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.2586 元，C 类基金份额净值 1.2414 元。基金份额总额 186,543,320.92 份，其中 A 类基金份额 59,184,385.64 份，C 类基金份额 127,358,935.28 份。

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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-68,917,280.36	32,630,232.29
1.利息收入		542,388.12	527,638.98
其中：存款利息收入	7.4.7.9	477,951.09	253,357.87
债券利息收入		-	234,811.61
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		64,437.03	39,469.50
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-56,715,795.51	60,654,442.39
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-61,985,570.71	54,671,762.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-2,784,988.05	330,966.70
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.12	-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	3,354,128.55	1,955,920.98
股利收益	7.4.7.14	4,700,634.70	3,695,791.79
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-12,817,173.39	-28,726,469.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	73,300.42	174,619.98
减：二、营业总支出		8,569,278.94	12,237,279.35
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,481,818.40	5,395,406.05
2. 托管费	7.4.10.2.2	913,636.44	899,234.41

3. 销售服务费		1,935,276.36	2,611,415.11
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		12,363.74	10,417.63
8. 其他费用	7.4.7.17	226,184.00	3,320,806.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-77,486,559.30	20,392,952.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-77,486,559.30	20,392,952.94
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-77,486,559.30	20,392,952.94

7.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	244,806,617.46	-	204,315,598.59	449,122,216.05
二、本期期初净资产（基金净值）	244,806,617.46	-	204,315,598.59	449,122,216.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-58,263,296.54	-	-158,272,669.69	-216,535,966.23
（一）、综合收益总额	-	-	-77,486,559.30	-77,486,559.30
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-58,263,296.54	-	-11,898,982.59	-70,162,279.13
其中：1.基金申	173,301,306.07	-	88,561,261.56	261,862,567.63

购款				63
2.基金赎回款	-231,564,602.61	-	-100,460,244.15	-332,024,846.76
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-68,887,127.80	-68,887,127.80
四、本期期末净资产(基金净值)	186,543,320.92	-	46,042,928.90	232,586,249.82
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	167,618,919.85	-	119,709,602.44	287,328,522.29
二、本期期初净资产(基金净值)	167,618,919.85	-	119,709,602.44	287,328,522.29
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	77,187,697.61	-	84,605,996.15	161,793,693.76
(一)、综合收益总额	-	-	20,392,952.94	20,392,952.94
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	77,187,697.61	-	64,213,043.21	141,400,740.82
其中: 1.基金申购款	231,638,496.77	-	185,574,403.95	417,212,900.72
2.基金赎回款	-154,450,799.16	-	-121,361,360.74	-275,812,159.90
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	244,806,617.46	-	204,315,598.59	449,122,216.05

值)				
----	--	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：胡光涛，会计机构负责人：胡正万

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

海富通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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》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，本基金于 2021 年 11 月 19 日至 2021 年 12 月 21 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于 2021 年 12 月 22 日表决通过了《关于变更注册海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的议案》。该议案主要修订内容为在基金投资范围中新增港股通标的股票，以及调整相应的投资策略、业绩比较基准、风险收益特征、估值等内容。根据修改后的《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（包含创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、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、股指期货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。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 0%至 95%,投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%,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、存出保证金及应收申购款等。法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 60%+恒生指数收益率(按估值汇率折算) \times 20%+上证国债指数收益率 \times 20%。

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 2023 年 3 月 29 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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 2022 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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产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。

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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动

计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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、资产支持证券投资和衍生工具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资产比例计算的金额。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资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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

确认为投资收益。

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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额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相关交易费用及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确认。

以摊余成本计量的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净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民

币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》、《企业会计准则第24号——套期会计》及《企业会计准则第37号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，财政部于2022年颁布了《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》(财会[2022]14号)，中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

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

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收利息，金额分别为 23,866,516.11 元、28,384,533.24 元、117,021.56 元和 131,313.89 元。

新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和其他资产-应收利息，金额分别为 23,872,136.97 元、28,388,920.59 元、117,074.16 元和 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 402,861,039.89 元。

新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 402,982,292.97 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债，金额分别为 4,744,942.09 元、2,014.62 元、502,844.50 元、83,807.40 元、240,415.02 元、494,182.80 元和 170,000.19 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债，金额分别为 4,744,942.09 元、2,014.62 元、502,844.50 元、83,807.40 元、240,415.02 元、494,182.80 元和 170,000.19 元。

(ii) 于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税

率代扣个人所得税。

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

(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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	14,269,049.30	23,866,516.11
等于：本金	14,267,918.25	23,866,516.11
加：应计利息	1,131.05	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	14,269,049.30	23,866,516.11

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		198,173,960.46	-	193,293,103.64	-4,880,856.82
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	14,808,478.97	142,063.66	14,926,800.86	-23,741.77
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	14,808,478.97	142,063.66	14,926,800.86	-23,741.77
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		212,982,439.43	142,063.66	208,219,904.50	-4,904,598.59
项目		上年度末			
		2021 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		371,346,000.15	-	379,348,471.55	8,002,471.40
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	23,372,704.94	-	23,512,568.34	139,863.40
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	23,372,704.94	-	23,512,568.34	139,863.40
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-

合计	394,718,705.09	-	402,861,039.89	8,142,334.80
----	----------------	---	----------------	--------------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-7,721,600.00	-	-	-
——股指期货	-7,721,600.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-7,721,600.00	-	-	-
项目	上年度末 2021 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	-	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2303	IM2303	-6.00	-7,491,840.00	229,760.00
合计	-	-	-	229,760.00
减：可抵销期货 暂收款	-	-	-	229,760.00
净额	-	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

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 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	131,313.89
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	131,313.89

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	0.19
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	686,097.19	494,182.80
其中：交易所市场	686,097.19	494,182.80
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	175,000.00	170,000.00
合计	861,097.19	664,182.99

7.4.7.7 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 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	47,503,976.11	47,503,976.11
本期申购	88,054,980.87	88,054,980.87
本期赎回（以“-”号填列）	-76,374,571.34	-76,374,571.34
本期末	59,184,385.64	59,184,385.64

海富通量化多因子混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	197,302,641.35	197,302,641.35
本期申购	85,246,325.20	85,246,325.20
本期赎回（以“-”号填列）	-155,190,031.27	-155,190,031.27
本期末	127,358,935.28	127,358,935.28

注：申购含红利再投及转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

海富通量化多因子混合 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	34,852,862.36	5,103,134.76	39,955,997.12
本期利润	-16,890,835.97	1,509,589.99	-15,381,245.98
本期基金份额交易产生的变动数	22,430,553.70	-3,330,094.56	19,100,459.14
其中：基金申购款	40,210,300.96	2,090,774.72	42,301,075.68
基金赎回款	-17,779,747.26	-5,420,869.28	-23,200,616.54
本期已分配利润	-28,371,571.68	-	-28,371,571.68
本期末	12,021,008.41	3,282,630.19	15,303,638.60

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	142,728,744.79	21,630,856.68	164,359,601.47
本期利润	-47,778,549.94	-14,326,763.38	-62,105,313.32
本期基金份额交易产生的变动数	-31,068,283.90	68,842.17	-30,999,441.73
其中：基金申购款	43,115,441.90	3,144,743.98	46,260,185.88
基金赎回款	-74,183,725.80	-3,075,901.81	-77,259,627.61
本期已分配利润	-40,515,556.12	-	-40,515,556.12
本期末	23,366,354.83	7,372,935.47	30,739,290.30

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
活期存款利息收入	146,236.46	99,701.61
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	314,194.42	135,588.67
其他	17,520.21	18,067.59
合计	477,951.09	253,357.87

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
卖出股票成交总额	1,998,317,835.54	1,155,362,653.16
减：卖出股票成本总额	2,055,246,630.34	1,100,690,890.24
减：交易费用	5,056,775.91	-
买卖股票差价收入	-61,985,570.71	54,671,762.92

7.4.7.11 债券投资收益**7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
债券投资收益——利息收入	335,113.17	-
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-3,120,101.22	330,966.70
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	-2,784,988.05	330,966.70

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	41,648,674.89	23,820,423.97
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	44,407,140.16	23,096,287.10
减：应计利息总额	360,968.26	393,170.17
减：交易费用	667.69	-
买卖债券差价收入	-3,120,101.22	330,966.70

7.4.7.12 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。

7.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间收益金额 2021年1月1日至2021年12月31 日
股指期货投资收益(税前)	3,484,840.00	2,042,720.00
股指期货差价收入应缴纳	-101,500.20	-86,799.02

增值税额		
减：交易费用	29,211.25	-
合计	3,354,128.55	1,955,920.98

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利收益	4,700,634.70	3,695,791.79
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	4,700,634.70	3,695,791.79

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
1.交易性金融资产	-13,046,933.39	-28,460,349.06
——股票投资	-12,883,328.22	-28,560,590.91
——债券投资	-163,605.17	100,241.85
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	229,760.00	-266,120.00
——权证投资	-	-
——股指期货	229,760.00	-266,120.00
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	-12,817,173.39	-28,726,469.06

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
基金赎回费收入	73,300.42	174,428.09
基金转换费收入	-	191.89
合计	73,300.42	174,619.98

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
审计费用	55,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	1,184.00	1,180.00
律师费	50,000.00	-
公证费	-	10,000.00
交易费用	-	3,139,626.15
合计	226,184.00	3,320,806.15

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。海富通资产管理(香港)有限公司已于 2022 年 12 月 31 日公告注销，除上述变化外，本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	1,136,929,550.41	29.48%	484,797,267.94	20.18%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	819,352.26	30.25%	135,664.89	19.77%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

		比例		比例
海通证券	344,839.95	20.19%	92,866.73	18.79%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

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 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,481,818.40	5,395,406.05
其中：支付销售机构的客户维护费	90,763.56	145,042.50

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 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	913,636.44	899,234.41

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费 = 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 2022年1月1日至2022年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	海富通量化多因子混合 A	海富通量化多因子混合C	合计
中国工商银行	-	2,879.47	2,879.47
海通证券	-	185.16	185.16
海富通	-	1,844,036.92	1,844,036.92
合计	-	1,847,101.55	1,847,101.55
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	-	3,535.60	3,535.60
海通证券	-	4,170.45	4,170.45
海富通	-	2,415,815.86	2,415,815.86
合计	-	2,423,521.91	2,423,521.91

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费年费率为 0.80%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.80% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。销售服务费的计算方法如下：日销售服务费 = 前一日 C 类份额的基金资产净值 × 0.80% / 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	14,269,049.30	146,236.46	23,866,516.11	99,701.61

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
海通证券	688234	天岳先进	网下发行	2,366	195,881.14
海通证券	688259	创耀科技	网下发行	1,462	97,369.20
海通证券	301228	实朴检测	网下发行	3,721	74,717.68
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
海通证券	688187	时代电气	网下发行	6,885	216,051.30
海通证券	601825	沪农商行	网下发行	15,480	137,772.00
海通证券	301039	中集车辆	网下发行	17,853	124,256.88
海通证券	300981	中红医疗	网下发行	2,144	104,176.96
海通证券	688680	海优新材	网下发行	1,459	102,042.46
海通证券	688687	凯因科技	网下发行	5,354	101,618.92
海通证券	688626	翔宇医疗	网下发行	2,348	67,669.36
海通证券	688630	芯碁微装	网下发行	3,397	51,736.31
海通证券	688665	四方光电	网下发行	1,687	49,817.11
海通证券	688682	霍莱沃	网下发行	946	43,251.12
海通证券	300940	南极光	网下发行	3,068	39,147.68
海通证券	300933	中辰股份	网下发行	11,117	37,464.29

海通证券	688092	爱科科技	网下发行	1,137	21,728.07
海通证券	688217	睿昂基因	网下发行	1,040	19,156.80
海通证券	688038	中科通达	网下发行	2,132	18,335.20
海通证券	688701	卓锦股份	网下发行	2,340	17,503.20

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

海富通量化多因子混合 A

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
1	2022-06-28	2022-06-28	2.400	18,027,893.49	10,343,678.19	28,371,571.68	-
合计			2.400	18,027,893.49	10,343,678.19	28,371,571.68	-

海富通量化多因子混合 C

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
1	2022-06-28	2022-06-28	2.400	31,760,503.91	8,755,052.21	40,515,556.12	-
合计			2.400	31,760,503.91	8,755,052.21	40,515,556.12	-

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301152	天力锂能	2022-08-19	6个月	新股锁定	57.00	46.64	303	17,271.00	14,131.92	-
301161	唯万密封	2022-09-06	6个月	新股锁定	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301165	锐捷网络	2022-11-14	6个月	新股锁定	32.38	31.61	423	13,696.74	13,371.03	-
301175	中科环保	2022-06-30	6个月	新股锁定	3.82	6.01	5,181	19,791.42	31,137.81	-
301197	工大科雅	2022-07-29	6个月	新股锁定	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-
301227	森鹰窗业	2022-09-16	6个月	新股锁定	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301230	泓博医药	2022-10-21	6个月	新股锁定	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-
301231	荣信文化	2022-08-31	6个月	新股锁定	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6个月	新股锁定	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301265	华新环保	2022-12-08	6个月	新股锁定	13.28	11.40	655	8,698.40	7,467.00	-
301269	华大九天	2022-07-21	6个月	新股锁定	32.69	87.94	383	12,520.27	33,681.02	-
301270	汉仪股份	2022-08-19	6个月	新股锁定	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301273	瑞晨环保	2022-10-11	6个月	新股锁定	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-
301277	新天地	2022-11-09	6个月	新股锁定	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301280	珠城科技	2022-12-19	6个月	新股锁定	67.40	44.80	229	15,434.60	10,259.20	-
301282	金禄电子	2022-08-18	6个月	新股锁定	30.38	25.25	384	11,665.92	9,696.00	-
301300	远翔新材	2022-08-09	6个月	新股锁定	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-
301306	西测测试	2022-07-19	6个月	新股锁定	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-
30130	万得	2022-	6个	新股	39.00	24.46	228	8,892.	5,576.	-

9	凯	09-08	月	锁定				00	88	
301311	昆船智能	2022-11-23	6个月	新股锁定	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52	-
301313	凡拓数创	2022-09-22	6个月	新股锁定	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301316	慧博云通	2022-09-29	6个月	新股锁定	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301319	唯特偶	2022-09-22	6个月	新股锁定	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301326	捷邦科技	2022-09-09	6个月	新股锁定	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74	-
301327	华宝新能	2022-09-08	6个月	新股锁定	237.50	176.97	145	34,437.50	25,660.65	-
301328	维峰电子	2022-08-30	6个月	新股锁定	78.80	76.96	160	12,608.00	12,313.60	-
301349	信德新材	2022-08-30	6个月	新股锁定	138.88	103.52	82	11,388.16	8,488.64	-
301359	东南电子	2022-11-02	6个月	新股锁定	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20	-
301368	丰立智能	2022-12-07	6个月	新股锁定	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
301377	鼎泰高科	2022-11-11	6个月	新股锁定	22.88	17.63	732	16,748.16	12,905.16	-
301388	欣灵电气	2022-10-26	6个月	新股锁定	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301398	星源卓镁	2022-12-08	6个月	新股锁定	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-
688439	振华风光	2022-08-19	6个月	新股锁定	66.99	114.86	2,270	152,067.30	260,732.20	-
688455	科捷智能	2022-09-07	6个月	新股锁定	21.88	13.12	5,277	115,460.76	69,234.24	-
688475	萤石网络	2022-12-20	6个月	新股锁定	28.77	24.65	6,020	173,195.40	148,393.00	-
688506	百利天恒	2022-12-28	1个月内(含)	新股未上市	24.70	24.70	9,931	245,295.70	245,295.70	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

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

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

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
300850	新强联	2022-12-30	重大事项	53.28	2023-01-10	56.88	3,200	196,099.29	170,496.00	-

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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为 0.09%（2021 年 12 月 31 日：2.40%）。

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-

未评级	10,068,561.64	12,731,873.50
合计	10,068,561.64	12,731,873.50

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	169,791.78	584,517.50
AAA 以下	28,958.73	10,196,177.34
未评级	4,659,488.71	-
合计	4,858,239.22	10,780,694.84

注：未评级部分为国债。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均能及时变现。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发

行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营

活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	14,269,049.30	-	-	-	14,269,049.30
结算备付金	10,181,349.76	-	-	-	10,181,349.76
存出保证金	145,506.96	-	-	1,123,776.00	1,269,282.96
交易性金融资产	14,728,050.35	-	198,750.51	193,293,103.64	208,219,904.50
应收清算款	-	-	-	73,861.45	73,861.45
应收申购款	-	-	-	3,004.01	3,004.01
资产总计	39,323,956.37	-	198,750.51	194,493,745.10	234,016,451.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	31,045.10	31,045.10
应付管理人报酬	-	-	-	331,444.19	331,444.19
应付托管费	-	-	-	55,240.68	55,240.68
应付销售服务费	-	-	-	125,518.22	125,518.22
应交税费	-	-	-	25,856.78	25,856.78
其他负债	-	-	-	861,097.19	861,097.19
负债总计	-	-	-	1,430,202.16	1,430,202.16
利率敏感度缺口	39,323,956.37	-	198,750.51	193,063,542.94	232,586,249.82
上年度末 2021 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	23,866,516.11	-	-	-	23,866,516.11
结算备付金	28,384,533.24	-	-	-	28,384,533.24
存出保证金	117,021.56	-	-	-	117,021.56
交易性金融资	22,822,673.50	149,323.72	540,571.12	379,348,471.5	402,861,039.8

产				5	9
其他资产	-	-	-	131,313.89	131,313.89
资产总计	75,190,744.41	149,323.72	540,571.12	379,479,785.44	455,360,424.69
负债					
应付清算款	-	-	-	4,744,942.09	4,744,942.09
应付赎回款	-	-	-	2,014.62	2,014.62
应付管理人报酬	-	-	-	502,844.50	502,844.50
应付托管费	-	-	-	83,807.40	83,807.40
应付销售服务费	-	-	-	240,415.02	240,415.02
应交税费	-	-	-	2.02	2.02
其他负债	-	-	-	664,182.99	664,182.99
负债总计	-	-	-	6,238,208.64	6,238,208.64
利率敏感度缺口	75,190,744.41	149,323.72	540,571.12	373,241,576.80	449,122,216.05

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-21,676.41	-168,010.83
	市场利率下降 25 个基点	21,795.22	170,641.68

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及存托凭证投资 0%-95%、投资于港股通标的股票比例占股票投资比例的 0-50%。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 2022年12月31日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	193,293,103.64	83.11	379,348,471.55	84.46
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	193,293,103.64	83.11	379,348,471.55	84.46

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	9,211,778.95	20,711,067.49
2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-9,211,778.95	-20,711,067.49	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	192,254,315.90	388,264,052.02
第二层次	15,143,842.05	14,596,987.87
第三层次	821,746.55	-
合计	208,219,904.50	402,861,039.89

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,316,184.39	2,316,184.39
转出第三层次	-	2,248,690.20	2,248,690.20
当期利得或损失总额	-	754,252.36	754,252.36
其中：计入损益的利得	-	754,252.36	754,252.36

或损失			
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	821,746.55	821,746.55
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	31,704.33	31,704.33
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：于2022年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2022年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失计入利润表中的公允价值变动损益项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	821,746.55	亚式期权模型	预期年化波动率	20.63%~247.56%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2021年12月31日：无)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 12 月 31 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	193,293,103.64	82.60
	其中：股票	193,293,103.64	82.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,926,800.86	6.38
	其中：债券	14,926,800.86	6.38
	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	24,450,399.06	10.45
8	其他各项资产	1,346,148.42	0.58
9	合计	234,016,451.98	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	1,389,913.00	0.60
B	采矿业	5,944,461.00	2.56
C	制造业	130,552,532.79	56.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,890,614.00	1.67
E	建筑业	2,420,423.00	1.04
F	批发和零售业	2,775,476.00	1.19
G	交通运输、仓储和邮政业	1,921,990.00	0.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,456,724.46	4.07
J	金融业	17,782,311.40	7.65
K	房地产业	4,332,467.86	1.86
L	租赁和商务服务业	4,620,293.00	1.99
M	科学研究和技术服务业	3,821,079.65	1.64
N	水利、环境和公共设施管理业	1,991,040.81	0.86
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,052,910.17	0.45
R	文化、体育和娱乐业	1,340,866.50	0.58
S	综合	-	-
	合计	193,293,103.64	83.11

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	600519	贵州茅台	3,405	5,880,435.00	2.53
2	601888	中国中免	17,600	3,802,128.00	1.63
3	601318	中国平安	74,800	3,515,600.00	1.51
4	300122	智飞生物	34,000	2,986,220.00	1.28

5	000858	五粮液	16,356	2,955,365.64	1.27
6	300750	宁德时代	7,200	2,832,624.00	1.22
7	300760	迈瑞医疗	7,900	2,496,163.00	1.07
8	600036	招商银行	66,500	2,477,790.00	1.07
9	000333	美的集团	41,439	2,146,540.20	0.92
10	600919	江苏银行	270,300	1,970,487.00	0.85
11	002271	东方雨虹	56,100	1,883,277.00	0.81
12	600048	保利发展	123,322	1,865,861.86	0.80
13	300059	东方财富	73,012	1,416,432.80	0.61
14	002475	立讯精密	40,119	1,273,778.25	0.55
15	600900	长江电力	60,200	1,264,200.00	0.54
16	601088	中国神华	44,900	1,240,138.00	0.53
17	600309	万华化学	13,000	1,204,450.00	0.52
18	601838	成都银行	74,800	1,144,440.00	0.49
19	601012	隆基绿能	26,724	1,129,356.24	0.49
20	300347	泰格医药	10,300	1,079,440.00	0.46
21	600030	中信证券	51,900	1,033,329.00	0.44
22	601668	中国建筑	187,400	1,017,582.00	0.44
23	600438	通威股份	26,100	1,006,938.00	0.43
24	601225	陕西煤业	53,400	992,172.00	0.43
25	300014	亿纬锂能	11,100	975,690.00	0.42
26	600887	伊利股份	30,200	936,200.00	0.40
27	300015	爱尔眼科	28,631	889,565.17	0.38
28	300124	汇川技术	12,650	879,175.00	0.38
29	002142	宁波银行	26,800	869,660.00	0.37
30	002555	三七互娱	47,300	856,130.00	0.37
31	600926	杭州银行	61,800	808,344.00	0.35
32	600660	福耀玻璃	22,500	789,075.00	0.34
33	600426	华鲁恒升	23,400	775,710.00	0.33
34	002920	德赛西威	7,100	747,914.00	0.32
35	300498	温氏股份	37,600	738,088.00	0.32
36	002594	比亚迪	2,800	719,516.00	0.31
37	600009	上海机场	12,200	704,062.00	0.30
38	603806	福斯特	10,300	684,332.00	0.29
39	002311	海大集团	9,900	611,127.00	0.26
40	001979	招商蛇口	47,900	604,977.00	0.26
41	300413	芒果超媒	19,400	582,388.00	0.25
42	601669	中国电建	79,700	564,276.00	0.24
43	002956	西麦食品	37,200	553,164.00	0.24
44	300855	图南股份	11,800	552,122.00	0.24
45	603856	东宏股份	47,200	547,048.00	0.24
46	600031	三一重工	33,738	533,060.40	0.23
47	600690	海尔智家	21,700	530,782.00	0.23
48	600729	重庆百货	22,300	527,395.00	0.23

49	603611	诺力股份	32,100	519,699.00	0.22
50	600795	国电电力	121,500	518,805.00	0.22
51	000661	长春高新	3,100	515,995.00	0.22
52	002049	紫光国微	3,900	514,098.00	0.22
53	603600	永艺股份	52,500	511,875.00	0.22
54	300543	朗科智能	61,000	508,740.00	0.22
55	300642	透景生命	24,200	503,118.00	0.22
56	603986	兆易创新	4,900	502,103.00	0.22
57	600210	紫江企业	100,000	500,000.00	0.21
58	688006	杭可科技	11,311	495,082.47	0.21
59	002392	北京利尔	140,700	491,043.00	0.21
60	002027	分众传媒	73,200	488,976.00	0.21
61	601688	华泰证券	38,300	487,942.00	0.21
62	601211	国泰君安	35,800	486,522.00	0.21
63	603890	春秋电子	53,100	485,334.00	0.21
64	603960	克来机电	27,300	484,029.00	0.21
65	601702	华峰铝业	32,300	482,885.00	0.21
66	002970	锐明技术	25,000	482,750.00	0.21
67	600285	羚锐制药	36,900	481,176.00	0.21
68	000513	丽珠集团	14,800	480,704.00	0.21
69	601100	恒立液压	7,544	476,403.60	0.20
70	300447	全信股份	30,700	472,780.00	0.20
71	002129	TCL 中环	12,500	470,750.00	0.20
72	601689	拓普集团	8,000	468,640.00	0.20
73	300601	康泰生物	14,520	457,815.60	0.20
74	002714	牧原股份	9,360	456,300.00	0.20
75	603799	华友钴业	8,090	450,046.70	0.19
76	600460	士兰微	13,500	442,665.00	0.19
77	601898	中煤能源	51,000	439,620.00	0.19
78	603018	华设集团	57,700	437,366.00	0.19
79	000002	万科 A	24,000	436,800.00	0.19
80	601799	星宇股份	3,400	433,058.00	0.19
81	002651	利君股份	66,200	432,948.00	0.19
82	600820	隧道股份	81,900	431,613.00	0.19
83	600893	航发动力	10,200	431,256.00	0.19
84	601169	北京银行	97,800	421,518.00	0.18
85	600011	华能国际	55,100	419,311.00	0.18
86	600389	江山股份	9,500	418,760.00	0.18
87	601328	交通银行	88,100	417,594.00	0.18
88	601000	唐山港	151,500	415,110.00	0.18
89	600177	雅戈尔	65,100	412,083.00	0.18
90	300725	药石科技	5,100	410,550.00	0.18
91	600908	无锡银行	77,300	407,371.00	0.18
92	000848	承德露露	48,000	407,040.00	0.18

93	688685	迈信林	17,589	407,009.46	0.17
94	688133	泰坦科技	2,936	406,547.92	0.17
95	002752	昇兴股份	78,100	406,120.00	0.17
96	603808	歌力思	44,500	404,950.00	0.17
97	600028	中国石化	92,800	404,608.00	0.17
98	000906	浙商中拓	44,800	403,648.00	0.17
99	601126	四方股份	27,600	402,960.00	0.17
100	601137	博威合金	27,200	402,832.00	0.17
101	688356	键凯科技	2,573	402,803.15	0.17
102	688085	三友医疗	14,442	400,765.50	0.17
103	002637	赞宇科技	32,600	400,328.00	0.17
104	300595	欧普康视	11,100	396,270.00	0.17
105	603489	八方股份	3,700	395,863.00	0.17
106	600582	天地科技	76,000	395,200.00	0.17
107	002605	姚记科技	28,000	393,400.00	0.17
108	603429	集友股份	36,100	392,768.00	0.17
109	603081	大丰实业	31,500	392,490.00	0.17
110	300259	新天科技	118,200	392,424.00	0.17
111	300790	宇瞳光学	26,300	391,870.00	0.17
112	002624	完美世界	30,800	391,776.00	0.17
113	300616	尚品宅配	19,900	390,836.00	0.17
114	002968	新大正	17,900	390,041.00	0.17
115	601899	紫金矿业	39,000	390,000.00	0.17
116	688016	心脉医疗	2,063	389,989.52	0.17
117	000060	中金岭南	95,000	389,500.00	0.17
118	000090	天健集团	71,200	388,752.00	0.17
119	600449	宁夏建材	32,600	386,962.00	0.17
120	603533	掌阅科技	26,600	385,434.00	0.17
121	300384	三联虹普	25,300	384,813.00	0.17
122	600963	岳阳林纸	70,400	383,680.00	0.16
123	600901	江苏租赁	70,000	383,600.00	0.16
124	603583	捷昌驱动	15,000	383,400.00	0.16
125	603558	健盛集团	46,500	383,160.00	0.16
126	600325	华发股份	42,200	382,332.00	0.16
127	603987	康德莱	27,700	381,706.00	0.16
128	002106	莱宝高科	49,700	381,696.00	0.16
129	688389	普门科技	21,386	381,312.38	0.16
130	300378	鼎捷软件	24,700	378,651.00	0.16
131	688568	中科星图	6,092	377,947.68	0.16
132	300130	新国都	31,300	377,791.00	0.16
133	300119	瑞普生物	20,300	377,783.00	0.16
134	300232	洲明科技	68,800	377,712.00	0.16
135	600496	精工钢构	95,600	377,620.00	0.16
136	300358	楚天科技	25,600	377,600.00	0.16

137	603681	永冠新材	17,600	376,288.00	0.16
138	603328	依顿电子	57,900	375,771.00	0.16
139	300735	光弘科技	42,300	375,624.00	0.16
140	300031	宝通科技	27,100	374,793.00	0.16
141	600742	一汽富维	44,600	372,856.00	0.16
142	603112	华翔股份	32,000	372,800.00	0.16
143	002734	利民股份	39,600	370,656.00	0.16
144	000717	中南股份	129,800	369,930.00	0.16
145	002815	崇达技术	37,300	369,643.00	0.16
146	688233	神工股份	9,048	369,158.40	0.16
147	300274	阳光电源	3,300	368,940.00	0.16
148	603667	五洲新春	27,700	368,687.00	0.16
149	300815	玉禾田	24,200	368,566.00	0.16
150	002975	博杰股份	11,600	367,372.00	0.16
151	600720	祁连山	36,900	366,417.00	0.16
152	002050	三花智控	17,263	366,320.86	0.16
153	600581	八一钢铁	92,300	365,508.00	0.16
154	603324	盛剑环境	10,400	364,728.00	0.16
155	603833	欧派家居	3,000	364,590.00	0.16
156	603920	世运电路	25,300	363,814.00	0.16
157	600064	南京高科	54,500	360,245.00	0.15
158	605208	永茂泰	26,900	358,846.00	0.15
159	002810	山东赫达	16,000	358,720.00	0.15
160	000902	新洋丰	30,900	355,659.00	0.15
161	300349	金卡智能	37,400	350,438.00	0.15
162	002391	长青股份	49,800	350,094.00	0.15
163	002034	旺能环境	19,400	349,976.00	0.15
164	600188	兖矿能源	10,400	349,232.00	0.15
165	300190	维尔利	83,500	346,525.00	0.15
166	002753	永东股份	40,900	341,924.00	0.15
167	688078	龙软科技	10,543	337,059.71	0.14
168	002585	双星新材	26,400	336,600.00	0.14
169	600114	东睦股份	39,500	335,750.00	0.14
170	003019	宸展光电	15,700	334,567.00	0.14
171	300572	安车检测	29,200	334,340.00	0.14
172	688127	蓝特光学	20,984	334,275.12	0.14
173	002977	天箭科技	9,100	333,970.00	0.14
174	002887	绿茵生态	39,300	333,264.00	0.14
175	300910	瑞丰新材	2,700	332,937.00	0.14
176	000791	甘肃电投	62,800	331,584.00	0.14
177	000708	中信特钢	19,200	329,472.00	0.14
178	300751	迈为股份	800	329,472.00	0.14
179	600971	恒源煤电	46,000	329,360.00	0.14
180	002335	科华数据	6,600	329,274.00	0.14

181	605168	三人行	3,700	329,189.00	0.14
182	603688	石英股份	2,500	328,300.00	0.14
183	603309	维力医疗	16,400	327,672.00	0.14
184	688066	航天宏图	3,832	327,636.00	0.14
185	002876	三利谱	9,000	327,600.00	0.14
186	300258	精锻科技	28,000	325,640.00	0.14
187	300284	苏交科	58,100	325,360.00	0.14
188	601717	郑煤机	29,100	324,756.00	0.14
189	300395	菲利华	5,900	324,500.00	0.14
190	603337	杰克股份	17,000	323,680.00	0.14
191	300856	科思股份	6,200	323,330.00	0.14
192	600308	华泰股份	63,600	322,452.00	0.14
193	002833	弘亚数控	26,100	321,813.00	0.14
194	603626	科森科技	48,900	320,784.00	0.14
195	002100	天康生物	38,600	320,766.00	0.14
196	000596	古井贡酒	1,200	320,280.00	0.14
197	300416	苏试试验	10,600	319,590.00	0.14
198	000976	华铁股份	87,000	319,290.00	0.14
199	688518	联赢激光	10,903	318,476.63	0.14
200	300800	力合科技	27,300	317,772.00	0.14
201	603118	共进股份	39,900	317,205.00	0.14
202	603630	拉芳家化	20,200	316,938.00	0.14
203	688676	金盘科技	8,751	316,611.18	0.14
204	001696	宗申动力	53,300	316,602.00	0.14
205	002302	西部建设	43,600	316,100.00	0.14
206	603297	永新光学	3,800	315,438.00	0.14
207	300219	鸿利智汇	47,200	315,296.00	0.14
208	002991	甘源食品	4,100	312,789.00	0.13
209	600176	中国巨石	22,800	312,588.00	0.13
210	002073	软控股份	50,800	312,420.00	0.13
211	688516	奥特维	1,553	312,153.00	0.13
212	603179	新泉股份	8,100	311,769.00	0.13
213	300811	铂科新材	3,600	311,292.00	0.13
214	300101	振芯科技	12,700	311,150.00	0.13
215	300596	利安隆	5,700	311,049.00	0.13
216	600481	双良节能	23,900	309,266.00	0.13
217	600089	特变电工	15,400	309,232.00	0.13
218	688111	金山办公	1,169	309,188.81	0.13
219	300552	万集科技	17,200	308,396.00	0.13
220	605305	中际联合	8,700	307,980.00	0.13
221	605020	永和股份	7,800	306,384.00	0.13
222	600694	大商股份	16,900	305,890.00	0.13
223	688559	海目星	5,287	305,800.08	0.13
224	002413	雷科防务	69,100	305,422.00	0.13

225	000933	神火股份	20,400	305,184.00	0.13
226	002439	启明星辰	11,700	305,136.00	0.13
227	002602	世纪华通	80,000	304,800.00	0.13
228	002025	航天电器	4,600	304,750.00	0.13
229	600158	中体产业	34,800	303,804.00	0.13
230	600563	法拉电子	1,900	303,772.00	0.13
231	688677	海泰新光	2,688	303,744.00	0.13
232	002937	兴瑞科技	13,400	303,510.00	0.13
233	603596	伯特利	3,800	303,240.00	0.13
234	603786	科博达	4,600	302,818.00	0.13
235	605111	新洁能	3,900	302,562.00	0.13
236	600732	爱旭股份	8,000	302,560.00	0.13
237	002484	江海股份	13,500	301,995.00	0.13
238	300260	新莱应材	4,500	301,950.00	0.13
239	002056	横店东磁	16,100	301,714.00	0.13
240	002541	鸿路钢构	10,300	301,687.00	0.13
241	688036	传音控股	3,764	299,313.28	0.13
242	601877	正泰电器	10,800	299,160.00	0.13
243	688586	江航装备	18,347	299,056.10	0.13
244	688550	瑞联新材	6,416	299,049.76	0.13
245	003031	中瓷电子	3,100	298,530.00	0.13
246	300769	德方纳米	1,300	298,467.00	0.13
247	300881	盛德鑫泰	9,300	298,437.00	0.13
248	600073	上海梅林	37,500	298,125.00	0.13
249	300443	金雷股份	7,400	298,072.00	0.13
250	603197	保隆科技	6,300	297,990.00	0.13
251	300179	四方达	24,100	297,876.00	0.13
252	002384	东山精密	12,000	296,760.00	0.13
253	688122	西部超导	3,131	296,474.39	0.13
254	603290	斯达半导	900	296,370.00	0.13
255	002324	普利特	18,500	296,000.00	0.13
256	002649	博彦科技	28,700	295,323.00	0.13
257	688200	华峰测控	1,061	293,334.67	0.13
258	002821	凯莱英	1,980	293,040.00	0.13
259	002371	北方华创	1,300	292,890.00	0.13
260	300454	深信服	2,600	292,630.00	0.13
261	002777	久远银海	19,500	292,500.00	0.13
262	300316	晶盛机电	4,600	292,376.00	0.13
263	300660	江苏雷利	12,500	292,375.00	0.13
264	300580	贝斯特	15,700	292,334.00	0.13
265	002409	雅克科技	5,800	292,146.00	0.13
266	300570	太辰光	20,200	292,092.00	0.13
267	688268	华特气体	3,929	291,728.25	0.13
268	603713	密尔克卫	2,500	291,650.00	0.13

269	600109	国金证券	33,518	291,606.60	0.13
270	002463	沪电股份	24,500	291,550.00	0.13
271	000630	铜陵有色	93,400	291,408.00	0.13
272	002415	海康威视	8,400	291,312.00	0.13
273	603730	岱美股份	18,100	291,048.00	0.13
274	002922	伊戈尔	19,100	290,893.00	0.13
275	002677	浙江美大	26,200	290,296.00	0.12
276	600419	天润乳业	18,500	290,080.00	0.12
277	002891	中宠股份	13,000	290,030.00	0.12
278	600862	中航高科	13,000	289,770.00	0.12
279	002338	奥普光电	13,000	289,770.00	0.12
280	300604	长川科技	6,500	289,770.00	0.12
281	300115	长盈精密	28,000	289,240.00	0.12
282	002539	云图控股	26,000	289,120.00	0.12
283	300629	新劲刚	11,300	288,828.00	0.12
284	000910	大亚圣象	33,900	288,828.00	0.12
285	300679	电连技术	7,800	288,600.00	0.12
286	003021	兆威机电	6,000	288,420.00	0.12
287	000049	德赛电池	6,600	286,968.00	0.12
288	300820	英杰电气	3,900	286,572.00	0.12
289	600874	创业环保	47,000	286,230.00	0.12
290	300450	先导智能	7,100	285,775.00	0.12
291	688388	嘉元科技	6,363	285,380.55	0.12
292	688155	先惠技术	5,438	284,353.02	0.12
293	002549	凯美特气	18,800	284,068.00	0.12
294	300379	东方通	13,900	283,977.00	0.12
295	002843	泰嘉股份	14,000	283,920.00	0.12
296	603267	鸿远电子	2,800	283,248.00	0.12
297	002675	东诚药业	17,100	283,176.00	0.12
298	000301	东方盛虹	21,700	282,968.00	0.12
299	603505	金石资源	7,100	281,302.00	0.12
300	603129	春风动力	2,500	281,300.00	0.12
301	603876	鼎胜新材	6,800	279,072.00	0.12
302	002906	华阳集团	8,400	279,048.00	0.12
303	688788	科思科技	7,686	277,387.74	0.12
304	002444	巨星科技	14,600	277,108.00	0.12
305	002756	永兴材料	3,000	276,510.00	0.12
306	603348	文灿股份	4,800	276,336.00	0.12
307	688037	芯源微	1,752	274,188.00	0.12
308	603305	旭升集团	8,500	274,040.00	0.12
309	600873	梅花生物	26,900	273,842.00	0.12
310	600458	时代新材	30,300	273,306.00	0.12
311	300455	康拓红外	36,800	272,688.00	0.12
312	688439	振华风光	2,270	260,732.20	0.11

313	603809	豪能股份	24,400	259,616.00	0.11
314	601166	兴业银行	14,700	258,573.00	0.11
315	601288	农业银行	86,800	252,588.00	0.11
316	601988	中国银行	79,900	252,484.00	0.11
317	300496	中科创达	2,500	250,750.00	0.11
318	601006	大秦铁路	36,800	245,824.00	0.11
319	688506	百利天恒	9,931	245,295.70	0.11
320	002428	云南锗业	26,100	243,252.00	0.10
321	300326	凯利泰	33,300	239,760.00	0.10
322	600153	建发股份	17,400	237,510.00	0.10
323	601666	平煤股份	21,500	232,415.00	0.10
324	688408	中信博	2,361	232,322.40	0.10
325	002318	久立特材	13,800	229,632.00	0.10
326	300401	花园生物	15,900	228,801.00	0.10
327	688012	中微公司	2,315	226,893.15	0.10
328	000030	富奥股份	50,300	221,320.00	0.10
329	688399	硕世生物	2,522	221,204.62	0.10
330	300770	新媒股份	5,800	218,428.00	0.09
331	300351	永贵电器	13,900	215,033.00	0.09
332	002419	天虹股份	30,700	211,216.00	0.09
333	000733	振华科技	1,800	205,614.00	0.09
334	002925	盈趣科技	12,400	204,848.00	0.09
335	300494	盛天网络	13,600	203,048.00	0.09
336	601636	旗滨集团	17,500	199,325.00	0.09
337	002057	中钢天源	18,900	198,450.00	0.09
338	600123	兰花科创	14,800	197,432.00	0.08
339	601168	西部矿业	19,300	196,860.00	0.08
340	600562	国睿科技	11,600	196,620.00	0.08
341	600975	新五丰	27,500	195,525.00	0.08
342	000034	神州数码	8,900	195,266.00	0.08
343	000937	冀中能源	30,700	195,252.00	0.08
344	300726	宏达电子	4,400	194,216.00	0.08
345	603686	福龙马	22,500	194,175.00	0.08
346	300453	三鑫医疗	22,500	193,950.00	0.08
347	600590	泰豪科技	33,300	193,473.00	0.08
348	002635	安洁科技	15,600	192,660.00	0.08
349	600888	新疆众和	23,500	192,465.00	0.08
350	600985	淮北矿业	15,000	192,000.00	0.08
351	300127	银河磁体	12,600	191,394.00	0.08
352	603997	继峰股份	12,500	191,000.00	0.08
353	300193	佳士科技	26,100	190,008.00	0.08
354	600528	中铁工业	24,900	189,987.00	0.08
355	601101	昊华能源	30,700	189,726.00	0.08
356	600267	海正药业	17,200	189,544.00	0.08

357	000401	冀东水泥	23,000	189,290.00	0.08
358	002179	中航光电	3,260	188,297.60	0.08
359	300196	长海股份	13,300	187,929.00	0.08
360	300738	奥飞数据	21,300	187,653.00	0.08
361	300767	震安科技	4,000	187,000.00	0.08
362	300788	中信出版	9,200	186,300.00	0.08
363	688159	有方科技	12,802	186,269.10	0.08
364	600580	卧龙电驱	14,900	185,654.00	0.08
365	300624	万兴科技	6,300	184,968.00	0.08
366	002601	龙佰集团	9,700	183,524.00	0.08
367	688100	威胜信息	7,943	183,403.87	0.08
368	002042	华孚时尚	60,000	183,000.00	0.08
369	300045	华力创通	27,900	182,187.00	0.08
370	300457	赢合科技	10,300	182,001.00	0.08
371	300653	正海生物	4,200	180,600.00	0.08
372	002929	润建股份	4,600	180,596.00	0.08
373	300360	炬华科技	12,300	178,965.00	0.08
374	300829	金丹科技	8,200	178,842.00	0.08
375	603601	再升科技	33,800	178,464.00	0.08
376	600315	上海家化	5,600	178,360.00	0.08
377	688002	睿创微纳	4,785	177,954.15	0.08
378	002563	森马服饰	33,900	177,636.00	0.08
379	300394	天孚通信	6,900	174,915.00	0.08
380	600803	新奥股份	10,800	173,880.00	0.07
381	002570	贝因美	32,100	173,661.00	0.07
382	300723	一品红	5,000	172,900.00	0.07
383	601601	中国太保	7,000	171,640.00	0.07
384	002332	仙琚制药	15,100	170,630.00	0.07
385	300850	新强联	3,200	170,496.00	0.07
386	002003	伟星股份	16,800	170,016.00	0.07
387	002851	麦格米特	6,500	168,740.00	0.07
388	000895	双汇发展	6,500	168,545.00	0.07
389	601939	建设银行	29,900	168,337.00	0.07
390	002768	国恩股份	5,800	168,316.00	0.07
391	603187	海容冷链	5,300	168,116.00	0.07
392	300634	彩讯股份	11,000	167,750.00	0.07
393	600019	宝钢股份	29,900	167,141.00	0.07
394	002727	一心堂	5,300	167,003.00	0.07
395	300504	天邑股份	10,400	166,920.00	0.07
396	300213	佳讯飞鸿	34,400	166,840.00	0.07
397	600886	国投电力	15,400	166,782.00	0.07
398	603896	寿仙谷	4,200	166,572.00	0.07
399	600261	阳光照明	52,100	166,199.00	0.07
400	600059	古越龙山	17,100	166,041.00	0.07

401	601339	百隆东方	29,100	165,870.00	0.07
402	002196	方正电机	22,800	165,528.00	0.07
403	300215	电科院	29,900	164,749.00	0.07
404	300638	广和通	9,200	164,680.00	0.07
405	688019	安集科技	913	164,340.00	0.07
406	002372	伟星新材	7,700	164,318.00	0.07
407	688626	翔宇医疗	5,151	164,213.88	0.07
408	300224	正海磁材	13,100	164,143.00	0.07
409	601998	中信银行	32,900	163,842.00	0.07
410	002293	罗莱生活	14,600	163,812.00	0.07
411	300244	迪安诊断	6,500	163,345.00	0.07
412	002438	江苏神通	14,900	162,857.00	0.07
413	300590	移为通信	16,600	162,846.00	0.07
414	600016	民生银行	47,200	162,840.00	0.07
415	300440	运达科技	23,600	162,840.00	0.07
416	688001	华兴源创	6,043	162,556.70	0.07
417	601311	骆驼股份	19,900	162,384.00	0.07
418	002507	涪陵榨菜	6,300	162,351.00	0.07
419	002402	和而泰	11,100	161,838.00	0.07
420	300183	东软载波	13,400	161,470.00	0.07
421	000789	万年青	18,900	161,406.00	0.07
422	688179	阿拉丁	4,458	161,156.70	0.07
423	600507	方大特钢	26,700	160,734.00	0.07
424	002611	东方精工	39,500	160,370.00	0.07
425	300571	平治信息	5,700	159,600.00	0.07
426	300666	江丰电子	2,300	159,160.00	0.07
427	603393	新天然气	7,300	158,921.00	0.07
428	688266	泽璟制药	3,809	158,835.30	0.07
429	000983	山西焦煤	13,600	158,440.00	0.07
430	002110	三钢闽光	33,700	158,390.00	0.07
431	688029	南微医学	1,928	158,346.64	0.07
432	002287	奇正藏药	6,900	157,665.00	0.07
433	600366	宁波韵升	14,900	157,195.00	0.07
434	002233	塔牌集团	22,100	156,910.00	0.07
435	603313	梦百合	14,800	156,880.00	0.07
436	603108	润达医疗	15,500	156,705.00	0.07
437	002495	佳隆股份	51,700	156,651.00	0.07
438	000157	中联重科	28,700	156,128.00	0.07
439	002967	广电计量	9,300	156,054.00	0.07
440	600395	盘江股份	23,200	155,904.00	0.07
441	002759	天际股份	9,600	155,808.00	0.07
442	000550	江铃汽车	11,600	155,788.00	0.07
443	600422	昆药集团	11,000	155,320.00	0.07
444	603180	金牌厨柜	5,400	154,818.00	0.07

445	600750	江中药业	10,700	154,615.00	0.07
446	601827	三峰环境	24,000	154,320.00	0.07
447	002085	万丰奥威	25,900	154,105.00	0.07
448	301080	百普赛斯	1,500	154,035.00	0.07
449	002705	新宝股份	9,200	153,180.00	0.07
450	002130	沃尔核材	23,700	152,865.00	0.07
451	688128	中国电研	8,918	152,319.44	0.07
452	000402	金融街	29,000	152,250.00	0.07
453	600546	山煤国际	10,500	152,145.00	0.07
454	300729	乐歌股份	9,400	151,998.00	0.07
455	000887	中鼎股份	10,500	151,935.00	0.07
456	002645	华宏科技	10,100	150,591.00	0.06
457	603697	有友食品	12,100	150,524.00	0.06
458	002273	水晶光电	12,700	149,733.00	0.06
459	300684	中石科技	10,100	149,581.00	0.06
460	002798	帝欧家居	19,700	148,735.00	0.06
461	688475	萤石网络	6,020	148,393.00	0.06
462	601677	明泰铝业	8,100	146,934.00	0.06
463	002993	奥海科技	4,300	146,243.00	0.06
464	300908	仲景食品	3,800	145,730.00	0.06
465	300610	晨化股份	11,600	145,464.00	0.06
466	002055	得润电子	16,800	144,816.00	0.06
467	600236	桂冠电力	24,900	143,424.00	0.06
468	600697	欧亚集团	10,200	142,596.00	0.06
469	600551	时代出版	13,900	141,502.00	0.06
470	000930	中粮科技	16,900	141,284.00	0.06
471	601375	中原证券	38,600	140,504.00	0.06
472	603016	新宏泰	7,400	140,304.00	0.06
473	000543	皖能电力	31,300	140,224.00	0.06
474	601616	广电电气	41,200	139,668.00	0.06
475	000900	现代投资	33,400	139,612.00	0.06
476	603353	和顺石油	7,500	139,350.00	0.06
477	300690	双一科技	8,600	138,804.00	0.06
478	600085	同仁堂	3,100	138,508.00	0.06
479	605196	华通线缆	19,800	138,204.00	0.06
480	002587	奥拓电子	27,400	138,096.00	0.06
481	002927	泰永长征	13,600	137,632.00	0.06
482	300880	迦南智能	9,500	137,465.00	0.06
483	600969	郴电国际	18,500	137,270.00	0.06
484	600741	华域汽车	7,900	136,907.00	0.06
485	605056	咸亨国际	11,200	136,752.00	0.06
486	603788	宁波高发	12,800	136,448.00	0.06
487	002360	同德化工	19,400	136,382.00	0.06
488	605488	福莱新材	10,200	136,272.00	0.06

489	300245	天玑科技	17,800	135,102.00	0.06
490	300968	格林精密	16,800	134,736.00	0.06
491	000710	贝瑞基因	11,800	134,638.00	0.06
492	300889	爱克股份	10,500	134,400.00	0.06
493	603159	上海亚虹	10,300	134,312.00	0.06
494	603178	圣龙股份	13,900	133,996.00	0.06
495	600067	冠城大通	43,100	133,610.00	0.06
496	002809	红墙股份	14,000	133,420.00	0.06
497	301059	金三江	7,200	133,200.00	0.06
498	603861	白云电器	17,800	132,966.00	0.06
499	603767	中马传动	18,300	131,028.00	0.06
500	003017	大洋生物	4,600	127,466.00	0.05
501	600012	皖通高速	17,200	125,732.00	0.05
502	600674	川投能源	10,100	123,523.00	0.05
503	603096	新经典	6,100	121,268.00	0.05
504	000739	普洛药业	5,500	118,470.00	0.05
505	002957	科瑞技术	7,800	118,014.00	0.05
506	000967	盈峰环境	25,100	113,954.00	0.05
507	300399	天利科技	10,700	108,712.00	0.05
508	688590	新致软件	11,005	105,427.90	0.05
509	601138	工业富联	11,000	100,980.00	0.04
510	603527	众源新材	7,100	99,968.00	0.04
511	002582	好想你	10,500	99,855.00	0.04
512	002171	楚江新材	13,500	99,225.00	0.04
513	300963	中洲特材	6,500	98,670.00	0.04
514	300980	祥源新材	5,200	91,156.00	0.04
515	300248	新开普	9,800	86,240.00	0.04
516	001207	联科科技	6,300	85,365.00	0.04
517	603683	晶华新材	9,900	78,606.00	0.03
518	603357	设计总院	8,100	73,548.00	0.03
519	002540	亚太科技	13,900	70,473.00	0.03
520	600380	健康元	6,200	69,998.00	0.03
521	688455	科捷智能	5,277	69,234.24	0.03
522	000750	国海证券	19,100	63,603.00	0.03
523	002345	潮宏基	7,200	37,872.00	0.02
524	301269	华大九天	383	33,681.02	0.01
525	301175	中科环保	5,181	31,137.81	0.01
526	605177	东亚药业	1,400	28,028.00	0.01
527	600027	华电国际	4,500	26,460.00	0.01
528	301327	华宝新能	145	25,660.65	0.01
529	300279	和晶科技	5,000	24,700.00	0.01
530	688201	信安世纪	401	22,768.78	0.01
531	300407	凯发电气	2,700	19,386.00	0.01
532	600170	上海建工	7,000	18,200.00	0.01

533	601108	财通证券	2,200	15,664.00	0.01
534	301152	天力锂能	303	14,131.92	0.01
535	300419	浩丰科技	2,700	13,797.00	0.01
536	301165	锐捷网络	423	13,371.03	0.01
537	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.01
538	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.01
539	301377	鼎泰高科	732	12,905.16	0.01
540	688139	海尔生物	203	12,849.90	0.01
541	300776	帝尔激光	100	12,600.00	0.01
542	301112	信邦智能	399	12,404.91	0.01
543	301328	维峰电子	160	12,313.60	0.01
544	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
545	603151	邦基科技	535	11,256.40	0.00
546	001238	浙江正特	374	10,797.38	0.00
547	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
548	001222	源飞宠物	434	10,758.86	0.00
549	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
550	301280	珠城科技	229	10,259.20	0.00
551	301282	金禄电子	384	9,696.00	0.00
552	600323	瀚蓝环境	500	9,230.00	0.00
553	301349	信德新材	82	8,488.64	0.00
554	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
555	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
556	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
557	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
558	301265	华新环保	655	7,467.00	0.00
559	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
560	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
561	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
562	000961	中南建设	2,900	6,351.00	0.00
563	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
564	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
565	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
566	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
567	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
568	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
569	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
570	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
571	002895	川恒股份	200	5,214.00	0.00
572	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
573	688357	建龙微纳	40	4,436.00	0.00
574	002632	道明光学	600	3,828.00	0.00
575	688556	高测股份	40	3,000.80	0.00
576	600416	湘电股份	100	1,880.00	0.00

577	688396	华润微	30	1,579.50	0.00
578	688377	迪威尔	14	615.72	0.00
579	688580	伟思医疗	5	266.00	0.00

注：根据甘肃省电力投资集团有限责任公司于 2023 年 2 月 17 日发布的《关于变更公司证券简称的公告》，自 2023 年 2 月 17 日起，公司的证券简称由“甘肃电投”变更为“甘肃能源”，证券代码“000791”保持不变。

根据江苏金融租赁股份有限公司于 2023 年 1 月 4 日发布的《关于变更公司证券简称的实施公告》，自 2023 年 1 月 9 日起，公司的证券简称由“江苏租赁”变更为“江苏金租”，证券代码“600901”保持不变。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	44,137,169.00	9.83
2	300059	东方财富	36,767,502.14	8.19
3	601318	中国平安	15,977,790.00	3.56
4	603259	药明康德	15,708,221.80	3.50
5	300122	智飞生物	15,144,723.00	3.37
6	000568	泸州老窖	14,869,124.00	3.31
7	600036	招商银行	14,373,456.59	3.20
8	002271	东方雨虹	14,319,374.26	3.19
9	600030	中信证券	12,945,396.45	2.88
10	000858	五粮液	12,696,773.98	2.83
11	601688	华泰证券	11,897,573.00	2.65
12	600048	保利发展	10,880,135.00	2.42
13	601211	国泰君安	9,985,789.00	2.22
14	002594	比亚迪	9,739,943.80	2.17
15	600188	兖矿能源	9,512,669.00	2.12
16	002371	北方华创	9,369,008.00	2.09
17	601888	中国中免	9,299,805.00	2.07
18	300750	宁德时代	9,282,867.00	2.07
19	600887	伊利股份	8,999,110.63	2.00
20	601225	陕西煤业	8,901,889.00	1.98

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	50,315,631.76	11.20
2	300059	东方财富	41,266,134.67	9.19
3	600036	招商银行	24,443,359.85	5.44
4	603259	药明康德	23,794,391.42	5.30
5	000568	泸州老窖	20,508,693.62	4.57
6	000858	五粮液	17,060,379.00	3.80
7	300750	宁德时代	16,041,977.44	3.57
8	300122	智飞生物	14,208,926.73	3.16
9	600030	中信证券	13,676,260.70	3.05
10	002271	东方雨虹	13,206,923.95	2.94
11	601688	华泰证券	12,810,804.00	2.85
12	601318	中国平安	12,658,844.93	2.82
13	600048	保利发展	12,231,048.04	2.72
14	600887	伊利股份	11,491,458.36	2.56
15	002142	宁波银行	11,134,661.00	2.48
16	002812	恩捷股份	10,965,383.00	2.44
17	601225	陕西煤业	10,830,884.00	2.41
18	002594	比亚迪	10,809,405.95	2.41
19	300014	亿纬锂能	10,762,790.31	2.40
20	002371	北方华创	10,661,645.00	2.37
21	300274	阳光电源	9,580,376.00	2.13
22	600188	兖矿能源	9,578,508.07	2.13
23	002460	赣锋锂业	9,292,018.12	2.07
24	601888	中国中免	9,248,958.00	2.06

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,882,074,590.65
卖出股票的收入（成交）总额	1,998,317,835.54

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	14,728,050.35	6.33
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）	198,750.51	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,926,800.86	6.42

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	019679	22 国债 14	100,000	10,068,561.64	4.33
2	019638	20 国债 09	46,000	4,659,488.71	2.00
3	110088	淮 22 转债	1,450	169,791.78	0.07
4	113661	福 22 转债	230	28,958.73	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 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 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招商银行（600036），因违反账户管理规定、违反清算管理规定、违反特约商户实名制管理规定、违反支付机构备付金管理规定、违反人民币反假有关规定、占压财政存款或者资金、违反国库科目设置和使用规定等问题，于 2022 年 8 月 31 日被中国人民银行警告，没收违法所得 5.692641 万元，罚款 3423.5 万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：银行业整体信用水平高，且该银行为全国性大型银行，综合实力强，信用风险可控。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	1,269,282.96
2	应收清算款	73,861.45
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,004.01

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,346,148.42

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	245	241,568.92	56,988,242.89	96.29%	2,196,142.75	3.71%
海富通量化多因子混合 C	597	213,331.55	125,633,305.06	98.65%	1,725,630.22	1.35%
合计	842	221,547.89	182,621,547.95	97.90%	3,921,772.97	2.10%

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	364,097.29	0.6152%
	海富通量化多因子混合 C	1,151.97	0.0009%
	合计	365,249.26	0.1958%

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	0~10
	海富通量化多因子混合 C	0
	合计	0~10
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	10~50
	海富通量化多因子混合 C	0
	合计	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通量化多因子混合 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	47,503,976.11	197,302,641.35
本报告期基金总申购份额	88,054,980.87	85,246,325.20
减：本报告期基金总赎回份额	76,374,571.34	155,190,031.27
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	59,184,385.64	127,358,935.28

注：总申购份额含红利再投及转换入份额，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

报告期内，基金管理人、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 55,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 5 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	基金管理人及其高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2022-08-12
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	本基金管理人被采取责令改正并暂停受理及审核公司公募基金产品募集申请三个月的行政监管措施。相关高级管理人员对此负有责任,于 2022 年 7 月 26 日被出具警示函的行政监管措施。
受到稽查或处罚等措施的原因	中国证券监督管理委员会上海监管局对公司进行检查,指出公司在业务开展和内控管理中存在不足。
管理人采取整改措施的情况 (如提出整改意见)	公司已按法律法规和监管要求及时完成了整改并验收通过。
其他	-

11.6.2 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	
海通证券	2	1,136,929,550.41	29.48%	819,352.26	30.25%	-
东方证券	3	878,849,811.07	22.79%	642,702.59	23.73%	-
申万宏源	2	298,104,082.20	7.73%	126,043.28	4.65%	-
国联证券	2	269,099,566.70	6.98%	196,794.07	7.27%	-
民生证券	1	167,369,829.97	4.34%	122,396.79	4.52%	-
东吴证券	2	157,188,991.26	4.08%	114,262.24	4.22%	-
长江证券	2	136,050,636.81	3.53%	98,703.74	3.64%	-
东北证券	1	130,225,521.06	3.38%	92,631.79	3.42%	-
中泰证券(原齐鲁)	2	123,777,411.32	3.21%	90,517.62	3.34%	-
中信证券	4	117,974,095.23	3.06%	85,070.96	3.14%	-
中金公司	2	98,746,867.99	2.56%	72,213.41	2.67%	-
华泰证券	1	85,757,766.71	2.22%	62,712.75	2.32%	-
兴业证券	2	75,665,468.69	1.96%	54,578.61	2.02%	-
广发证券	2	57,407,116.27	1.49%	41,195.12	1.52%	-
浙商证券	2	40,975,896.95	1.06%	29,555.97	1.09%	-
德邦证券	2	34,779,626.53	0.90%	25,434.26	0.94%	-
方正证券	3	26,367,413.64	0.68%	18,755.04	0.69%	-
太平洋证券	2	20,990,646.10	0.54%	15,349.99	0.57%	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期新增德邦证券两个交易单元，广发证券一个交易单元，东方证券两个交易单元，太平洋证券两个交易单元，兴业证券两个交易单元，英大证券两个交易单元，浙商证券两个交易单元，方正证券两个交易单元，海通证券一个交易单元，中信证券两个交易单元。

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主观性评议，形成证券公司交易单元租用意见。

(2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门会议讨论，形成证券公司交易单元租用意见，并报公司总经理办公会核准。

<2> 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
海通证券	33,671.93	0.06%	-	-	-	-
东方证券	29,023,723.39	52.40%	60,000,000.00	9.90%	-	-
申万宏源	181,512.36	0.33%	-	-	-	-
国联证券	235,746.90	0.43%	110,000,000.00	18.15%	-	-
民生证券	-	-	85,000,000.00	14.03%	-	-
东吴证券	136,886.11	0.25%	145,000,000.00	23.93%	-	-
长江证券	-	-	40,000,000.00	6.60%	-	-
东北证券	15,792,807.21	28.51%	-	-	-	-
中泰证券(原齐鲁)	-	-	68,000,000.00	11.22%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券	9,677,885.10	17.47%	98,000,000.00	16.17%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

德邦证券	309,640.50	0.56%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

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公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-04
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增万联证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-06
3	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-07
4	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-07
5	海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-25
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增广发证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-03-01
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-03-29
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中邮证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-01
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分	证券时报、基金管理	2022-05-09

	基金新增招商银行招赢通为销售平台的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增英大证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-12
11	海富通基金管理有限公司关于终止与北京植信基金销售有限公司销售合作关系的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-30
12	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、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-31
13	海富通基金管理有限公司关于调整公募基金产品适当性风险等级划分方法的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-16
14	海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金第一次分红公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-06-25
15	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华宝证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-08-26
16	海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购和转换转入业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-09-07
17	海富通基金管理有限公司关于提醒投资者警惕虚假 APP、客服热线诈骗的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-09-21
18	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-09-22
19	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增财通证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-09-28
20	海富通基金管理有限公司关于网上直销平台开通交通银行快捷支付业务并开展	证券时报、基金管理人网站及中国证监	2022-11-19

	申购费率优惠活动的公告	会基金电子披露网站	
21	海富通基金管理有限公司关于调整旗下部分基金场外份额单笔申购、单笔追加申购、单笔定期定额申购、单笔赎回和持有份额最低数量限制的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-12-13

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022/1/1-2022/5/19,2022/11/21-2022/12/31	61,683,210.30	-	16,000,000.00	45,683,210.30	24.49%
	2	2022/12/15-2022/12/31	32,624,109.62	5,466,582.64	-	38,090,692.26	20.42%
	3	2022/5/17-2022/11/20	-	67,027,950.94	67,027,950.94	-	-
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；</p> <p>2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能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。</p> <p>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。</p> <p>4、其他可能的风险。</p> <p>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。</p>							

注：报告期内单一投资者申购赎回份额包含红利再投资数据。

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 109 只公募基金。截至 2022 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1410 亿元人民币。

海富通基金管理有限公司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。2012 年 9 月，中国保监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。

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。

2020 年 3 月，由《中国证券报》主办的第十七届中国基金业金牛奖评选结果揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金牛进取奖”，海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”奖项。2020 年 7 月，由《上海证券报》主办的第十七届金基金奖名单揭晓，海富通基金管理有限公司荣获“金基金·股票投资回报基金管理公司奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混合型证

券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。2022 年 9 月，海富通荣获“IAMAC 推介·2021 年度保险资产管理业最受欢迎投资业务合作机构——最具进取基金公司”。2022 年 11 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

§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)法律法规及中国证监会规定的其他文件

13.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇二三年三月三十一日