

海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金 清算报告

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

清算报告出具日期：二〇二五年四月二十四日

清算报告公告日期：二〇二五年五月十六日

§1 重要提示

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]1276号文准予注册募集。本基金于2021年5月31日经中国证监会《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变更注册的批复》（证监许可【2021】1897号文）准予变更注册。基金管理人为海富通基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”），基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“基金托管人”）。本基金的基金合同于2018年4月23日正式生效。基金类型为契约型、开放式。

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》、《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》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，本基金基金管理人于2025年3月4日至2025年4月3日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于终止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有关事项的议案》（以下简称“本次大会议案”），并于2025年4月7日表决通过了本次大会议案，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。基金管理人按照《基金合同》约定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。本基金的最后运作日为2025年4月8日，并于2025年4月9日进入清算期。

基金管理人、基金托管人、毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所于2025年4月9日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）对本基金进行清算审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

§2 基金产品概况

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	
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	
基金最后运作日（2025年4月8日） 基金份额总额	947,549.78份	
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
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	1、资产配置策略：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；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、杠杆策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略。	
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。	
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	

§3 基金运作情况概述

本基金经中国证监会证监许可[2017]1276号文准予注册募集，本基金于2021年5月31日经中国证监会《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变更注册的批复》（证监许可【2021】1897号文）准予变更注册。本基金为契约型、开放式证券投资基金，基金简称为海富通量化多因子混合A（基金代

码：005081），海富通量化多因子混合 C（基金代码：005080）。《基金合同》于 2018 年 4 月 23 日正式生效，共募集 229,267,089.64 份基金份额。

依据《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《基金合同》的有关规定，《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露。连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召开基金份额持有人大会。基金管理人已就上述情形拟定了终止《基金合同》的解决方案，经与基金托管人协商一致并履行规定程序，于 2025 年 3 月 4 日至 2025 年 4 月 3 日期间以通讯方式召开基金份额持有人大会，并于 2025 年 4 月 7 日表决通过了《关于终止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有关事项的议案》。

根据《基金合同》及相关公告约定，本基金的最后运作日确定为 2025 年 4 月 8 日，清算期间为 2025 年 4 月 9 日至 2025 年 4 月 24 日。

§4 财务报告

4.1 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：2025 年 4 月 8 日

单位：人民币元

资产	基金最后运作日 2025年4月8日
资产：	
货币资金	80,207.15
结算备付金	16,146.81
存出保证金	663.20
交易性金融资产	1,008,334.13

其中：股票投资	805,293.53
基金投资	-
债券投资	203,040.60
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收清算款	141,415.96
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	17,742.52
资产总计	1,264,509.77
负债和净资产	基金最后运作日 2025年4月8日
负债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付清算款	-
应付赎回款	1,778.40
应付管理人报酬	351.00
应付托管费	58.49
应付销售服务费	97.58
应付投资顾问费	-
应交税费	0.62
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	128,438.78
负债合计	130,724.87
净资产：	
实收基金	947,549.78

未分配利润	186,235.12
净资产合计	1,133,784.90
负债和净资产总计	1,264,509.77

注：截止本基金最后运作日2025年4月8日，基金份额总额947,549.78份。其中海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金A类基金份额总额545,522.30份，基金份额净值1.2126元；海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金C类基金份额总额402,027.48份，基金份额净值1.1748元。

4.2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

报告期间：2025年1月1日至2025年4月8日(基金最后运作日)

项目	本期 2025年1月1日至2025年4月 8日(基金最后运作日)
一、营业总收入	-64,312.18
利息收入	735.75
其中：存款利息收入	237.36
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	498.39
其他利息收入	-
投资收益(损失以“-”填列)	26,792.72
其中：股票投资收益	24,860.72
基金投资收益	-
债券投资收益	747.23
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	1,184.77
其他投资收益	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-99,346.09

汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
其他收入(损失以“-”号填列)	7,505.44
减：二、营业总支出	7,122.97
管理人报酬	4,606.20
其中：暂估管理人报酬（若有）	-
托管费	767.71
销售服务费	1,511.55
投资顾问费	-
利息支出	94.28
其中：卖出回购金融资产支出	94.28
信用减值损失	-
税金及附加	1.78
其他费用	141.45
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-71,435.15
减：所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-71,435.15
五、其他综合收益的税后净额	-
六、综合收益总额	-71,435.15

注：本财务报告已经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师王国蓓、何晨签字出具了毕马威华振审字第2512146号标准无保留意见的审计报告。

§5 清算情况

自 2025 年 4 月 9 日至 2025 年 4 月 24 日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日结算备付金金额 16,146.81 元，其中存放于中国证券

登记结算有限责任公司的上交所最低结算备付金为 10,569.56 元，应计利息为 1.80 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司的深交所最低结算备付金为 735.75 元，应计利息为 0.18 元；存放于海通期货备付金为 1,382.48 元，应计利息为 0.90 元；存放于东证期货备付金为 3,417.92 元，应计利息为 2.52 元；存放于国泰君安期货备付金为 35.70 元。上述款项中上交所和深交所最低结算备付金将于 2025 年 6 月初最低结算备付金调整后全部划回托管账户，应计利息将于每季度最低备付金结息后划回托管账户。截至 2025 年 4 月 18 日，期货备付金账户余额及应计利息已全部划回托管账户。

5.1.2 本基金最后运作日存出保证金金额 663.20 元，其中存放于中国证券登记结算有限责任公司的上交所存出保证金为 228.13 元，应计利息为 0.24 元；存放于中国证券登记结算有限责任公司的深交所存出保证金为 434.71 元，应计利息为 0.12 元。上述款项中上交所和深交所的保证金将于 2025 年 5 月初全部划回托管账户，应计利息将于每季度保证金结息后划回托管账户。

5.1.3 本基金最后运作日交易性金融资产为股票资产和债券资产，市值分别为 805,293.53 元和 203,040.60 元。股票资产已于 2025 年 4 月 9 日至 2025 年 4 月 21 日全部变现，卖出成交金额 817,774.53 元，交易费用 848.43 元。债券资产已于 2025 年 4 月 9 日至 2025 年 4 月 10 日全部变现，卖出成交总额 203,034.02 元，交易费用 0.00 元。截至 2025 年 4 月 22 日，上述变现金额已全部划回托管账户。

5.1.4 本基金最后运作日应收清算款金额 141,415.96 元，分别于 2025 年 4 月 9 日、2025 年 4 月 11 日划回托管账户。

5.1.5 本基金最后运作日其他资产为其他应收款，金额 17,742.52 元，于 2025 年 4 月 23 日划入托管账户。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款人民币 1,778.40 元，已于 2025 年 4 月 10 日支付完毕。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬 351.00 元，已于 2025 年 4 月 23 日支付完毕。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费 58.49 元，已于 2025 年 4 月 23 日支付完毕。

5.2.4 本基金最后运作日的应付销售服务费人民币 97.58 元，已于 2025 年 4 月 23 日支付完毕。

5.2.5 本基金最后运作日的应交税费人民币 0.62 元，已于 2025 年 4 月 22 日支付完毕。

5.2.6 本基金最后运作日其他负债 128,438.78 元，其中包括：

5.2.6.1 应付交易佣金人民币 384.16 元，已分别于 2025 年 4 月 15 日、2025 年 4 月 22 日支付完毕。

5.2.6.2 应付审计费 48,054.62 元，已于 2025 年 4 月 23 日支付完毕。

5.2.6.3 应付信息披露费 80,000.00 元，已于 2025 年 4 月 23 日支付完毕。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自2025年4月9日至2025年4月24日（清算期截止日）止
一、清算收益	
1、利息收入（注 1）	154.60
2、股票变现损益（注 2）	11,052.92
3、债券变现损益（注 3）	-6.58
清算收入小计	11,200.94
二、清算费用	
1、银行汇划手续费（注 4）	93.00
2、其他费用（注 5）	0.08
清算费用小计	93.08
三、清算净收益	11,107.86

注：（1）利息收入金额 154.60 元，系以当前适用利率计提的自 2025 年 4 月 9 日至 2025 年 4 月 24 日止清算期间的银行存款利息、结算备付金利息收入。

（2）股票变现损益为本次清算期间股票资产卖出金额与最后运作日股票资产市值的差额，包含了交易费用及卖出股票补缴红利税金额。

(3) 债券变现损益为本次清算期间债券资产卖出总额与最后运作日债券资产市值的差额。

(4) 本基金清算期间发生的上述银行汇划手续费 93.00 元，从基金财产中支付。

(5) 本基金清算期间发生的其他费用为沪港通证券组合费，从基金财产中支付。

5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2025年4月8日基金净资产	1,133,784.90
加：清算期间净收益	11,107.86
减：基金赎回转出金额（于2025年4月9日确认投资者赎回转出申请）	27,962.73
二、2025年4月24日基金剩余资产净值	1,116,930.03

注：资产处置及负债清偿后，本基金截至 2025 年 4 月 24 日的剩余财产净额为人民币 1,116,930.03 元。根据本基金的基金合同及《海富通基金管理有限公司关于海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金管理人将基金财产清算后的全部剩余净资产按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

自 2025 年 4 月 24 日至清算款划出前一日的银行存款、结算备付金、存出保证金产生的利息亦属基金份额持有人所有。为保护基金份额持有人利益，加快清盘速度，基金管理人将先行垫付尚未收回的最低备付金及其应计利息、存出保证金及其应计利息和应计银行存款利息供清盘分配使用，基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

5.5 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规、基金合同等规定及时进行分配。

§6 备查文件

6.1 备查文件目录

- 1、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金清算财务报告及审计报告
- 2、关于《海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人的办公场所免费查阅。

海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金
基金财产清算小组

二〇二五年四月二十四日