海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30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:二〇一八年八月二十四日

1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月23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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月23日(基金合同生效日)起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通量化多因子混合	
基金主代码	005980	
交易代码	005980	
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	24,867,207.69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	005981	005980
报告期末下属分级基金的份额总额	15,564,943.32份	9,302,264.37份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	葛方安	郭明
	联系电话	021-38650891	010-66105799
	电子邮箱	wxx@hftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95588
传真		021-33830166	010-66105799

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年4月23日(基金合同生效日)至2018年6月30日)	
	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	304,765.35	107,253.24
本期利润	-130,759.45	425,000.82
加权平均基金份额本期利润	-0.0059	0.0041
本期基金份额净值增长率	-2.11%	-2.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
	海富通量化多因子混合A	海富通量化多因子混合C
期末可供分配基金份额利润	-0.0211	-0.0252
期末基金资产净值	15,235,926.30	9,067,638.17
期末基金份额净值	0.9789	0.9748

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

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	-3.38%	1.24%	-4.42%	0.75%	1.04%	0.49%
自基金合同生效起至今	-2.11%	0.84%	-5.41%	0.74%	3.30%	0.10%

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
过去一个月	-3.69%	1.22%	-4.42%	0.75%	0.73%	0.47%
自基金合同生效起至今	-2.52%	0.83%	-5.42%	0.74%	2.90%	0.09%

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2018年6月30日)

2. 海富通量化多因子混合C

(2018年4月23日至2018年6月30日)

注:1.本基金合同于2018年4月23日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.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。截止本报告期末,本基金尚处于建仓期。

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2018年6月30日,本基金管理人共管理54只公募基金:海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证100指数证券投资基金(LOF)、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业100交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通安顺收益混合型证券投资基金(原海富通养老收益混合型证券投资基金)、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通双福债券型证券投资基金、海富通季季增利理财债券型证券投资基金、上证可质押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、海富通瑞丰一年定期开放债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金(LOF)、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通富睿混合型证券投资基金、海富通欣悦灵活配置混合型证券投资基金、海富通季季通利理财债券型证券投资基金、海富通瑞福一年定期开放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)、海富通量化前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。

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		
陈戬暄	本基金的基金经理;海富通车财大数据混合基金经理;海富通阿尔法对冲混合基金经理;海富通信息混合基金经理;海富通欣享混合基金经理;海富通欣益混合基金经理;海富通创业板增强基金经理;时任量化投资部总监。	2018-04-23	2018-05-03	10年	硕士,持有基金从业人员资格证书,历任复旦金融法律顾问有限公司高级顾问师资,国泰君安证券股份有限公司量化分析师,历任海富通基金管理有限公司量化分析师,投资经理,量化投资部副总监,量化投资部总监。2014年11月至2018年6月任海富通阿尔法对冲混合基金经理,2015年4月至2016年6月兼任海富通月月收益混合、海富通富安顺收益混合(原海富通养老收益混合)和海富通新内需混合基金经理,2016年1月至2018年5月兼任海富通长青大数据混合基金经理,2016年9月至2018年5月兼任海富通稳定混合基金经理,2017年3月至2018年5月兼任海富通欣享混合基金经理,2018年2月至2018年5月兼任海富通量化前锋股票基金经理,2018年4月至2018年5月兼任海富通创业板增强基金经理。海富通量化多因子混合基金经理。
杜晓海	本基金的基金经理;海富通安顺收益混合基金经理;海富通新内需混合基金经理;海富通欣荣混合基金经理;海富通富睿混合基金经理;海富通欣悦混合基金经理;海富通时代法对冲混合基金经理;海富通强化稳健基金经理;海富通长青大数据混合基金经理;海富通量化前锋股票基金经理;海富通量化增利基金经理;海富通欣享混合基金经理;海富通量化回报基金经理;海富通欣益混合基金经理;海富通量化创新板指增强基金经理;量化投资部总监。	2018-04-23	-	18年	硕士,持有基金从业人员资格证书,历任Man-Drapeau Research金融工程师、American Bourses Corporation中国区总经理,海富通基金管理有限公司量化分析师,高级定量分析师,定量投资管理助理人,定量及风险管理总监,多资产策略投资部总监,现任海富通基金管理有限公司量化投资部总监。2016年8月起任海富通新内需混合基金经理,2016年8月起任海富通富睿混合基金经理,2016年9月起任海富通欣悦混合基金经理,2016年9月起任海富通时代法对冲混合基金经理,2017年4月至2018年1月兼任海富通欣荣混合基金经理,2017年4月至2018年1月兼任海富通欣益混合基金经理,2018年3月起任海富通富祥混合基金经理,2018年4月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通信息混合、海富通强化稳健、海富通长青大数据混合、海富通量化增利、海富通欣享混合、海富通量化回报混合、海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理助理。
朱斌全	本基金的基金经理助理;海富通安顺收益混合(原海富通养老收益混合)基金经理助理;海富通新内需混合基金经理助理;海富通富睿混合基金经理助理;海富通欣悦混合基金经理助理;海富通时代法对冲混合基金经理助理;海富通欣享混合基金经理助理;海富通欣益混合基金经理助理;海富通量化稳健基金经理助理;海富通量化增利基金经理助理;海富通量化回报混合基金经理助理;海富通量化前锋股票基金经理助理。	2018-05-15	-	11年	博士研究生,CFA,持有基金从业人员资格证书,历任上海世纪期货投资管理有限公司交易投资主管兼,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,量化投资部投资经理,2018年5月起任海富通安顺收益混合(原海富通养老收益混合)基金经理助理,海富通新内需混合基金经理助理,海富通富睿混合基金经理助理,海富通欣悦混合基金经理助理,海富通时代法对冲混合基金经理助理,海富通欣享混合基金经理助理,海富通欣益混合基金经理助理,海富通量化稳健基金经理助理,海富通量化增利基金经理助理,海富通量化回报混合基金经理助理,海富通量化前锋股票基金经理助理。

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为: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 公平交易制度的执行情况

公司根据证监会2011年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求,持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内、境外上市股票、债券、基金的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时,公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立,确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2018年上半年,A股市场整体呈现震荡下跌的走势,各大指数全线下挫,上证综指收于2847.42点,上半年下跌13.90%,深证成指报9379.47点,跌幅达15.04%。中小板指和创业板指分别报收6477.76点和1606.71点,分别下挫14.26%和8.33%。

具体来看,年初沪指迎来开门红,市场情绪高涨,上冲至年内最高点3587.03点后开始回调。受到美股负面以及信托资金降杠杆影响,2月市场经历了深度回调,直至春节前才企稳反弹,市场风格也由前期表现强势的价值白马股切换至成长股。随后市场呈现区间震荡走势,3月下旬受美联储加息叠加贸易摩擦影响,市场避险情绪浓厚,股指开始出现回调。4月市场持续疲弱,但仍表现出一定的结构性行情,医药、钢铁等板块表现亮眼。5月在资管新规落地、A股正式启动纳入MSCI以及中美贸易磋商取得进展等多重利好下,主要指数震荡上行。随后美国单方面再挑贸易战使得市场悲观情绪加剧,指数开启震荡下行态势。6月延续了5月的悲观情绪,各大指数持续下探,全月跌幅明显。

行业方面,在29个申信一级行业分类中,仅餐饮旅游(10.15%)、医药(4.46%)和食品饮料(1.82%)录得涨幅,其余行业均呈现下跌,综合(-32.13%)、电力设备(-27.00%)和通信(-26.66%)跌幅居前。

本报告期,本基金积极投资股票市场,力争在风险可控的基础上,跑赢市场。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,海富通量化多因子混合A净值增长率为-2.11%,同期业绩比较基准收益率为-5.41%,基金净值跑赢业绩比较基准3.30个百分点。海富通量化多因子混合C净值增长率为-2.52%,同期业绩比较基准收益率为-5.42%,基金净值跑赢业绩比较基准2.90个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年以来,中国经济持续面临内外部的考验,内部压力主要来自去杠杆政策延续对于实体部门信用的收缩,而外部压力主要来自于中美贸易争端对出口端的影响,以及美联储持续加息以及中美利差倒挂的冲击。不过,2018年7月以来宏观政策发生了一定变化,央行通过窗口指导,给予额外的MLF资金用于支持铁路投放和信用债投资;资管新规细则出台,公募理财产品门槛从5万降低至1万,银行理金类产品允许摊余成本估值,过渡期内金融机构自主可控确定整改计划,公募产品在期限匹配、限额管理的前提下可以投资非标,这一系列细节上的宽松适度缓解了银行处置非标和委外的压力;7月23日召开的国务院常务会议提出积极财政政策要更加积极,稳健的货币政策要松紧适度。

展望下半年,在货币、财政政策综合作用下,我们认为中国经济虽然仍有下行压力,但政策对冲之后下行压力会有所减轻。尽管出口端受到贸易战影响可能有一定幅度下滑,但基建投资适度扩张带来的固定资产投资企稳和减税政策带来的民营投资、居民消费回暖可以保障中国经济平稳运行。此外,我们认为政策的目的是托住经济,而非强刺激。

对于下半年的资本市场,我们认为受益于政策放松,风险偏好会从目前极低的水平企稳甚至回升,流动性也会缓解。市场不会再陷入之前由于巨大不确定性带来的恐慌之中。市场结构方面,龙头企业在各自行业内竞争力强化、强者恒强的格局将延续,长期看这些龙头企业将构筑成中国经济的"核心资产";以创业板为代表的新兴成长行业经历了几年持续调整压力,部分细分行业的景气开始具备相对比较优势,如果中报业绩增速能够得到验证,并且下半年的业绩趋势仍可持续,那么有可能成为市场新的优势板块。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会,组成人员包括主管基金运营的公司领导、投资管理负责人、合规负责人、风险管理负责人及基金会计工作负责人等,以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会工作小组,估值工作小组对经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件进行评估,充分听取相关部门的建议,并和托管人充分协商后,向估值委员会提交估值建议报告,以便估值委员会决策。基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

一、本基金本报告期内无应分配的收益。

二、已实施的利润分配:无。

三、不存在应分配但尚未实施的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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。本报告期内,海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半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2018年半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 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:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日
资产:		
银行存款	6.4.7.1	1,498,595.16
结算备付金		990,316.48
存出保证金		10,998.89
交易性金融资产	6.4.7.2	20,134,955.80
其中:股票投资		18,629,255.80
基金投资		-
债券投资		1,505,700.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,200,000.00
应收证券清算款		205,788.88
应收利息	6.4.7.5	15,055.66
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		25,055,710.87
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		334,650.16
应付赎回款		218,615.27
应付管理人报酬		43,386.19
应付托管费		7,231.03
应付销售服务费		10,373.04
应付交易费用	6.4.7.7	47,890.06
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	90,000.65
负债合计		752,146.40
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	24,867,207.69
未分配利润	6.4.7.10	-563,643.22
所有者权益合计		24,303,564.47
负债和所有者权益总计		25,055,710.87

注:1.报告截止日2018年06月30日,基金份额总额24,867,207.69份,其中海富通量化多因子A类份额15,564,943.32份,海富通量化多因子C类份额9,302,264.37份。A类份额净值0.9789元,C类份额净值0.9748元。

2.基金合同成立于2018年4月23日,上年度可比区间无比较数据。

3.本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解相应附注的内容,应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 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:2018年4月23日(基金合同生效日)至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年4月23日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、收入		1,049,376.10
1.利息收入		550,417.08
其中:存款利息收入	6.4.7.11	207,708.50
债券利息收入		64,881.07
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		277,827.51
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		576,524.99
其中:股票投资收益	6.4.7.12	416,628.66
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-13,902.07
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	173,798.40
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.17	-117,777.22
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6.4.7.18	40,211.25
减:二、费用		755,134.73
1.管理人报酬		368,440.15
2.托管费		61,406.70
3.销售服务费		162,434.94
4.交易费用	6.4.7.19	71,949.48
5.利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用		-
7.其他费用	6.4.7.20	90,903.46
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		294,241.37
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		294,241.37

注:本财务报表的实际编制期间为2018年4月23日(基金合同生效日)至2018年6月30日,上年度可比区间无比较数据。

6.3 所有权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年4月23日(基金合同生效日)至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年4月23日(基金合同生效日)至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	229,267,089.64	-	229,267,089.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	294,241.37	294,241.37
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-204,399,881.95	-857,884.59	-205,257,766.54
其中:1.基金申购款	228,074.84	1,604.38	229,679.22
2.基金赎回款	-204,627,956.79	-859,488.97	-205,487,445.76
四、本期末基金份额所有人净值变动情况(其中:本期末基金份额总数净值变动情况以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	24,867,207.69	-563,643.22	24,303,564.47

注:本财务报表的实际编制期间为2018年4月23日(基金合同生效日)至2018年6月30日,上年度可比区间无比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

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

6.4 报表附注

6.4.1 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,而且从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、地方政府债、中小企业私募债及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、金融衍生品(包括权证、股指期货等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为0%至95%,权证资产占基金资产净值的0%至3%,在每个交易日日终,扣除股指期货合约须缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于2018年8月24日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、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6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年4月23日(基金合同生效日)至2018年6月30日止期间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2018年06月30日的财务状况以及2018年4月23日(基金合同生效日)至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为2018年4月23日(基金合同生效日)至2018年6月30日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2)金融负债的分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不可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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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确认。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资