

**海富通量化前锋股票型证券投资基金**  
**2019 年半年度报告**  
**2019 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十八日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	15
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	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48

<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	50
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	50
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	53
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	54
<b>§12 备查文件目录</b> .....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通量化先锋股票型证券投资基金	
基金简称	海富通量化先锋股票	
基金主代码	005188	
交易代码	005188	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2018 年 2 月 8 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	60,352,903.04 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C
下属分级基金的交易代码	005189	005188
报告期末下属分级基金的份额总额	57,913,600.31 份	2,439,302.73 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过多因子量化模型方法，精选股票进行投资，在严格控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金，在进行资产配置决策时，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，在本基金的投资比例范围内对组合中股票、债券等资产的仓位进行调整。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	奚万荣	王永民
	联系电话	021-38650891	010-66594896

	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		杨仓兵	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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（2019年1月1日至2019年6月30日）	
	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C
本期已实现收益	5,773,070.28	257,690.24
本期利润	15,525,483.67	699,250.76

加权平均基金份额本期利润	0.2182	0.2244
本期加权平均净值利润率	23.57%	23.88%
本期基金份额净值增长率	21.97%	21.73%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2019 年 6 月 30 日)</b>	
	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C
期末可供分配利润	-1,874,758.11	-50,888.86
期末可供分配基金份额利润	-0.0324	-0.0209
期末基金资产净值	57,027,753.58	2,434,733.83
期末基金份额净值	0.9847	0.9981
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2019 年 6 月 30 日)</b>	
	海富通量化先锋股 票 A	海富通量化先锋股票 C
基金份额累计净值增长率	-1.53%	-0.19%

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

海富通量化先锋股票 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	4.62%	1.28%	0.71%	1.11%	3.91%	0.17%
过去三个月	-1.08%	1.49%	-8.51%	1.45%	7.43%	0.04%
过去六个月	21.97%	1.44%	15.67%	1.44%	6.30%	0.00%
过去一年	0.19%	1.38%	-2.65%	1.35%	2.84%	0.03%
自基金合同	-1.53%	1.22%	-8.87%	1.30%	7.34%	-0.08%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

## 海富通量化先锋股票 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	4.58%	1.28%	0.71%	1.11%	3.87%	0.17%
过去三个月	-1.19%	1.49%	-8.51%	1.45%	7.32%	0.04%
过去六个月	21.73%	1.44%	15.67%	1.44%	6.06%	0.00%
过去一年	2.01%	1.39%	-2.65%	1.35%	4.66%	0.04%
自基金合同 生效起至今	-0.19%	1.23%	-8.87%	1.30%	8.68%	-0.07%

### 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

海富通量化先锋股票型证券投资基金

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. 海富通量化先锋股票 A

(2018 年 2 月 8 日至 2019 年 6 月 30 日)





## 2. 海富通量化先锋股票 C

(2018 年 2 月 8 日至 2019 年 6 月 30 日)



注：本基金合同于 2018 年 2 月 8 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。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 61 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证周期行业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通大中华精选混合型证券投资基金、上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金、海富通上证非周期行业 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证内地低碳经济主题指数证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、海富通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、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通富祥混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、上证周期产业债交易型开放式指数证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通富睿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、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通聚丰纯债债券型证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）。

## 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杜晓海	本基金的基金经理；海富通安颐收益混合基金经理；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；海富通富祥混合基金经理；海富通阿尔法对冲混合基金经理；海富通创业板增强基金经理；海富通稳固收益债券基金经理；海富通欣享混合基金经理；海富通欣益混合基金经理；海富通量化多因子混合基金经理；海富通研究精选混合基金经理；量化投资部总监	2018-04-09	-	19 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定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监，现任海富通基金管理有限公司量化投资部总监。2016 年 6 月起任海富通新内需混合和海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 5 月起兼任海富通富睿混合基金经理。2018 年 3 月起兼任海富通富祥混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强、海富通量化先锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合、海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月起兼任海富通研究精选混合基金经理。

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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

2019 年上半年 A 股市场出现了明显涨幅。截至 2019 年 6 月 30 日，上证综指收于 2978.88 点，上半年上涨 19.45%，深证成指收于 9178.31 点，上涨幅度为 26.78%。中小板指收于 5678.75 点，上涨 20.75%，创业板上涨 20.87%，报 1511.51 点。

具体来看，自从 1 月 4 日上证综指盘中触及近三年新低 2440.91 点之后，市场便开始温和反弹，一直延续到月底，1 月份上证综指涨幅 3.64%。板块上，家电、食品饮料、保险、银行等价值权重板块率先企稳反弹，涨幅居前。进入 2 月份，随着困扰 2018 年的几大利空因素均有所缓解：中美贸易摩擦的积极向好谈判、监管层对去杠杆告一段落等，2 月份上证综指涨幅达到 13.79%，创近几年新高。同时随着 2 月末两市单日总成交量放大到万亿、融资余额回到 8000 亿以上，市场风险偏好大幅上升。趋势延续到 3 月，当月上证综指上涨 5.09%，表现依旧不错。进入二季度，一季度大幅上涨之后，4 月份存在一定的调整压力。因此在月初上证综指触及短期新高 3288.45 点之后，便开始区间震荡。同时月底贸易谈判陷入僵局，指数也开始出现回调。4 月份上证综指下跌 0.4%。5 月月初随着中美贸易谈判陷入僵局，以及对国内宏观经济下行压力的预期，市场出现

了大幅回调，单 5 月份上证综指下跌 5.84%，深证成指下跌 7.77%。板块上看，仅有以黄金为代表的有色板块涨幅 2.2%，其他板块悉数下跌，其中禽畜产业链、食品饮料等相对跌幅较少，而 TMT 板块、券商等高弹性板块跌幅居前。进入 6 月份之后，虽然 4-5 月份的宏观经济数据依旧没有改善预期，但随着对中美 G20 重启贸易谈判的预期，市场逐步开始筑底回升，风险偏好有所提升，单 6 月上证综指上涨 2.77%。

行业方面，在申万 28 个一级行业分类中，上半年均录得涨幅，单板块间差异巨大。其中食品饮料（61.01%）、非银金融（43.83%）、农林牧渔（41.96%）、家电（37.82%）、计算机（32.77%）涨幅排名前五，且都涨幅超过 30%。而建筑装饰（4.16%）、钢铁（5.04%）、传媒（7.79%）、纺织服装（9.27%）、汽车（10.03%）涨幅靠后。

本报告期，基金积极投资股票市场，力争在风险可控的基础上，跑赢市场。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通量化先锋 A 净值增长率为 21.97%，同期业绩比较基准收益率为 15.67%，基金净值跑赢业绩比较基准 6.30 个百分点。海富通量化先锋 C 净值增长率为 21.73%，同期业绩比较基准收益率为 15.67%，基金净值跑赢业绩比较基准 6.06 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

2019 年初，市场对经济的担忧有所缓解。外部中美贸易摩擦暂缓，并貌似朝着达成协议的方向演进。内部政策宽松，降准、地方债发行前置、信贷周期回暖，资产价格预期企稳。2019 年 4 月中旬，国内外不确定性上升。4 月中旬起国内政策边际收紧，5 月初中美局势恶化，5 月 24 日包商银行被接管，中小银行结构性去杠杆。市场风险偏好显著回落。2019 年 6 月中旬，中美领导人通电话，确定 G20 见面，市场预期谈判重启；美联储 6 月议息会议释放鸽派信号；证监会就修改《上市公司重大资产重组管理办法》征求意见，市场风险偏好迅速提升。上半年的行情基本上来源于估值修复。

下半年，国内宏观经济增长压力仍在。一季度在信贷及社融扩张提振下，经济增长体现一定韧性，但随着外部中美贸易摩擦带来的负面效果更大范围地显现，内部房地产市场可能逐步降温、基建增速制约重重、中小银行去杠杆对实体经济的影响尚未完全体现等，中国经济增长在 2019 年下半年仍将面临压力。同时，从政策角度看，下半年宏观政策倾向将维持宽松，尤其是三季度将在边际上较二季度宽松。但在高杠杆环境以及结构性去杠杆政策背景制约下，政策效果有待验证。同时，包商银行事件后，流动性出现分层，中小银行及非银机构融资困难程度及成本上升，为避免出现局部风险，预计货币政策将采取进一步措施缓解结构性流动性压力。

从中期角度，我们依旧对下半年的资本市场保持相对乐观。我们认为估值的变化依然是核心变量，仍存在修复机会。估值端来自无风险利率下行带来的修复机会较为确定，风险偏好短期将出现抬升，但后续存在不确定性，整体上市场环境好于二季度，策略上更加积极，但需留意市场可能会阶段性对业绩下滑做出负面反应。从行业角度看，我们

认为科技、消费、金融等板块有望持续跑出超额收益，包括计算机、半导体、5G、食品饮料、医药、券商、银行等。

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，通过在各行各业中精选估值合理的优质个股，力争稳健跑赢市场。

#### 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。估值委员会下设估值工作小组，估值工作小组对经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.7 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在海富通量化先锋股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：海富通量化先锋股票型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	2,991,710.96	4,615,960.74
结算备付金		1,312,674.59	3,397,592.67
存出保证金		368,027.86	155,267.39
交易性金融资产	6.4.7.2	55,812,281.93	63,544,536.28
其中：股票投资		53,415,353.93	59,380,153.88
基金投资		-	-
债券投资		2,396,928.00	4,164,382.40
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	-	3,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	25,216.15	117,160.71

应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>60,509,911.49</b>	<b>74,830,517.79</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
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		860,230.94	2,986,570.46
应付赎回款		-	15,934.36
应付管理人报酬		70,498.75	93,029.85
应付托管费		11,749.81	15,504.97
应付销售服务费		782.14	1,043.74
应付交易费用	6.4.7.7	31,181.08	66,197.90
应交税费		0.33	1.04
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	72,981.03	250,000.00
负债合计		1,047,424.08	3,428,282.32
<b>所有者权益：</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	6.4.7.9	60,352,903.04	88,389,896.02
未分配利润	6.4.7.10	-890,415.63	-16,987,660.55
所有者权益合计		59,462,487.41	71,402,235.47
负债和所有者权益总计		60,509,911.49	74,830,517.79

注：注：报告截止日 2019 年 06 月 30 日，基金份额总额 60,352,903.04 份，其中海富通量化先锋股票 A 类份额 57,913,600.31 份，海富通量化先锋股票 C 类份额 2,439,302.73 份。A 类份额净值 0.9847 元，C 类份额净值 0.9981 元。



## 6.2 利润表

会计主体：海富通量化先锋股票型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 2 月 8 日(基 金合同生效日) 至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>17,064,233.59</b>	<b>914,748.14</b>
1.利息收入		83,447.90	1,503,250.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	27,547.93	371,513.77
债券利息收入		50,980.87	155,208.55
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,919.10	976,528.60
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,786,614.52	208,079.47
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,258,190.01	-15,522.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	183,165.29	616.49
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	609,360.39	-445,520.00
股利收益	6.4.7.16	735,898.83	668,505.10
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	10,193,973.91	-1,226,387.01
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	197.26	429,804.76
<b>减：二、费用</b>		<b>839,499.16</b>	<b>1,625,965.39</b>
1. 管理人报酬		510,580.33	1,036,528.98
2. 托管费		85,096.72	172,754.84
3. 销售服务费		5,791.28	50,618.61
4. 交易费用	6.4.7.19	160,540.36	201,254.77
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6.税金及附加		2,050.94	-
7. 其他费用	6.4.7.20	75,439.53	164,808.19
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>16,224,734.43</b>	<b>-711,217.25</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>16,224,734.43</b>	<b>-711,217.25</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：海富通量化先锋股票型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	88,389,896.02	-16,987,660.55	71,402,235.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,224,734.43	16,224,734.43
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）	-28,036,992.98	-127,489.51	-28,164,482.49
其中：1.基金申购款	177,419.09	-10,457.13	166,961.96
2.基金赎回款	-28,214,412.07	-117,032.38	-28,331,444.45
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	60,352,903.04	-890,415.63	59,462,487.41
项目	上年度可比期间 2018 年 2 月 8 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)	331,099,125.24	-	331,099,125.24
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-711,217.25	-711,217.25
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动 数(净值减少以“-”号填 列)	-234,757,091.88	-963,006.92	-235,720,098.80
其中：1.基金申购款	344,881.21	6,062.50	350,943.71
2.基金赎回款	-235,101,973.09	-969,069.42	-236,071,042.51
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的 基金净值变动(净值减 少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	96,342,033.36	-1,674,224.17	94,667,809.19

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

海富通量化先锋股票型证券投资基金(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 1210 号《关于准予海富通量化先锋股票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《海富通量化先锋股票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 330,949,630.14 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 0107 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通量化先锋股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 331,099,125.24 份，其中认购资金利息折合 149,495.10 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《海富通量化先锋股票型证券投资基金基金合同》和《海富通量化先锋股票型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据认购/申购费用、

销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通量化先锋股票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、权证、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。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。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 80-95%。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：中证 500 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×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 2019 年 8 月 27 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》、《海富通量化先锋股票型证券投资基金基金合同》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。

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 2019 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	2,991,710.96
定期存款	-
其他存款	-
合计	2,991,710.96

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	49,745,835.65	53,415,353.93	3,669,518.28	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	2,389,604.93	2,396,928.00	7,323.07
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,389,604.93	2,396,928.00	7,323.07
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	52,135,440.58	55,812,281.93	3,676,841.35	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 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	2,804,520.00	-	-	-
——股指期货	2,804,520.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,804,520.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0 元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0 元。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	519.59
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	619.71
应收债券利息	24,064.97
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	11.88
合计	25,216.15

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	31,181.08
银行间市场应付交易费用	-

合计	31,181.08
----	-----------

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	72,981.03
合计	72,981.03

**6.4.7.9 实收基金**

海富通量化先锋股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	84,725,294.04	84,725,294.04
本期申购	62,368.37	62,368.37
本期赎回（以“-”号填列）	-26,874,062.10	-26,874,062.10
本期末	57,913,600.31	57,913,600.31

海富通量化先锋股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,664,601.98	3,664,601.98
本期申购	115,050.72	115,050.72
本期赎回（以“-”号填列）	-1,340,349.97	-1,340,349.97
本期末	2,439,302.73	2,439,302.73

**6.4.7.10 未分配利润**

海富通量化先锋股票 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	-9,958,528.28	-6,369,233.49	-16,327,761.77
本期利润	5,773,070.28	9,752,413.39	15,525,483.67



本期基金份额交易产生的变动数	2,310,699.89	-2,394,268.52	-83,568.63
其中：基金申购款	-6,976.75	-197.66	-7,174.41
基金赎回款	2,317,676.64	-2,394,070.86	-76,394.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,874,758.11	988,911.38	-885,846.73

## 海富通量化先锋股票 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	-386,131.52	-273,767.26	-659,898.78
本期利润	257,690.24	441,560.52	699,250.76
本期基金份额交易产生的变动数	77,552.42	-121,473.30	-43,920.88
其中：基金申购款	-12,191.07	8,908.35	-3,282.72
基金赎回款	89,743.49	-130,381.65	-40,638.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-50,888.86	46,319.96	-4,568.90

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,704.57
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	18,647.24
其他	196.12
合计	27,547.93

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	74,082,596.39
减：卖出股票成本总额	68,824,406.38
买卖股票差价收入	5,258,190.01

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,168,908.91
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,830,528.01
减：应收利息总额	155,215.61
买卖债券差价收入	183,165.29

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
股指期货投资收益（税前）	628,000.00
股指期货差价收入应缴纳增值税额	-18,639.61
合计	609,360.39

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	735,898.83
基金投资产生的股利收益	-
合计	735,898.83

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	10,107,773.91
——股票投资	10,107,822.39
——债券投资	-48.48
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2.衍生工具	86,200.00
——权证投资	-
——股指期货	86,200.00
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	10,193,973.91

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	197.26
基金转换费收入	-
合计	197.26

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

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	160,540.36
银行间市场交易费用	-
合计	160,540.36

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	43,228.25
银行划款手续费	2,458.50
合计	75,439.53

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2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。

### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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

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。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年6月30日	上年度可比期间 2018年2月8日(基金合 同生效日)至2018年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	510,580.33	1,036,528.98
其中：支付销售机构的客户维护费	232,237.64	424,443.06

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X1.5% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 6月30日	上年度可比期间 2018年2月8日（基金合 同生效日）至2018年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	85,096.72	172,754.84

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通量化先锋 股票 A	海富通量化先锋股票 C	合计
中国银行	-	2,481.82	2,481.82
海通证券	-	37.66	37.66
海富通	-	1.14	1.14
合计	-	2,520.62	2,520.62
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2018年2月8日（基金合同生效日）至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通量化先锋 股票A	海富通量化先锋股票 C	合计
中国银行	-	2,832.64	2,832.64
海通证券	-	44.28	44.28
海富通	-	2,227.51	2,227.51
合计	-	5,104.43	5,104.43

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.4%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日基金销售服务费=前一日 C 类基金份额对应的资产净值 X 0.4% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年2月8日（基金合同生效日） 至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	2,991,710.96	8,704.57	6,108,198.53	179,823.74

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明****6.4.10.7.1 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。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未实施利润分配。

**6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新股未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只股票型的证券投资基金，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、风险管理部和监察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的多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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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

于 2019 年 6 月 30 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占

基金资产净值的比例为 0.17%。(2018 年 12 月 31 日: 0.06%)

### 6.4.13.3 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。

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

于 2019 年 6 月 30 日,本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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 6.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 06 月 30 日,本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.06%。



本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2019年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,991,710.96	-	-	-	2,991,710.96
结算备付金	1,312,674.59	-	-	-	1,312,674.59

存出保证金	368,027.86	-	-	-	368,027.86
交易性金融资产	2,298,160.00	-	98,768.00	53,415,353.93	55,812,281.93
应收利息	-	-	-	25,216.15	25,216.15
<b>资产总计</b>	<b>6,970,573.41</b>	<b>0.00</b>	<b>98,768.00</b>	<b>53,440,570.08</b>	<b>60,509,911.49</b>
负债					
应付证券清算款	-	-	-	860,230.94	860,230.94
应付管理人报酬	-	-	-	70,498.75	70,498.75
应付托管费	-	-	-	11,749.81	11,749.81
应付销售服务费	-	-	-	782.14	782.14
应付交易费用	-	-	-	31,181.08	31,181.08
应付税费	-	-	-	0.33	0.33
其他负债	-	-	-	72,981.03	72,981.03
<b>负债总计</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>0.00</b>	<b>1,047,424.08</b>	<b>1,047,424.08</b>
利率敏感度缺口	6,970,573.41	0.00	98,768.00	52,393,146.00	59,462,487.41
<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	4,615,960.74	-	-	-	4,615,960.74
结算备付金	3,397,592.67	-	-	-	3,397,592.67
存出保证金	155,267.39	-	-	-	155,267.39
交易性金融资产	4,124,066.40	40,316.00	-	59,380,153.88	63,544,536.28
买入返售金融资产	3,000,000.00	-	-	-	3,000,000.00
应收利息	-	-	-	117,160.71	117,160.71
<b>资产总计</b>	<b>15,292,887.20</b>	<b>40,316.00</b>	<b>-</b>	<b>59,497,314.59</b>	<b>74,830,517.79</b>

负债					
应付证券清算款				-2,986,570.46	2,986,570.46
应付赎回款				15,934.36	15,934.36
应付管理人报酬				93,029.85	93,029.85
应付托管费				15,504.97	15,504.97
应付销售服务费				1,043.74	1,043.74
应付交易费用				66,197.90	66,197.90
应交税费				1.04	1.04
其他负债				250,000.00	250,000.00
负债总计				3,428,282.32	3,428,282.32
利率敏感度缺口	15,292,887.20	40,316.00		56,069,032.27	71,402,235.47

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.03%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。(2018 年 12 月 31 日：5.83%)

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资 80%-95%、权证投资 0%-3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基 金资 产净 值比 例(%)
交易性金融资产—股票投资	53,415,353.93	89.83	59,380,153.88	83.16
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	53,415,353.93	89.83	59,380,153.88	83.16

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)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：人民币万元）	
		本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	增加约 292	增加约 311
	业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	减少约 292	减少约 311

注：影响金额为约数，精确到万元。

**6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

**§7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	53,415,353.93	88.28
	其中：股票	53,415,353.93	88.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,396,928.00	3.96
	其中：债券	2,396,928.00	3.96
	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	4,304,385.55	7.11
8	其他各项资产	393,244.01	0.65
9	合计	60,509,911.49	100.00

**7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合****7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

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	207,496.00	0.35
B	采矿业	811,626.35	1.36
C	制造业	34,344,093.05	57.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	410,511.60	0.69
E	建筑业	812,671.00	1.37
F	批发和零售业	3,001,513.73	5.05

G	交通运输、仓储和邮政业	973,490.40	1.64
H	住宿和餐饮业	704,030.00	1.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,650,311.28	6.14
J	金融业	2,747,714.97	4.62
K	房地产业	2,911,646.60	4.90
L	租赁和商务服务业	479,291.00	0.81
M	科学研究和技术服务业	670,126.00	1.13
N	水利、环境和公共设施管理业	169,849.95	0.29
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,680.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	1,376,574.00	2.32
S	综合	28,728.00	0.05
	合计	53,415,353.93	89.83

### 7.2.2 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000999	华润三九	29,600	868,464.00	1.46
2	002372	伟星新材	48,480	843,552.00	1.42
3	002475	立讯精密	33,800	837,902.00	1.41
4	600406	国电南瑞	43,849	817,345.36	1.37
5	300144	宋城演艺	33,900	784,446.00	1.32
6	600332	白云山	17,000	696,490.00	1.17
7	603886	元祖股份	25,800	683,442.00	1.15
8	601966	玲珑轮胎	39,000	663,000.00	1.11
9	000333	美的集团	12,484	647,420.24	1.09
10	603515	欧普照明	19,100	615,975.00	1.04
11	002463	沪电股份	44,629	607,846.98	1.02
12	600383	金地集团	49,900	595,307.00	1.00
13	601877	正泰电器	25,400	586,486.00	0.99
14	002643	万润股份	57,300	578,730.00	0.97
15	600585	海螺水泥	13,500	560,250.00	0.94
16	000902	新洋丰	50,700	544,011.00	0.91
17	600030	中信证券	22,600	538,106.00	0.90

18	600887	伊利股份	15,900	531,219.00	0.89
19	000568	泸州老窖	6,500	525,395.00	0.88
20	300271	华宇软件	27,200	516,800.00	0.87
21	603939	益丰药房	7,200	503,928.00	0.85
22	000786	北新建材	27,300	494,949.00	0.83
23	002415	海康威视	17,700	488,166.00	0.82
24	300014	亿纬锂能	15,800	481,268.00	0.81
25	600009	上海机场	5,700	477,546.00	0.80
26	300525	博思软件	21,450	464,392.50	0.78
27	002353	杰瑞股份	19,700	455,070.00	0.77
28	300450	先导智能	13,346	448,425.60	0.75
29	600426	华鲁恒升	29,900	444,314.00	0.75
30	600690	海尔智家	25,300	437,437.00	0.74
31	600754	锦江股份	17,700	436,128.00	0.73
32	601933	永辉超市	41,000	418,610.00	0.70
33	600104	上汽集团	16,230	413,865.00	0.70
34	600298	安琪酵母	13,000	411,190.00	0.69
35	601668	中国建筑	70,000	402,500.00	0.68
36	300316	晶盛机电	31,700	402,273.00	0.68
37	002867	周大生	11,700	400,023.00	0.67
38	601398	工商银行	67,900	399,931.00	0.67
39	600519	贵州茅台	400	393,600.00	0.66
40	000858	五粮液	3,300	389,235.00	0.65
41	001979	招商蛇口	18,300	382,470.00	0.64
42	600048	保利地产	29,600	377,696.00	0.64
43	300166	东方国信	30,400	373,616.00	0.63
44	603585	苏利股份	15,600	372,528.00	0.63
45	600750	江中药业	28,625	372,411.25	0.63
46	000538	云南白药	4,400	367,048.00	0.62
47	000002	万科 A	13,100	364,311.00	0.61
48	002032	苏泊尔	4,700	356,401.00	0.60
49	601318	中国平安	4,000	354,440.00	0.60
50	002419	天虹股份	27,000	352,620.00	0.59
51	601225	陕西煤业	37,700	348,348.00	0.59
52	603589	口子窖	5,400	347,868.00	0.59
53	600276	恒瑞医药	5,180	341,880.00	0.57
54	002304	洋河股份	2,800	340,368.00	0.57
55	002773	康弘药业	10,270	338,088.40	0.57
56	002311	海大集团	10,900	336,810.00	0.57
57	600176	中国巨石	34,140	325,354.20	0.55
58	601166	兴业银行	17,700	323,733.00	0.54
59	300383	光环新网	19,300	323,661.00	0.54
60	603328	依顿电子	29,700	305,019.00	0.51
61	000661	长春高新	900	304,200.00	0.51

62	300274	阳光电源	32,500	303,875.00	0.51
63	002798	帝欧家居	16,480	301,748.80	0.51
64	603228	景旺电子	7,517	300,755.17	0.51
65	000651	格力电器	5,434	298,870.00	0.50
66	600859	王府井	19,607	297,830.33	0.50
67	002624	完美世界	11,300	291,653.00	0.49
68	300012	华测检测	26,400	285,120.00	0.48
69	600285	羚锐制药	33,000	278,190.00	0.47
70	600309	万华化学	6,500	278,135.00	0.47
71	600570	恒生电子	4,030	274,644.50	0.46
72	300037	新宙邦	13,000	270,920.00	0.46
73	000895	双汇发展	10,800	268,812.00	0.45
74	603259	药明康德	3,100	268,708.00	0.45
75	600377	宁沪高速	25,000	268,500.00	0.45
76	603587	地素时尚	11,800	268,332.00	0.45
77	600258	首旅酒店	14,900	267,902.00	0.45
78	601098	中南传媒	20,900	264,176.00	0.44
79	300203	聚光科技	11,000	262,900.00	0.44
80	300146	汤臣倍健	13,500	261,900.00	0.44
81	000596	古井贡酒	2,200	260,722.00	0.44
82	600073	上海梅林	27,900	256,680.00	0.43
83	002508	老板电器	9,300	252,402.00	0.42
84	002690	美亚光电	7,700	251,020.00	0.42
85	601211	国泰君安	13,203	242,275.05	0.41
86	601186	中国铁建	23,900	237,805.00	0.40
87	600741	华域汽车	11,000	237,600.00	0.40
88	600990	四创电子	5,100	237,252.00	0.40
89	603160	汇顶科技	1,700	235,960.00	0.40
90	601128	常熟银行	29,700	229,284.00	0.39
91	002003	伟星股份	33,470	226,257.20	0.38
92	002035	华帝股份	18,350	223,503.00	0.38
93	002410	广联达	6,700	220,363.00	0.37
94	600643	爱建集团	22,800	218,424.00	0.37
95	002812	恩捷股份	4,600	215,050.00	0.36
96	603556	海兴电力	15,110	208,820.20	0.35
97	603660	苏州科达	13,160	205,164.40	0.35
98	600153	建发股份	22,500	199,800.00	0.34
99	002594	比亚迪	3,800	192,736.00	0.32
100	300207	欣旺达	16,600	191,232.00	0.32
101	002229	鸿博股份	24,400	184,220.00	0.31
102	603986	兆易创新	2,100	182,070.00	0.31
103	002007	华兰生物	5,850	178,366.50	0.30
104	002080	中材科技	19,630	177,847.80	0.30
105	002727	一心堂	6,200	176,638.00	0.30



106	603985	恒润股份	11,214	175,274.82	0.29
107	601601	中国太保	4,700	171,597.00	0.29
108	601888	中国国旅	1,900	168,435.00	0.28
109	002371	北方华创	2,400	166,200.00	0.28
110	600583	海油工程	29,600	165,760.00	0.28
111	002478	常宝股份	27,200	164,560.00	0.28
112	600479	千金药业	17,600	164,032.00	0.28
113	000069	华侨城 A	23,500	163,325.00	0.27
114	601688	华泰证券	7,300	162,936.00	0.27
115	000063	中兴通讯	5,000	162,650.00	0.27
116	600398	海澜之家	17,400	157,818.00	0.27
117	002384	东山精密	10,800	157,356.00	0.26
118	000848	承德露露	18,800	156,604.00	0.26
119	002677	浙江美大	11,900	156,604.00	0.26
120	002440	闰土股份	12,500	155,750.00	0.26
121	000401	冀东水泥	8,500	149,685.00	0.25
122	600138	中青旅	11,600	147,204.00	0.25
123	000656	金科股份	24,200	145,926.00	0.25
124	300326	凯利泰	16,000	144,800.00	0.24
125	601607	上海医药	7,900	143,385.00	0.24
126	600612	老凤祥	3,200	143,040.00	0.24
127	600548	深高速	15,200	142,728.00	0.24
128	000739	普洛药业	14,500	142,535.00	0.24
129	600885	宏发股份	5,640	137,052.00	0.23
130	000671	阳光城	21,100	136,728.00	0.23
131	603658	安图生物	2,000	136,720.00	0.23
132	600196	复星医药	5,400	136,620.00	0.23
133	000718	苏宁环球	37,300	129,058.00	0.22
134	600757	长江传媒	18,900	128,709.00	0.22
135	601100	恒立液压	4,100	128,658.00	0.22
136	000501	鄂武商 A	11,900	127,925.00	0.22
137	300088	长信科技	24,500	123,970.00	0.21
138	600131	岷江水电	8,600	123,324.00	0.21
139	600622	光大嘉宝	25,090	122,188.30	0.21
140	002511	中顺洁柔	9,900	121,572.00	0.20
141	600507	方大特钢	12,400	121,272.00	0.20
142	600486	扬农化工	2,200	120,340.00	0.20
143	002531	天顺风能	19,800	119,592.00	0.20
144	002422	科伦药业	4,000	118,920.00	0.20
145	600642	申能股份	19,600	117,796.00	0.20
146	300284	苏文科	12,600	116,298.00	0.20
147	002010	传化智联	15,200	114,456.00	0.19
148	600977	中国电影	7,300	114,318.00	0.19
149	000036	华联控股	22,230	113,595.30	0.19

150	600993	马应龙	6,400	112,960.00	0.19
151	300082	奥克股份	17,000	112,030.00	0.19
152	300294	博雅生物	4,100	111,315.00	0.19
153	603678	火炬电子	5,500	110,825.00	0.19
154	600511	国药股份	4,800	110,256.00	0.19
155	300737	科顺股份	11,600	109,040.00	0.18
156	002051	中工国际	9,400	107,818.00	0.18
157	002242	九阳股份	5,100	106,131.00	0.18
158	002271	东方雨虹	4,610	104,462.60	0.18
159	600933	爱柯迪	13,300	104,405.00	0.18
160	601088	中国神华	5,000	101,900.00	0.17
161	600779	水井坊	2,001	101,690.82	0.17
162	600419	天润乳业	6,500	101,140.00	0.17
163	601233	桐昆股份	6,500	100,815.00	0.17
164	300498	温氏股份	2,800	100,408.00	0.17
165	300230	永利股份	22,300	98,343.00	0.17
166	600160	巨化股份	13,800	98,118.00	0.17
167	600007	中国国贸	6,700	97,753.00	0.16
168	300253	卫宁健康	6,800	96,424.00	0.16
169	300628	亿联网络	900	96,363.00	0.16
170	300130	新国都	5,900	93,810.00	0.16
171	603026	石大胜华	3,100	93,806.00	0.16
172	000860	顺鑫农业	2,010	93,766.50	0.16
173	600528	中铁工业	8,100	93,717.00	0.16
174	600352	浙江龙盛	5,900	93,043.00	0.16
175	600339	中油工程	21,900	92,418.00	0.16
176	000725	京东方 A	26,800	92,192.00	0.16
177	000963	华东医药	3,540	91,898.40	0.15
178	603136	天目湖	4,495	90,843.95	0.15
179	300408	三环集团	4,500	87,525.00	0.15
180	300347	泰格医药	1,100	84,810.00	0.14
181	600808	马钢股份	24,600	83,886.00	0.14
182	000598	兴蓉环境	18,400	83,720.00	0.14
183	300476	胜宏科技	7,380	83,394.00	0.14
184	002299	圣农发展	3,200	81,024.00	0.14
185	603198	迎驾贡酒	4,500	80,595.00	0.14
186	000961	中南建设	9,000	77,940.00	0.13
187	600438	通威股份	5,500	77,330.00	0.13
188	002124	天邦股份	5,800	75,632.00	0.13
189	002803	吉宏股份	3,500	71,435.00	0.12
190	002223	鱼跃医疗	2,900	71,398.00	0.12
191	603868	飞科电器	1,800	70,470.00	0.12
192	002916	深南电路	680	69,305.60	0.12
193	603588	高能环境	6,200	66,154.00	0.11

194	600004	白云机场	3,627	66,011.40	0.11
195	601390	中国中铁	9,900	64,548.00	0.11
196	600376	首开股份	6,900	61,617.00	0.10
197	600737	中粮糖业	6,600	57,288.00	0.10
198	002434	万里扬	8,300	56,357.00	0.09
199	002050	三花智控	5,200	54,860.00	0.09
200	002191	劲嘉股份	4,400	54,604.00	0.09
201	002332	仙琚制药	8,000	54,080.00	0.09
202	603605	珀莱雅	800	52,944.00	0.09
203	002540	亚太科技	11,000	52,140.00	0.09
204	002507	涪陵榨菜	1,700	51,850.00	0.09
205	601155	新城控股	1,300	51,753.00	0.09
206	600521	华海药业	3,600	50,760.00	0.09
207	002174	游族网络	3,000	50,640.00	0.09
208	600028	中国石化	9,200	50,324.00	0.08
209	002373	千方科技	2,900	49,590.00	0.08
210	600967	内蒙一机	4,400	49,280.00	0.08
211	002405	四维图新	3,000	48,300.00	0.08
212	600761	安徽合力	4,900	47,040.00	0.08
213	000910	大亚圣象	4,200	46,788.00	0.08
214	002841	视源股份	600	46,506.00	0.08
215	000852	石化机械	5,100	45,900.00	0.08
216	300226	上海钢联	600	44,976.00	0.08
217	600195	中牧股份	3,180	44,043.00	0.07
218	600373	中文传媒	3,500	43,960.00	0.07
219	002129	中环股份	4,500	43,920.00	0.07
220	300196	长海股份	4,800	43,776.00	0.07
221	600132	重庆啤酒	900	42,444.00	0.07
222	000830	鲁西化工	3,900	42,432.00	0.07
223	300258	精锻科技	3,400	41,174.00	0.07
224	603233	大参林	910	40,950.00	0.07
225	002110	三钢闽光	4,350	40,455.00	0.07
226	002027	分众传媒	7,600	40,204.00	0.07
227	000031	大悦城	6,000	38,520.00	0.06
228	002557	洽洽食品	1,500	37,875.00	0.06
229	000921	海信家电	3,000	37,440.00	0.06
230	600011	华能国际	6,000	37,380.00	0.06
231	300782	卓胜微	322	35,072.24	0.06
232	600835	上海机电	2,100	34,860.00	0.06
233	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.06
234	600566	济川药业	1,100	33,121.00	0.06
235	601336	新华保险	600	33,018.00	0.06
236	603501	韦尔股份	600	32,946.00	0.06
237	002233	塔牌集团	2,800	32,704.00	0.05

238	300400	劲拓股份	2,200	32,582.00	0.05
239	603882	金域医学	900	30,870.00	0.05
240	600720	祁连山	3,400	29,886.00	0.05
241	600056	中国医药	2,200	29,678.00	0.05
242	000425	徐工机械	6,600	29,436.00	0.05
243	600804	鹏博士	3,900	29,328.00	0.05
244	600895	张江高科	1,400	28,728.00	0.05
245	601717	郑煤机	5,000	28,550.00	0.05
246	600409	三友化工	5,000	28,300.00	0.05
247	000338	潍柴动力	2,300	28,267.00	0.05
248	002563	森马服饰	2,500	27,650.00	0.05
249	600325	华发股份	3,500	27,335.00	0.05
250	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.05
251	600886	国投电力	3,400	26,418.00	0.04
252	600803	新奥股份	2,500	26,125.00	0.04
253	600466	蓝光发展	4,200	26,124.00	0.04
254	000998	隆平高科	1,800	26,064.00	0.04
255	601231	环旭电子	2,100	25,305.00	0.04
256	000719	中原传媒	3,400	24,140.00	0.04
257	002008	大族激光	700	24,066.00	0.04
258	601699	潞安环能	3,000	23,820.00	0.04
259	601222	林洋能源	5,000	23,450.00	0.04
260	002407	多氟多	1,900	22,496.00	0.04
261	002396	星网锐捷	1,000	22,440.00	0.04
262	601838	成都银行	2,500	22,075.00	0.04
263	600681	百川能源	2,940	21,873.60	0.04
264	603444	吉比特	100	20,996.00	0.04
265	600563	法拉电子	500	20,585.00	0.03
266	000581	威孚高科	1,100	20,416.00	0.03
267	002444	巨星科技	2,000	19,960.00	0.03
268	601698	中国卫通	5,051	19,799.92	0.03
269	300394	天孚通信	700	19,334.00	0.03
270	603659	璞泰来	400	18,808.00	0.03
271	600125	铁龙物流	2,900	18,705.00	0.03
272	002597	金禾实业	1,000	18,240.00	0.03
273	600036	招商银行	501	18,025.98	0.03
274	000977	浪潮信息	739	17,632.54	0.03
275	600801	华新水泥	840	17,010.00	0.03
276	600312	平高电气	2,200	16,918.00	0.03
277	600567	山鹰纸业	5,000	16,850.00	0.03
278	300133	华策影视	2,500	16,825.00	0.03
279	600580	卧龙电驱	2,000	16,820.00	0.03
280	002462	嘉事堂	1,100	16,500.00	0.03
281	300594	朗进科技	360	15,879.60	0.03

282	603989	艾华集团	800	15,104.00	0.03
283	601899	紫金矿业	4,000	15,080.00	0.03
284	600968	海油发展	3,937	13,976.35	0.02
285	002078	太阳纸业	2,000	13,620.00	0.02
286	002717	岭南股份	2,550	12,852.00	0.02
287	000625	长安汽车	1,700	11,271.00	0.02
288	600183	生益科技	700	10,535.00	0.02
289	300741	华宝股份	296	9,383.20	0.02
290	603863	松炆资源	403	9,301.24	0.02
291	002127	南极电商	800	8,992.00	0.02
292	000960	锡业股份	800	8,936.00	0.02
293	603899	晨光文具	200	8,794.00	0.01
294	603369	今世缘	300	8,367.00	0.01
295	002013	中航机电	1,200	8,256.00	0.01
296	600655	豫园股份	1,000	8,190.00	0.01
297	300168	万达信息	600	7,782.00	0.01
298	002583	海能达	900	7,551.00	0.01
299	000513	丽珠集团	200	6,646.00	0.01
300	300319	麦捷科技	900	6,426.00	0.01
301	600987	航民股份	870	5,750.70	0.01
302	603766	隆鑫通用	1,200	5,028.00	0.01
303	300233	金城医药	200	3,784.00	0.01
304	600875	东方电气	200	2,124.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601877	正泰电器	2,224,408.00	3.12
2	600196	复星医药	1,380,568.00	1.93
3	601966	玲珑轮胎	1,084,138.00	1.52
4	002415	海康威视	836,576.00	1.17
5	002372	伟星新材	761,871.58	1.07
6	603160	汇顶科技	754,444.99	1.06
7	002475	立讯精密	739,771.50	1.04
8	601211	国泰君安	710,332.85	0.99
9	002643	万润股份	703,118.00	0.98
10	603515	欧普照明	660,062.20	0.92
11	002624	完美世界	648,961.00	0.91
12	000977	浪潮信息	646,697.00	0.91
13	603587	地素时尚	646,499.00	0.91

14	600426	华鲁恒升	634,574.00	0.89
15	601601	中国太保	631,359.00	0.88
16	300166	东方国信	604,377.00	0.85
17	600383	金地集团	592,102.00	0.83
18	000568	泸州老窖	591,056.00	0.83
19	601098	中南传媒	566,599.00	0.79
20	300133	华策影视	543,619.00	0.76

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。

#### 7.4.2 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	601877	正泰电器	2,810,642.00	3.94
2	600196	复星医药	1,659,882.48	2.32
3	600795	国电电力	1,463,561.00	2.05
4	002035	华帝股份	1,265,863.05	1.77
5	600887	伊利股份	1,259,723.00	1.76
6	000538	云南白药	1,243,776.00	1.74
7	002415	海康威视	1,220,444.00	1.71
8	300170	汉得信息	1,151,007.00	1.61
9	000002	万科 A	1,124,914.00	1.58
10	000568	泸州老窖	1,097,642.00	1.54
11	000651	格力电器	1,012,495.00	1.42
12	600298	安琪酵母	1,001,878.00	1.40
13	600015	华夏银行	971,828.00	1.36
14	300037	新宙邦	952,591.00	1.33
15	300133	华策影视	947,108.00	1.33
16	600027	华电国际	931,953.00	1.31
17	002391	长青股份	918,745.00	1.29
18	000333	美的集团	906,298.00	1.27
19	600987	航民股份	887,586.00	1.24
20	600406	国电南瑞	879,711.00	1.23

注：1.“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

2. 于 2019 年 6 月 20 日, [美的集团][000333]换股吸收合并[小天鹅 A][000418]。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本(成交)总额	52,751,784.04
卖出股票的收入(成交)总额	74,082,596.39

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。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	2,298,160.00	3.86
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）	98,768.00	0.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,396,928.00	4.03

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019611	19 国债 01	23,000	2,298,160.00	3.86
2	113533	参林转债	700	83,951.00	0.14
3	128067	一心转债	132	14,817.00	0.02

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1912	IC1912	3.00	2,823,000.00	18,480.00	-

公允价值变动总额合计	18,480.00
股指期货投资本期收益	609,360.39
股指期货投资本期公允价值变动	86,200.00

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 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。

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的白云山（600332）于 2018 年 12 月 20 日公告称，国家药品监督管理局于 2018 年 8 月 14 日-17 日对子公司天心药业的注射用盐酸头孢甲肟开展现场检查，发现其生产质量管理不符合《药品生产质量管理规范（2010 年修订）》相关规定。省药监局根据相关规定，收回天心药业编号为 GD20170677、认证范围为粉针剂（头孢菌素类）的 GMP 证书。天心药业已停止注射用盐酸头孢甲肟的生产和销售，启动召回程序并完成了相关涉事产品的召回工作，并按程序进行了报告。

对该证券的投资决策程序的说明：公司大健康板块王老吉量价齐升趋势明显，看好控费稳价下的盈利持续提升；大南药板块总体销售稳步推进，盈利持续提升。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。

7.12.2 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。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	368,027.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-



4	应收利息	25,216.15
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	393,244.01

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 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。

### §8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 化先锋股 票 A	326	177,649.08	10,321.50	0.02%	57,903,278.8 1	99.98%
海富通量 化先锋股 票 C	65	37,527.73	-	-	2,439,302.73	100.00 %
合计	391	154,355.25	10,321.50	0.02%	60,342,581.5 4	99.98%

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）。

#### 8.2 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	海富通量化先锋股 票 A	2,076.90	0.0036%

	海富通量化先锋股票 C	1,010.73	0.0414%
	合计	3,087.63	0.0051%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	海富通量化先锋股票 A	0~10
	海富通量化先锋股票 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通量化先锋股票 A	0~10
	海富通量化先锋股票 C	0
	合计	0~10

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通量化先锋股票 A	海富通量化先锋股票 C
基金合同生效日（2018 年 2 月 8 日）基金份额总额	218,570,279.56	112,528,845.68
本报告期期初基金份额总额	84,725,294.04	3,664,601.98
本报告期基金总申购份额	62,368.37	115,050.72
减：本报告期基金总赎回份额	26,874,062.10	1,340,349.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	57,913,600.31	2,439,302.73

### §10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

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

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

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

## 10.3 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。

## 10.4 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。

## 10.5 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。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金的管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	2	25,797,600.30	20.61%	11,126.85	15.24%	-
国金证券	1	25,536,415.38	20.40%	13,567.32	18.59%	-
国盛证券	2	18,119,636.48	14.47%	13,167.68	18.04%	-
华创证券	1	15,658,896.47	12.51%	6,440.49	8.82%	-
中信证券	2	15,443,995.60	12.34%	14,074.22	19.28%	-
银河证券	1	11,334,938.91	9.05%	5,795.69	7.94%	-
长江证券	1	5,733,304.00	4.58%	3,504.74	4.80%	-
渤海证券	1	4,154,099.66	3.32%	2,954.84	4.05%	-
天风证券	2	2,248,646.32	1.80%	1,644.40	2.25%	-
中信建投	2	1,163,191.60	0.93%	711.10	0.97%	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内租用券商交易单元没有发生变更。

**2、（1）交易单元的选择标准**

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及交易单元租用意见。

**（2）交易单元的选择程序**

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门会议讨论，形成重点评估的证券公司备选池，从中进行甄选。原则上，备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的 200%。

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

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，由基金管理人的总经理办公会核准。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
申万宏源	639,109.81	16.05%	33,000,000.00	68.75%	-	-
国金证券	793,702.30	19.93%	15,000,000.00	31.25%	-	-
国盛证券	2,297,080.00	57.69%	-	-	-	-
华创证券	251,968.40	6.33%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于旗下基金2018 年年度基金资产净值和基金份额净值公告	《上海证券报》	2019-01-01
2	海富通基金管理有限公司关于董事会成员换届变更的公告	《上海证券报》	2019-03-29
3	海富通基金管理有限公司关于董事长变更的公告	《上海证券报》	2019-03-29
4	海富通基金管理有限公司关于高级管理	《上海证券报》	2019-04-29

	人员变更的公告		
5	海富通基金管理有限公司关于开展旗下部分基金直销柜台费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019-06-13
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增西部证券股份有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》	2019-06-13
7	海富通基金管理有限公司关于调整旗下基金直销柜台最低申购金额的公告	《上海证券报》	2019-06-18
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	《上海证券报》	2019-06-21
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国银行定期定额投资申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019-06-26
10	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加部分销售机构申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》	2019-06-28

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 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 69 只公募基金。截至 2019 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 780 亿元人民币。

2004 年末开始，海富通及子公司为 QFII（合格境外机构投资者）及其他多个海内外投资组合担任投资咨询顾问，截至 2019 年 6 月 30 日，海外业务规模约 23 亿元人民币。

作为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，截至 2019 年 6 月 30 日，海富通为近 80 家企业约 438 亿元的企业年金基金担任了投资管理人。作为首批特定客户资产管理业务资格的基金管理公司，截至 2019 年 6 月 30 日，海富通管理的特定客户资产管理业务规模约 388 亿元。2010 年 12 月，海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2011 年 12 月，海富通全资子公司——海富通资产管理（香港）有限公司获得证监会核准批复 RQFII（人民币合格境外机构投资者）业务资格，能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012 年 2 月，海富通

资产管理（香港）有限公司已募集发行了首只 RQFII 产品。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。

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

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准设立海富通量化先锋股票型证券投资基金的文件
- （二）海富通量化先锋股票型证券投资基金基金合同
- （三）海富通量化先锋股票型证券投资基金招募说明书
- （四）海富通量化先锋股票型证券投资基金托管协议
- （五）中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- （六）报告期内海富通量化先锋股票型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司  
二〇一九年八月二十八日