

**海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金**  
**2018 年第 2 季度报告**  
**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：二〇一八年七月十八日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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 基金产品概况

|            |                                                                         |
|------------|-------------------------------------------------------------------------|
| 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                                                         |
| 报告期末基金份额总额 | 24,867,207.69 份                                                         |
| 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。            |
| 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    |                |
| 下属两级基金的基金简称     | 海富通量化多因子混合 A    | 海富通量化多因子混合 C   |
| 下属两级基金的交易代码     | 005081          | 005080         |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 15,564,943.32 份 | 9,302,264.37 份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期<br>(2018 年 4 月 23 日 (基金合同生效日) - 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 |
| 1. 本期已实现收益      | 304,765.35                                           | 107,253.24   |
| 2. 本期利润         | -130,759.45                                          | 425,000.82   |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0059                                              | 0.0041       |
| 4. 期末基金资产净值     | 15,235,926.30                                        | 9,067,638.17 |
| 5. 期末基金份额净值     | 0.9789                                               | 0.9748       |

注：(1) 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。

(2) 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。

(3) 本基金合同生效日为2018年04月23日，合同生效当季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 本报告期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 | 净值增长率① | 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 | ①—③ | ②—④ |
|----|--------|-----------|------------|--------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|--------------|-----|-----|

|                         |        |       |        |       |       |       |
|-------------------------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|
|                         |        |       |        | ④     |       |       |
| 2018/4/23<br>-2018/6/30 | -2.11% | 0.84% | -5.41% | 0.74% | 3.30% | 0.10% |

## 2、海富通量化多因子混合 C:

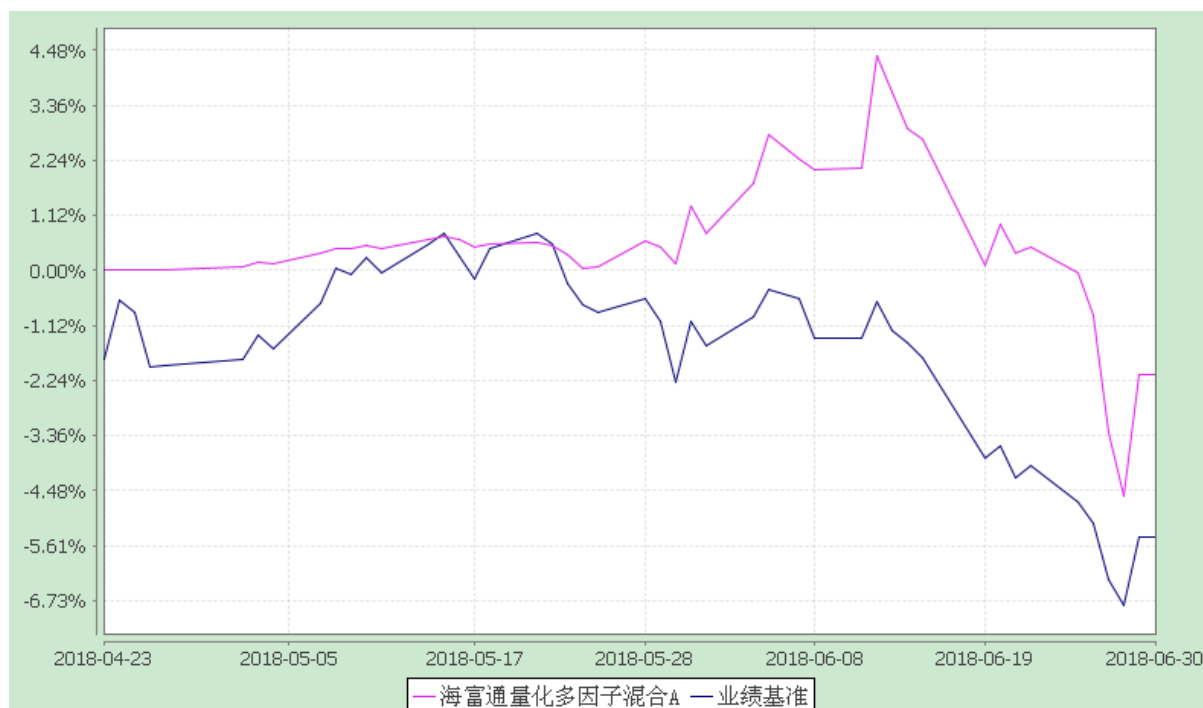
| 阶段                      | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④   |
|-------------------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 2018/4/23<br>-2018/6/30 | -2.52% | 0.83%     | -5.42%     | 0.74%         | 2.90% | 0.09% |

### 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

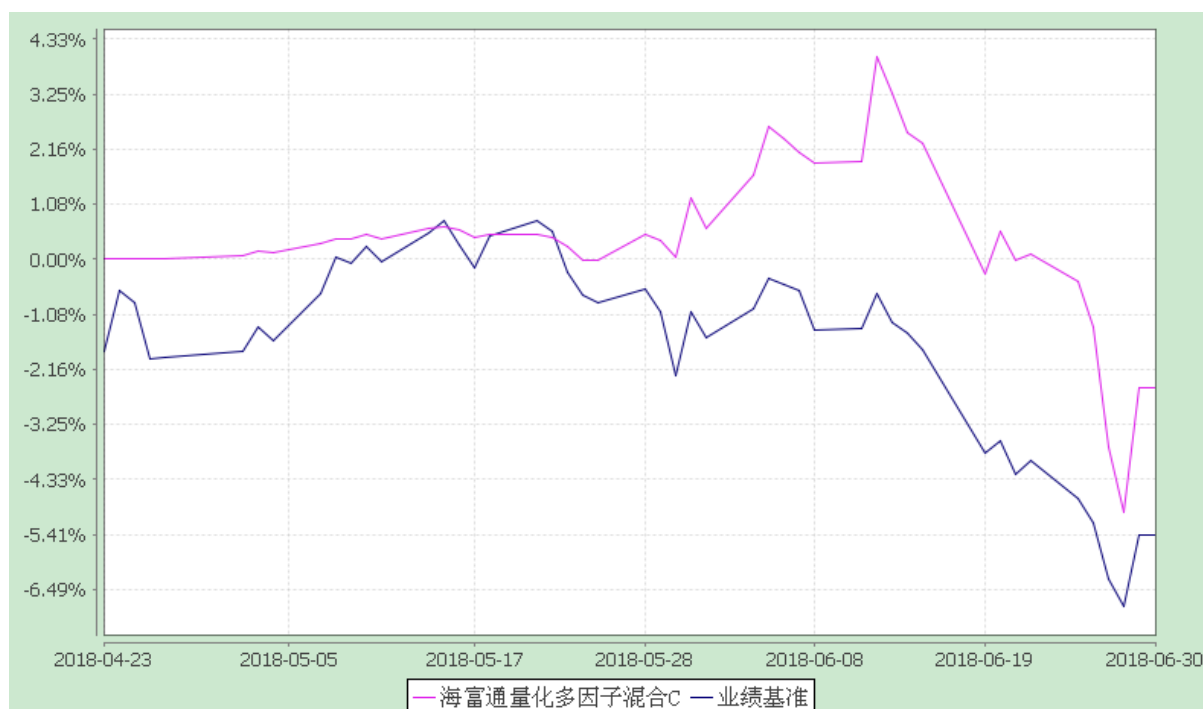
#### 1. 海富通量化多因子混合 A

(2018 年 4 月 23 日至 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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                | 任本基金的基金经理期限 |            | 证券从业年限 | 说明                                                                                                       |
|-----|-------------------|-------------|------------|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                   | 任职日期        | 离任日期       |        |                                                                                                          |
| 陈甄璞 | 本基金的基金经理；海富通东财大数据 | 2018-04-23  | 2018-05-03 | 10 年   | 硕士，持有基金从业人员资格证书。历任复旦金仕达计算机有限公司高级程序员、部门经理，东方证券股份有限公司高级开发经理，IBM 中国有限公司高级咨询顾问，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 |

|     |                                                                                     |            |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-----|-------------------------------------------------------------------------------------|------------|---|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     | 混合基金经理；海富通阿尔法对冲混合基金经理；海富通欣益混合基金经理；海富通欣享混合基金经理；海富通量化前锋股票基金经理；海富通创业板增强基金经理；时任量化投资部总监。 |            |   |      | 副总监、量化投资部总监。2014 年 11 月至 2018 年 5 月任海富通阿尔法对冲混合基金基金经理。2015 年 4 月至 2016 年 6 月兼任海富通养老收益混合（现海富通安颐收益混合）和海富通新内需混合基金基金经理。2016 年 1 月至 2018 年 5 月兼任海富通东财大数据混合基金基金经理。2016 年 9 月至 2018 年 5 月兼任海富通欣益混合基金基金经理。2017 年 3 月至 2018 年 5 月兼任海富通欣享混合基金基金经理。2018 年 2 月至 2018 年 5 月兼任海富通量化前锋股票基金基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 5 月兼任海富通创业板增强和海富通量化多因子混合基金基金经理。 |
| 杜晓海 | 本基金的基金经理；海富                                                                         | 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                                                                                                                                                                                                                                          |

|  |                                                                                                 |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 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；海富通东财大 |  |  |  | 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 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强、海富通东财大数据混合、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。 |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                   |  |  |  |  |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|
|  | 数据混合基金经理；海富通量化前锋股票基金经理；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；海富通创业板增强基金经理；量化投资部总监 |  |  |  |  |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|

#### 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 公平交易专项说明

#### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾二季度，市场整体呈现震荡下行的走势，6 月市场跌幅明显。上证综指收于 2847.42 点，二季度下跌 10.14%，深证成指报 9379.47 点，下跌 13.70%。中小板指收于 6477.76 点，跌幅为 12.98%，创业板指跌 15.46%，收于 1606.71 点。

具体来看，4 月主要指数呈现震荡下跌的态势，在此期间，美国商务部对中兴通讯启动禁令，引发了市场的恐慌情绪。但市场仍表现出一定的结构性行情，医药、钢铁等板块表现亮眼。上证综指全月下跌 2.73%，深证成指下跌 5.01%，中小板指和创业板指分别下跌 5.98% 和 4.99%。5 月市场冲高回落。月初在资管新规落地、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，A 股主要指数震荡上行。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。全月白酒、医药等板块存在结构性行情。最终上证综指微涨 0.43%，深证成指下跌 0.28%，中小板指上涨 1.41%，创业板指下挫 3.43%。6 月延续了 5 月的悲观情绪，市场加速下跌，沪指一度跌破 2800 点，创两年以来新低。各行业也全线下跌。上证综指和深证成指单月分别下跌 8.01% 和 8.90%，中小板指和创业板指下跌 8.73% 和 7.86%。

行业方面，二季度在中信证券 29 个一级行业分类中，仅食品饮料（9.03%）、餐饮旅游（3.15%）录得涨幅，其余行业均下跌，综合（-23.60%）、通信（-22.28%）、电力设备（-21.18%）跌幅居前。

本季度，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。

### 4.5 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。

#### 4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年三季度，中国经济将面临内外部两个方向的考验。内部考验主要来自于去杠杆政策延续对于实体部门信用收缩的压力，而外部考验主要来自于中美贸易争端的影响，以及美联储持续加息对于外汇部门和国内金融资产估值的压力。同时，国内政策如何调整和应对，尚需等待 7 月份中央政治局会议对下半年经济工作的具体定调和部署。

回到我们关注的 A 股市场，大概率会在企业盈利增速的正面支撑与宏观各方面负面冲击的估值调整之间来回拉锯。宏观经济各方面的不确定性带来了股市风险偏好的迅速回落，但从乐观的角度看，本轮供给侧改革政策既有加法也有减法，宏观经济并未过热，也没有形成新一轮的产能“过剩”，反映在行业中观层面表现为多数行业的竞争格局有所优化，同时“去杠杆”政策在长期将能够带来中国经济的长期稳健发展和信用风险溢价的逐步回落。

从市场结构方面来看，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”；同时，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。

#### 4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目    | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资  | 18,629,255.80 | 74.35        |
|    | 其中：股票 | 18,629,255.80 | 74.35        |

|   |                   |               |        |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 2 | 固定收益投资            | 1,505,700.00  | 6.01   |
|   | 其中：债券             | 1,505,700.00  | 6.01   |
|   | 资产支持证券            | -             | -      |
| 3 | 贵金属投资             | -             | -      |
| 4 | 金融衍生品投资           | -             | -      |
| 5 | 买入返售金融资产          | 2,200,000.00  | 8.78   |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -      |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计      | 2,488,911.64  | 9.93   |
| 7 | 其他资产              | 231,843.43    | 0.93   |
| 8 | 合计                | 25,055,710.87 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 479,611.00    | 1.97         |
| C  | 制造业              | 13,062,734.20 | 53.75        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 95,600.00     | 0.39         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 502,197.00    | 2.07         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 120,939.00    | 0.50         |
| J  | 金融业              | 2,526,735.00  | 10.40        |
| K  | 房地产业             | 379,420.00    | 1.56         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 1,039,898.60  | 4.28         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -            |

|   |           |               |       |
|---|-----------|---------------|-------|
| P | 教育        | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作   | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 422,121.00    | 1.74  |
| S | 综合        | -             | -     |
|   | 合计        | 18,629,255.80 | 76.65 |

### 5.2.2 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。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量（股）   | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 000651 | 格力电器  | 41,600  | 1,961,440.00 | 8.07         |
| 2  | 600690 | 青岛海尔  | 83,400  | 1,606,284.00 | 6.61         |
| 3  | 000858 | 五 粮 液 | 19,300  | 1,466,800.00 | 6.04         |
| 4  | 601318 | 中国平安  | 20,500  | 1,200,890.00 | 4.94         |
| 5  | 600104 | 上汽集团  | 31,400  | 1,098,686.00 | 4.52         |
| 6  | 600741 | 华域汽车  | 43,900  | 1,041,308.00 | 4.28         |
| 7  | 600519 | 贵州茅台  | 1,400   | 1,024,044.00 | 4.21         |
| 8  | 300296 | 利亚德   | 68,000  | 875,840.00   | 3.60         |
| 9  | 601939 | 建设银行  | 132,200 | 865,910.00   | 3.56         |
| 10 | 002027 | 分众传媒  | 83,880  | 802,731.60   | 3.30         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -            | -            |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | 1,505,700.00 | 6.20         |
|    | 其中：政策性金融债 | 1,505,700.00 | 6.20         |
| 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） | -            | -    |
| 8  | 同业存单      | -            | -    |
| 9  | 其他        | -            | -    |
| 10 | 合计        | 1,505,700.00 | 6.20 |

### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 数量（张）  | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 018005 | 国开 1701 | 15,000 | 1,505,700.00 | 6.20         |

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的利亚德（300296）未获证监会2015年7月2日的许可，在新股配套募集资金到位前，先行以自有资金向交易对方支付部分现金对价，合计9,128.43万元。配套募集资金到位后，公司于2015年12月24日未经董事会审议将9,128.43万元募集资金由募集资金专户汇至公司其它账户，以募集资金置换了先期投入的自有资金，直至2017年4月20日才补充履行了董事会审议程序及相关信息披露义务。公司及相应高管人员上述行为违反了《创业板股票上市规则（2014年修订）》和《创业板上市公司规范

运作指引（2015年修订）》等相关规定，均于2018年5月4日受到深圳证券交易所通报批评的处分。

对该证券的投资决策程序的说明：公司是小间距LED行业巨擘。从“四轮战略”到“文化科技+金融”，战略升级路径清晰。收入利润稳增长，研发投入与现金流改善助推可持续。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。

5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 10,998.89  |
| 2  | 应收证券清算款 | 205,788.88 |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 15,055.66  |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 231,843.43 |

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告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情况。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 海富通量化多因子混 | 海富通量化多因子混 |
|----|-----------|-----------|
|----|-----------|-----------|

|                         | 合A            | 合C             |
|-------------------------|---------------|----------------|
| 基金合同生效日基金份额总额           | 25,595,406.97 | 203,671,682.67 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额   | 183,086.61    | 44,988.23      |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 10,213,550.26 | 194,414,406.53 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额  | -             | -              |
| 本报告期期末基金份额总额            | 15,564,943.32 | 9,302,264.37   |

注：本基金合同生效日为2018年04月23日。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 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 61 只公募基金。截至 2018 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模超过 574.03 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 2018 年 6 月 30 日，投资咨询及海外业务规模超过 32 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 2018 年 6 月

30 日，海富通为近 80 家企业超过 401 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 2018 年 6 月 30 日，海富通管理的特定客户资产管理业务规模超过 443 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，中国证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。

2016 年 3 月，国内权威财经媒体《中国证券报》授予海富通基金管理有限公司“固定收益投资金牛基金公司”。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。

## 9 备查文件目录

### 9.1 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）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在指定报刊上披露的各项公告

### 9.2 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。

### 9.3 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  
二〇一八年七月十八日