

# 华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资 基金 2018 年半年度报告摘要

2018 年 06 月 30 日

基金管理人：华泰证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 24 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上董事签字同意，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 2018 年 8 月 21 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 2 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华泰紫金智能量化股票发起
基金主代码	005502
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 2 月 1 日
基金管理人	华泰证券(上海)资产管理有限公司
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	142,255,948.76 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化选股模型精选股票，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	管理人先根据宏观分析和市场判断确定大类资产的配置，然后充分利用量化模型，先将原始行业数据进行深层次的加工、计算，建立各个行业的分析逻辑，再通过模型构造，建立起因子分析框架，然后挖掘数据形成因子，通过因子拟合趋势，进行回溯和验证，从而挖掘出不同行业的敏感因子，提取合成不同行业的观察指标，结合管理人线下的研究进行行业配置和个券选择，构建合理的投资组合。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*90%+上证国债指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，是证券投资基金中的高预期风险和高预期收益的产品。基金的预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、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	华泰证券(上海)资产管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱鸣
	联系电话	021-68984388
	电子邮箱	mingzhu@htsc.com
客户服务电话	4008895597	95566
传真	025-84579938	010-66594942

### 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	htamc.htsc.com.cn
----------------------	-------------------

基金半年度报告备置地点	基金管理人、托管人住所
-------------	-------------

### § 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	2018 年 02 月 01 日-2018 年 06 月 30 日
本期已实现收益	-7,431,779.43
本期利润	-7,228,672.82
加权平均基金份额本期利润	-0.0368
本期加权平均净值利润率	-3.72%
本期基金份额净值增长率	-4.82%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 06 月 30 日
期末可供分配利润	-7,216,728.21
期末可供分配基金份额利润	-0.0507
期末基金资产净值	135,392,983.89
期末基金份额净值	0.9518
3.1.3 累计期末指标	2018 年 06 月 30 日
基金份额累计净值增长率	-4.82%

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用（例如，开放式基金的转换费等），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、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。

4、本基金合同生效日为 2018 年 2 月 1 日，至本报告期末未满 1 年，因此主要会计数据和财务指标只列示基金合同生效日至 2018 年 6 月 30 日数据。

#### 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

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	-0.94%	0.57%	-7.25%	1.25%	6.31%	-0.68%
过去三个月	-4.92%	0.47%	-9.96%	1.04%	5.04%	-0.57%

自基金合同生效起至今	-4.82%	0.39%	-15.47%	1.12%	10.65%	-0.73%
------------	--------	-------	---------	-------	--------	--------

### 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

华泰紫金智能量化股票发起累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日期为 2018 年 2 月 1 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作未满 1 年。本基金的建仓期为 6 个月，截止报告期末，本基金未满建仓期

## § 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

华泰证券（上海）资产管理有限公司是经中国证监会证监许可 [2014] 679 号文批准，由华泰证券股份有限公司设立的全资资产管理子公司。2014 年 10 月成立时，注册资本 3 亿元人民币。2015 年 10 月增加注册资本至 10 亿元人民币。2016 年 7 月增加注册资本至 26 亿元人民币。

2016 年 7 月，公司经中国证监会证监许可 [2016] 1682 号文批准，获得公开募集证券投资基金管理业务资格。公司主要业务为证券资产管理业务、公开募集证券投资基金业务及中国证监会批准的其它业务。截至 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理华泰紫金天天金交易型货币市场基金、华泰紫金零钱宝货币市场基金、华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金、华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金、华泰紫金智盈债券型证券投资基金五只证券投资基金。

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		
熊志勇	本基金的基金经理、基金量化部负责人	2018 年 02 月 01 日	-	12	熊志勇先生，英国考文垂大学博士。曾任华安基金管理有限公司高级金融工程师、基金经理助理，国投瑞银基金管理有限公司基金经理、量化及衍生品负责人，鹏华基金管理有限公司量化投资部总经理，上投摩根基金管理有限公司量化投资部总监，上海旷怀资产管理有限公司投资总监，2016 年 11 月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司。2010 年 11 月 27 日至 2011 年 8 月 17 日任国投瑞银瑞和沪深 300 指数分级证券投资基金基金经理。2017 年 12 月起任华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金基金经理。2018 年 2 月起任华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金经理。
毛甜	本基金的基金经理	2018 年 03 月 10 日	-	8	毛甜女士，武汉大学金融工程硕士。2010 年至 2012 年曾任国信证券经济研究所金融工程部助理分析师；2012 年至 2017 年任职光大富尊投资有限公司，历任量化研究员、量化投资经理。2017 年 7 月加入华泰

					证券(上海)资产管理有限公司, 2017 年 12 月起担任华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金基金经理。2018 年 3 月起担任华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注:1. 对基金的首任基金经理, 其“任职日期”为基金合同生效日, “离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期; 对此后的非首任基金经理, “任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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, 本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金合同》的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的基础上, 为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内, 基金运作整体合法合规, 没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 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

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立并健全了有效的公平交易执行体系, 保证公平对待旗下的每一个基金组合。

公司建立了公募基金投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度, 以科学规范的投资决策体系, 采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制, 通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现; 通过建立层级完备的公司股票池和债券库, 完善各类具体资产管理业务组织结构, 规范各项业务之间的关系, 在保证各投资组合既具有相对独立性的同时, 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; 通过对异常交易行为的监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内, 本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定, 确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动和环节得到公平对待, 各投资组合

均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发现任何违反公平交易的行为。

#### 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存在异常交易行为。

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

### 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

2018 年上半年 A 股市场波动率水平快速上升，年初经历了一轮快速上涨，随后市场在国内去杠杆、中美贸易摩擦等多个内外部因素冲击下震荡下行。截至本报告期末，上证综指下跌 13.90%，深证成份指数下跌 15.04%，上证 50 指数下跌 13.30%，沪深 300 指数下跌 12.90%，中证 1000 指数下跌 20.08%，创业板指数下跌 8.33%。

本基金成立于 2 月 1 日，本报告期涵盖了基金的建仓期，考虑到当前市场面临诸多风险，我们采取谨慎的建仓策略，依据量化模型，本着勤勉尽责的态度，严格遵守基金合同，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值收益率为-4.82%，同期业绩比较基准收益率-15.47%。

### 4.5 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 年下半年，在中美贸易摩擦、国内去杠杆等长期因素的影响下，国内经济仍然面临下行压力和不确定性，但当前政策已开始转向，信用环境的修复有望改善市场对经济增速的悲观预期，经济下行的压力同时也是国内经济改革的动力。我们认为经过前期的下跌，市场下行空间比较有限，但还需等待经济与企业盈利的回升。本基金将继续依据量化模型，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值小组，公司领导担任估值小组组长，基金管理部、运营部、交易部、合规风控部指定人员担任委员。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。



与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司以及中国证券业协会等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 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

- 1、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形；
- 2、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

### § 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”）在华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金（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遵规守信、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：华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金

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		5,650,027.37
结算备付金		6,233,832.09
存出保证金		156,970.87
交易性金融资产		113,825,258.22
其中：股票投资		110,609,936.72
基金投资		-
债券投资		3,215,321.50
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		10,000,000.00
应收证券清算款		3,088,529.68
应收利息		96,014.33
应收股利		-
应收申购款		98.52
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		139,050,731.08
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年6月30日</b>
<b>负 债：</b>		
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		-
应付证券清算款		782,657.02
应付赎回款		1,251,654.13
应付管理人报酬		171,501.14
应付托管费		28,583.52
应付销售服务费		-
应付交易费用		1,314,668.04
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债		108,683.34
负债合计		3,657,747.19
<b>所有者权益：</b>		
实收基金		142,255,948.76
未分配利润		-6,862,964.87
所有者权益合计		135,392,983.89
负债和所有者权益总计		139,050,731.08

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额 142,255,948.76 份，基金份额净值 0.9518 元。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 2 月 1 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 2 月 1 日（基金合同生效日） 至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-3,039,837.42
1. 利息收入		1,592,338.96
其中：存款利息收入		820,933.22
债券利息收入		25,366.59
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		746,039.15
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,727,443.13
其中：股票投资收益		-5,957,204.62
基金投资收益		-
债券投资收益		2,544.40
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		227,217.09
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		203,106.61
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)		892,160.14
<b>减：二、费用</b>		4,188,835.40
1. 管理人报酬		1,219,959.10
2. 托管费		203,326.49
3. 销售服务费		-
4. 交易费用		2,643,840.94
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用		121,708.87
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		-7,228,672.82
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-7,228,672.82

注：本基金于 2018 年 2 月 1 日成立，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 2 月 1 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 2 月 1 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）	343,068,498.19	-	343,068,498.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,228,672.82	-7,228,672.82
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）	-200,812,549.43	365,707.95	-200,446,841.48
其中：1. 基金申购款	1,395,586.37	-5,927.65	1,389,658.72
2. 基金赎回款	-202,208,135.80	371,635.60	-201,836,500.20
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）	142,255,948.76	-6,862,964.87	135,392,983.89

注：本基金于 2018 年 2 月 1 日成立，无上年度可比期间数据。

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：

<u>崔春</u>	<u>朱前</u>	<u>朱鸣</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金(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”)《关于准予华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可[2017]1224号) 批准,由华泰证券(上海)资产管理有限公司(以下简称“华泰资管”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《华泰紫金智能量化股票型发

起式证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2018 年 2 月 1 日生效。本基金为契约型开放式发起式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 343068498.19 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰资管，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。该资金已由毕马威华振会计事务所审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金合同》和《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金投资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（包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具（含同业存单）、权证、资产支持证券、股指期货、国债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相关规定）。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率\*90%+上证国债指数收益率\*10%

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括债券投资和买入返售金融资产等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的债券，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一

项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。

本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资



产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 每一基金份额享有同等分配权；

(4) 基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 于 2017 年 12 月 26 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》

之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 12 月 26 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于证券交易所上市或挂牌的固定收益品种及在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期间未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号文《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 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (1) 证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (2) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，

建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日(含)以后，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对基金在 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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

(3)对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

### 6.4.7 关联方关系

#### 6.4.7.1 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

本基金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。

#### 6.4.7.2 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
华泰证券(上海)资产管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限公司	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，并以一般交易价格为定价基础。

### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
华泰证券	2,046,965,072.79	100.00

##### 6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日
-------	--

	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
华泰证券	10,929,763.10	100.00

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年2月1日（基金合同生效日）至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券 回购成交总额的比例 (%)
华泰证券	3,042,367,000.00	100.00

#### 6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年2月1日（基金合同生效日）至2018年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例 (%)	期末应付佣金 余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
华泰证券股份有限公司	1,496,942.04	100.00	1,314,668.04	100.00

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年2月1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	1,219,959.10
其中：支付销售机构的客户维护费	560,824.57

注：支付基金管理人华泰证券资管的基金管理费按前一日基金资产净值 0.8%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 2 月 1 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	203,326.49

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。25

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期内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。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2018 年 2 月 1 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2018 年 2 月 1 日）持有的基金份额	10,000,900.09
期初持有的基金份额	10,000,900.09
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	10,000,900.09
期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.03%

注：基金管理人投资本基金适用的申购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 6.4.8.4.2 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

注：关联方投资本基金适用的申购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

### 6.4.8.5 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
	2018 年 2 月 1 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
中国银行股份有限公司	5,650,027.37	215,312.76

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

#### 6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300197	铁汉生态	2018年5月28日	重大事项停牌	5.37			225,000	1,476,000.00	1,208,250.00	-
002210	飞马国际	2018年3月26日	重大事项停牌	12.33	2018年08月13日	11.07	29,258	366,454.58	360,751.14	-
000723	美锦能源	2018年3月27日	重大事项停牌	5.43	2018年07月31日	4.89	62,900	370,030.00	341,547.00	-

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

###### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

## § 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	110,609,936.72	79.55
	其中：股票	110,609,936.72	79.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,215,321.50	2.31
	其中：债券	3,215,321.50	2.31
	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	10,000,000.00	7.19
	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	11,883,859.46	8.55
8	其他各项资产	3,341,613.40	2.40
9	合计	139,050,731.08	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	426,816.00	0.32
B	采矿业	9,394,171.00	6.94
C	制造业	58,494,857.58	43.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,709,226.00	1.26
E	建筑业	2,329,188.00	1.72
F	批发和零售业	1,405,684.00	1.04
G	交通运输、仓储和邮政业	3,325,274.00	2.46
H	住宿和餐饮业	948,233.00	0.70
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,240,227.00	1.65
J	金融业	19,730,085.00	14.57
K	房地产业	5,115,996.00	3.78
L	租赁和商务服务业	1,157,023.14	0.85
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,114,400.00	0.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	2,278,756.00	1.68
R	文化、体育和娱乐业	940,000.00	0.69
S	综合	-	-
	合计	110,609,936.72	81.70

### 7.3 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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601088	中国神华	138,000	2,751,720.00	2.03
2	600036	招商银行	103,900	2,747,116.00	2.03
3	000528	柳工	213,200	2,283,372.00	1.69
4	600348	阳泉煤业	244,900	1,751,035.00	1.29
5	601998	中信银行	280,000	1,738,800.00	1.28
6	600325	华发股份	223,900	1,730,747.00	1.28
7	000581	威孚高科	78,200	1,729,002.00	1.28
8	601699	潞安环能	185,400	1,716,804.00	1.27
9	601169	北京银行	284,600	1,716,138.00	1.27
10	600383	金地集团	167,900	1,710,901.00	1.26

### 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601939	建设银行	16,150,564.00	11.93
2	000938	紫光股份	14,201,280.00	10.49
3	600036	招商银行	13,569,748.93	10.02
4	300070	碧水源	12,677,816.00	9.36
5	601398	工商银行	12,505,000.00	9.24
6	601628	中国人寿	10,450,002.00	7.72
7	601088	中国神华	8,363,428.53	6.18
8	601377	兴业证券	8,334,695.00	6.16
9	601699	潞安环能	7,740,749.16	5.72
10	600019	宝钢股份	7,680,943.00	5.67
11	000807	云铝股份	7,579,206.00	5.60
12	600362	江西铜业	7,571,299.99	5.59
13	600837	海通证券	7,530,095.00	5.56
14	000568	泸州老窖	7,303,373.76	5.39
15	300401	花园生物	7,100,457.00	5.24



16	601318	中国平安	6,963,238.00	5.14
17	001979	招商蛇口	6,521,472.00	4.82
18	600340	华夏幸福	6,371,075.00	4.71
19	002233	塔牌集团	6,094,622.00	4.50
20	600383	金地集团	5,797,623.49	4.28
21	300036	超图软件	5,778,843.80	4.27
22	600782	新钢股份	5,728,906.46	4.23
23	600348	阳泉煤业	5,664,610.02	4.18
24	000581	威孚高科	5,658,567.00	4.18
25	000878	云南铜业	5,648,106.99	4.17
26	000898	鞍钢股份	5,646,989.00	4.17
27	000651	格力电器	5,635,323.00	4.16
28	600376	首开股份	5,483,773.30	4.05
29	600503	华丽家族	5,482,415.73	4.05
30	600266	北京城建	5,457,783.00	4.03
31	600839	四川长虹	5,417,641.30	4.00
32	000039	中集集团	5,368,404.42	3.97
33	300088	长信科技	5,310,497.00	3.92
34	600507	方大特钢	5,266,264.00	3.89
35	600588	用友网络	5,262,485.10	3.89
36	002128	露天煤业	5,259,491.92	3.88
37	000001	平安银行	5,256,431.00	3.88
38	002080	中材科技	5,162,780.00	3.81
39	002460	赣锋锂业	5,113,378.00	3.78
40	601111	中国国航	5,055,155.00	3.73
41	600498	烽火通信	4,978,678.00	3.68
42	601766	中国中车	4,952,607.00	3.66
43	600066	宇通客车	4,939,020.00	3.65
44	600216	浙江医药	4,844,892.27	3.58
45	600282	南钢股份	4,835,894.00	3.57
46	600115	东方航空	4,737,862.02	3.50
47	000789	万年青	4,728,088.75	3.49
48	000799	酒鬼酒	4,597,555.00	3.40
49	600188	兖州煤业	4,541,029.27	3.35
50	300677	英科医疗	4,541,015.00	3.35
51	601169	北京银行	4,506,586.00	3.33
52	300124	汇川技术	4,474,880.00	3.31
53	600373	中文传媒	4,461,043.14	3.29
54	601390	中国中铁	4,452,781.80	3.29
55	002310	东方园林	4,425,722.50	3.27
56	600489	中金黄金	4,423,043.00	3.27
57	002573	清新环境	4,420,070.00	3.26

58	000418	小天鹅 A	4,418,121.22	3.26
59	601168	西部矿业	4,417,187.40	3.26
60	002236	大华股份	4,344,288.80	3.21
61	002714	牧原股份	4,336,793.96	3.20
62	600908	无锡银行	4,297,798.00	3.17
63	002142	宁波银行	4,274,632.32	3.16
64	601336	新华保险	4,257,401.00	3.14
65	002572	索菲亚	4,245,760.68	3.14
66	300188	美亚柏科	4,219,062.38	3.12
67	000823	超声电子	4,216,906.34	3.11
68	002497	雅化集团	4,192,373.00	3.10
69	600521	华海药业	4,191,721.00	3.10
70	600801	华新水泥	4,190,208.00	3.09
71	603993	洛阳钼业	4,160,903.00	3.07
72	600352	浙江龙盛	4,151,039.00	3.07
73	600970	中材国际	4,121,550.89	3.04
74	601857	中国石油	4,109,147.00	3.03
75	300017	网宿科技	4,109,126.00	3.03
76	600093	易见股份	4,097,853.00	3.03
77	600585	海螺水泥	4,044,275.00	2.99
78	601211	国泰君安	4,014,265.00	2.96
79	000681	视觉中国	4,011,528.00	2.96
80	601601	中国太保	3,940,057.00	2.91
81	300377	赢时胜	3,930,310.00	2.90
82	600258	首旅酒店	3,907,846.00	2.89
83	600690	青岛海尔	3,907,330.00	2.89
84	601012	隆基股份	3,903,339.14	2.88
85	000732	泰禾集团	3,898,772.00	2.88
86	600699	均胜电子	3,898,128.16	2.88
87	600522	中天科技	3,871,841.00	2.86
88	600256	广汇能源	3,829,154.00	2.83
89	600803	新奥股份	3,825,530.97	2.83
90	300115	长盈精密	3,823,440.00	2.82
91	002127	南极电商	3,821,597.56	2.82
92	600000	浦发银行	3,809,290.45	2.81
93	600596	新安股份	3,792,330.00	2.80
94	600566	济川药业	3,725,013.00	2.75
95	600298	安琪酵母	3,705,924.90	2.74
96	601238	广汽集团	3,689,811.00	2.73
97	300144	宋城演艺	3,664,945.18	2.71
98	600231	凌钢股份	3,637,539.00	2.69
99	300348	长亮科技	3,617,136.00	2.67

100	000528	柳工	3,558,508.00	2.63
101	601788	光大证券	3,537,991.85	2.61
102	600060	海信电器	3,530,827.00	2.61
103	002500	山西证券	3,530,542.00	2.61
104	601233	桐昆股份	3,529,800.84	2.61
105	600160	巨化股份	3,528,474.00	2.61
106	600900	长江电力	3,503,555.00	2.59
107	600025	华能水电	3,465,000.00	2.56
108	300450	先导智能	3,417,996.18	2.52
109	600879	航天电子	3,402,736.00	2.51
110	002001	新和成	3,378,738.00	2.50
111	300058	蓝色光标	3,367,138.00	2.49
112	600809	山西汾酒	3,365,378.40	2.49
113	601668	中国建筑	3,241,310.00	2.39
114	600741	华域汽车	3,205,207.00	2.37
115	000960	锡业股份	3,103,989.00	2.29
116	002223	鱼跃医疗	3,077,900.00	2.27
117	002626	金达威	3,071,166.62	2.27
118	002271	东方雨虹	3,070,024.00	2.27
119	002340	格林美	3,033,464.00	2.24
120	600516	方大炭素	3,024,973.00	2.23
121	000717	韶钢松山	2,995,125.00	2.21
122	300253	卫宁健康	2,975,976.00	2.20
123	600567	山鹰纸业	2,949,871.00	2.18
124	600487	亨通光电	2,905,801.50	2.15
125	300271	华宇软件	2,861,077.00	2.11
126	601636	旗滨集团	2,800,808.00	2.07
127	600549	厦门钨业	2,770,685.00	2.05
128	600110	诺德股份	2,770,336.60	2.05
129	600584	长电科技	2,764,512.00	2.04
130	601166	兴业银行	2,760,247.38	2.04
131	300015	爱尔眼科	2,757,876.56	2.04
132	002241	歌尔股份	2,728,079.75	2.01
133	002709	天赐材料	2,717,283.00	2.01
134	600763	通策医疗	2,708,942.00	2.00

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601939	建设银行	14,462,544.00	10.68
2	000938	紫光股份	13,581,453.01	10.03

3	601398	工商银行	12,462,000.00	9.20
4	300070	碧水源	11,207,877.48	8.28
5	600036	招商银行	10,883,813.00	8.04
6	601628	中国人寿	10,566,271.90	7.80
7	600837	海通证券	7,557,594.98	5.58
8	601377	兴业证券	7,309,618.00	5.40
9	000807	云铝股份	7,257,511.00	5.36
10	601318	中国平安	6,940,922.00	5.13
11	300401	花园生物	6,677,238.67	4.93
12	000568	泸州老窖	6,447,958.00	4.76
13	600019	宝钢股份	6,391,233.11	4.72
14	600340	华夏幸福	6,348,663.00	4.69
15	002233	塔牌集团	6,120,838.00	4.52
16	001979	招商蛇口	5,952,014.00	4.40
17	600362	江西铜业	5,897,693.68	4.36
18	601699	潞安环能	5,867,983.84	4.33
19	000898	鞍钢股份	5,659,687.00	4.18
20	000878	云南铜业	5,639,687.90	4.17
21	601088	中国神华	5,513,905.82	4.07
22	600503	华丽家族	5,495,227.68	4.06
23	600376	首开股份	5,485,845.00	4.05
24	000039	中集集团	5,388,357.78	3.98
25	600266	北京城建	5,368,035.00	3.96
26	002128	露天煤业	5,282,874.40	3.90
27	600839	四川长虹	5,280,750.15	3.90
28	000001	平安银行	5,272,574.00	3.89
29	600588	用友网络	5,242,431.60	3.87
30	300088	长信科技	5,231,861.00	3.86
31	600507	方大特钢	5,224,033.00	3.86
32	600498	烽火通信	5,004,064.62	3.70
33	601111	中国国航	4,950,846.72	3.66
34	002080	中材科技	4,945,764.00	3.65
35	300036	超图软件	4,891,069.92	3.61
36	600282	南钢股份	4,737,544.20	3.50
37	600115	东方航空	4,668,230.00	3.45
38	000651	格力电器	4,655,367.00	3.44
39	600489	中金黄金	4,561,653.44	3.37
40	300677	英科医疗	4,519,391.00	3.34
41	600782	新钢股份	4,452,983.54	3.29
42	002460	赣锋锂业	4,424,595.00	3.27
43	601390	中国中铁	4,407,374.80	3.26
44	002573	清新环境	4,354,769.00	3.22

45	600373	中文传媒	4,322,212.56	3.19
46	002142	宁波银行	4,317,746.02	3.19
47	002310	东方园林	4,286,776.00	3.17
48	600801	华新水泥	4,270,459.00	3.15
49	000789	万年青	4,265,859.85	3.15
50	002236	大华股份	4,240,087.16	3.13
51	600908	无锡银行	4,231,490.00	3.13
52	002497	雅化集团	4,200,046.00	3.10
53	601336	新华保险	4,188,624.00	3.09
54	603993	洛阳钼业	4,188,542.00	3.09
55	600352	浙江龙盛	4,179,339.00	3.09
56	600383	金地集团	4,174,356.59	3.08
57	600093	易见股份	4,173,830.67	3.08
58	000823	超声电子	4,111,457.06	3.04
59	600970	中材国际	4,100,409.94	3.03
60	601857	中国石油	4,094,125.00	3.02
61	300017	网宿科技	4,081,927.15	3.01
62	000418	小天鹅 A	4,056,641.43	3.00
63	000681	视觉中国	3,997,575.00	2.95
64	000732	泰禾集团	3,937,589.00	2.91
65	600699	均胜电子	3,924,024.36	2.90
66	600690	青岛海尔	3,921,249.08	2.90
67	002714	牧原股份	3,919,542.00	2.89
68	000581	威孚高科	3,909,620.00	2.89
69	600348	阳泉煤业	3,900,219.00	2.88
70	600256	广汇能源	3,876,116.00	2.86
71	300377	赢时胜	3,866,583.05	2.86
72	600803	新奥股份	3,842,727.54	2.84
73	300348	长亮科技	3,717,355.00	2.75
74	601238	广汽集团	3,710,842.00	2.74
75	600231	凌钢股份	3,624,385.00	2.68
76	600060	海信电器	3,600,370.00	2.66
77	601233	桐昆股份	3,585,401.58	2.65
78	601788	光大证券	3,576,605.89	2.64
79	600160	巨化股份	3,570,745.00	2.64
80	300124	汇川技术	3,558,182.38	2.63
81	601012	隆基股份	3,555,259.11	2.63
82	000799	酒鬼酒	3,544,507.00	2.62
83	002500	山西证券	3,509,468.92	2.59
84	600522	中天科技	3,499,455.28	2.58
85	600025	华能水电	3,475,000.00	2.57
86	002572	索菲亚	3,467,233.52	2.56

87	600879	航天电子	3,406,410.97	2.52
88	300450	先导智能	3,366,619.80	2.49
89	600216	浙江医药	3,324,482.83	2.46
90	002001	新 和 成	3,321,317.25	2.45
91	300188	美亚柏科	3,315,032.70	2.45
92	601766	中国中车	3,293,394.00	2.43
93	300115	长盈精密	3,274,591.00	2.42
94	601168	西部矿业	3,273,830.44	2.42
95	600066	宇通客车	3,197,090.00	2.36
96	300058	蓝色光标	3,151,777.37	2.33
97	002626	金达威	3,094,844.00	2.29
98	002127	南极电商	3,027,829.50	2.24
99	300253	卫宁健康	2,991,920.18	2.21
100	002271	东方雨虹	2,970,205.00	2.19
101	000717	韶钢松山	2,931,791.00	2.17
102	600567	山鹰纸业	2,923,560.00	2.16
103	600487	亨通光电	2,922,659.18	2.16
104	600258	首旅酒店	2,921,859.00	2.16
105	300271	华宇软件	2,868,470.00	2.12
106	600521	华海药业	2,857,454.00	2.11
107	600566	济川药业	2,846,997.00	2.10
108	600763	通策医疗	2,842,400.00	2.10
109	300144	宋城演艺	2,826,444.00	2.09
110	600596	新安股份	2,811,737.00	2.08
111	000960	锡业股份	2,795,282.95	2.06
112	601169	北京银行	2,786,847.00	2.06
113	601166	兴业银行	2,781,216.00	2.05
114	600188	兖州煤业	2,747,474.49	2.03
115	600518	康美药业	2,741,453.00	2.02
116	002709	天赐材料	2,738,610.00	2.02

### 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

买入股票成本（成交）总额	1,081,664,060.76
卖出股票收入（成交）总额	965,301,012.03

### 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	3,215,321.50	2.37

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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,215,321.50	2.37

### 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	019571	17 国债 17	32,150	3,215,321.50	2.37

### 7.7 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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 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

注：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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 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

注：本基金本报告期末未持有国债期货

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：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

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行因未履行其它职责，于 2018 年 2 月 12 日被银保监会依据相关法规给予公开行政处罚决定，罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

主要违法违规事实：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；

（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；

（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。

本基金管理人对该公司进行了深入的解和分析，认为该事项对公司的盈利情况暂不会造成重大不利影响，我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

前十名证券中的其余发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	156,970.87
2	应收证券清算款	3,088,529.68
3	应收股利	-
4	应收利息	96,014.33
5	应收申购款	98.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-



8	其他	-
9	合计	3,341,613.40

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

### § 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

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 (%)
1,780	79,919.07	27,202,193.15	19.12	115,053,755.61	80.88

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	11,960.26	0.01

#### 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情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份额 比例(%)	发起份额总数	发起份额占基 金总份额比例 (%)	发起份额承诺 持有期限
基金管理人固有资金	10,000,900.09	7.03	10,000,000.00	7.01	3年

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,900.09	7.03	10,000,000.00	7.01	3 年

注:持有份额总数部分包含利息结转的份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2018年2月1日)基金份额总额	343,068,498.19
本报告期期初基金份额总额	-
本报告期基金总申购份额	1,395,586.37
减:本报告期基金总赎回份额	202,208,135.80
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	142,255,948.76

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无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

2018年3月1日,华泰证券(上海)资产管理有限公司发布公告,聘任甘华、席晓峰为公司副总经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本告期为基金进行审计的会计师事务所未发生变更。

### 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

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况；本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其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	
华泰证券股份有限公司	2	2,046,965,072.79	100.00%	1,496,942.04	100.00%	

注：我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

#### 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
华泰证券股份有限公司	10,929,763.10	100.00%	3,042,367,000.00	100.00%	-	-

## § 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

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于 2018 年 3 月 1 日在《中国证券报》等报刊和本公司官网上刊登了“华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告，分别任命甘华、席晓峰为公司副总经理，上述任命自 2018 年 2 月 27 日起正式生效。

2、根据管理人于 2018 年 3 月 10 日刊登的《华泰证券（上海）资产管理有限公司关于增聘华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金经理的公告》，自 2018 年 3 月 10 日起本基金增

聘毛甜女士为本基金基金经理，与熊志勇先生共同管理本基金

华泰证券(上海)资产管理有限公司

2018 年 08 月 24 日