

# 华泰紫金智盈债券型证券投资基金 2018 年 半年度报告

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 24 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。

基金托管人中国建设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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 3 月 15 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
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 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
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 .....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	12
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 .....	13
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 .....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
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 .....	38
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 .....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	38
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 .....	38
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 .....	38
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 .....	39

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 .....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	39
7.12 投资组合报告附注 .....	39
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	40
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 .....	41
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>41</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	41
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 .....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	41
10.4 基金投资策略的改变 .....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	42
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 .....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	42
10.8 其他重大事件 .....	42
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>44</b>
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 .....	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	45
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>45</b>
12.1 备查文件目录 .....	45
12.2 存放地点 .....	46
12.3 查阅方式 .....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰紫金智盈债券型证券投资基金	
基金简称	华泰紫金智盈债	
基金主代码	005467	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 3 月 15 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	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	781,068.08 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰紫金智盈债券 A	华泰紫金智盈债券 C
下属分级基金的交易代码	005467	005468
报告期末下属分级基金的 份额总额	777,177.53 份	3,890.55 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金主要通过采取信用债投资策略、收益率曲线策略、杠杆放大策略、资产支持证券投资策略、中小企业私募债券投资策略、国债期货投资策略等投资策略来实现投资目标。
业绩比较基准	中债信用债总指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险/收益的产品。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱鸣	田青
	联系电话	021-68984388	(010)67595096
	电子邮箱	mingzhu@htsc.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4008895597	(010)67595096
传真		025-84579938	010-66275853
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区东方路18号21楼	中国北京西城区金融大街25号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区东方路18号21楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		崔春	田国立

### 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, 证券日报
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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰证券(上海)资产管理有限公司	中国(上海)自由贸易试验区东方路18号21层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年03月15日(基金合同生效日)-2018年06月30日)	
	华泰紫金智盈债券 A	华泰紫金智盈债券 C
本期已实现收益	1,211,677.65	47.08
本期利润	1,211,681.52	43.21
加权平均基金份额本期利润	0.0121	0.0088
本期加权平均净	1.20%	-2.00%

值利润率		
本期基金份额净值增长率	5.98%	0.93%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配利润	46,463.36	36.15
期末可供分配基金份额利润	0.0598	0.0093
期末基金资产净值	823,686.19	3,926.89
期末基金份额净值	1.0598	1.0093
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	5.98%	0.93%

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 3 月 15 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

华泰紫金智盈债券 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	5.15%	1.06%	0.06%	0.03%	5.09%	1.03%
过去三个月	5.88%	0.62%	0.37%	0.06%	5.51%	0.56%
自基金合同	5.98%	0.56%	0.66%	0.06%	5.32%	0.50%

华泰紫金智盈债券 C

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	0.23%	0.03%	0.06%	0.03%	0.17%	-0.00%
过去三个月	0.92%	0.02%	0.37%	0.06%	0.55%	-0.04%
自基金合同	0.93%	0.02%	0.66%	0.06%	0.27%	-0.04%

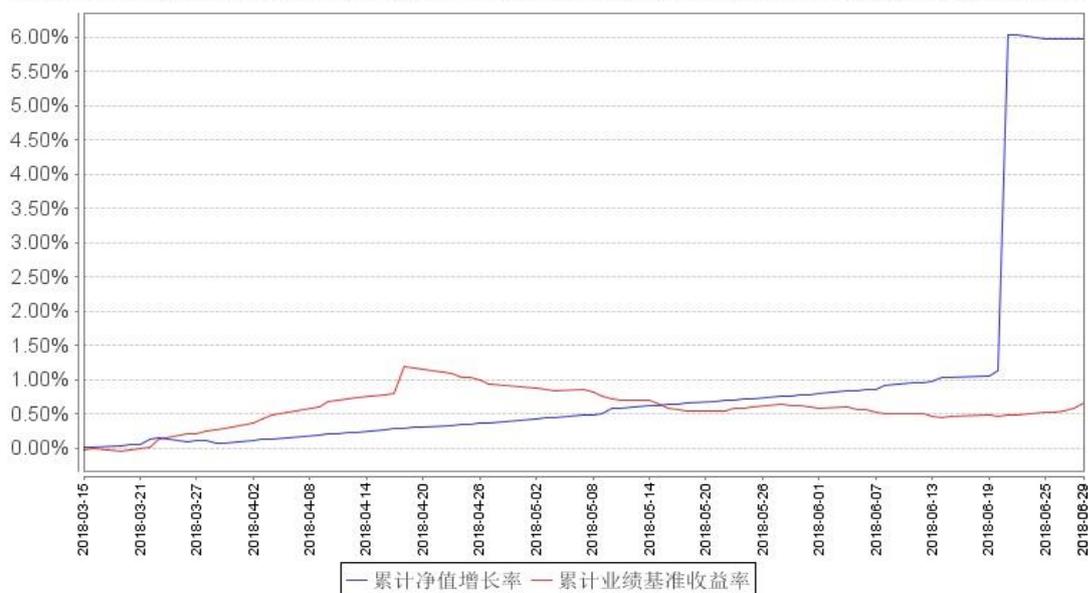
注:1、本基金的基金合同生效日期为 2018 年 3 月 15 日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作未满 1 年;

2、本基金的建仓期为 6 个月,截至本报告期末,本基金尚处于建仓期内;

3、本基金基准收益率=中债信用债总指数(全价)收益率。

### 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

华泰紫金智盈债券A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



华泰紫金智盈债券C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



## § 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		
李博良	本基金基金经理	2018 年 03 月 15 日	-	5 年	硕士研究生，2013 年加入华泰证券从事资产管理业务，历任华泰证券资产管理总部

					交易员，华泰证券(上海)资产管理有限公司投资助理，2017年8月起任华泰紫金零钱宝货币市场基金基金经理，2018年3月起任华泰紫金智盈债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注:1、上述基金经理的任职日期及离任日期均以基金公告为准;

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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《华泰紫金智盈债券型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

18 年开年经济稳定，一季度数据受春节影响略有扰动，二季度开始经济略有回落。分项来看，财政政策叠加金融监管收紧，影响了基建投资的融资渠道，基建投资增速持续回落，对 GDP 形成一定拖累。房地产投资数据趋稳，在货币化棚改的带动下三四线城市库存保持低位。在全球经济复苏的大背景下，出口增速年初有所恢复，但后续受贸易战的影响，数据波动加剧。CPI 在 2 月达到高点后逐步下滑，上半年整体处于较低水平。近期油价上升动力不足，猪肉价格依旧磨底，短期通胀可控。

今年以来货币政策逐步宽松。央行分别于 2 月、4 月中旬和 6 月下旬进行定向降准，分别用于临时释放流动性、置换 MLF 及支持小微贷款，四月份以来总计释放流动性 1.1 万亿。严监管下商业银行表外非标业务大幅收缩，社融和 M2 同比增速下滑，特别是 6 月社融增速下滑超预期。国内货币政策逐步转向，央行货币市场报告中流动性基调变为合理充裕，6 月中旬开始持续向市场注入流动性。叠加经济、金融数据不达预期，市场对紧信用导致宏观经济下行担忧再起，利率债收益率快速下行，带动中高等级信用债利率下行。但是宽货币向宽信用传导路径不通畅，信用利差依旧在历史高位。

操作方面，报告期内基金以中短期存款及短久期信用债为主要配置资产。基金建仓初期，投资相对谨慎，控制久期，等待后续较好的配置时点。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期 A 级基金净值收益率为 5.98%，C 级基金净值收益率为 0.93%，同期业绩比较基准收益率为 0.66%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前信用收缩环境下，后续投资的下行压力对经济的影响或将持续，随着未来贸易战的影响持续释放，预计经济仍有一定下行压力。宽货币仍将是货币政策的主基调，央行对货币宽松的程度相机抉择，同时也将释放信号防止市场对信用违约过度恐慌。通过监管手段调整及不良资产处置，提升银行的信贷投放能力，以对冲表外部分的收缩。国债、地方债放量发行，对冲基建投资增速下降过快，进行逆周期调整。

6 月中旬以来资金面非常宽松，6 月底超储率达 1.74%，DR007 甚至低于 OMO 利率，最新同业存单的发行利率低于 16 年水平。预计下半年监管将进行政策修复，通过增加信贷、债转股、财政

投放加大等多种方式托底经济。

利率债受益于融资需求放缓，仍有下行动力。但考虑到下半年社融数据回升，经济可能会企稳。发达国家场正值加息周期，中美利差目前已处于较低水平。国内外多种因素叠加，短期都将制约利率债下行空间。资管新规细则温和落地，信用收缩和市场风险偏好还将继续下。债券市场下半年到期和回售量大增，特别集中在地产等融资需求旺盛行业，致个券风险容易暴露。预计中低等级信用利差仍将维持高位，久期 3 年以内的中高等级信用债值得关注。

产品操作上，组合投资以信用债配置为主，控制风险，关注短久期高收益债及中高等级信用债的套息机会。

#### 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

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金 A 类份额持有人和 C 类份额持有人均未进行利润分配。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

# § 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：华泰紫金智盈债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	911,010.38
结算备付金		-
存出保证金		1,748.87
交易性金融资产	6.4.7.2	-
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		-
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	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	1,194.78
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		913,954.03
<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	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		2.12
应付管理人报酬		22,951.06
应付托管费		5,737.77
应付销售服务费		0.90
应付交易费用	6.4.7.7	-
应交税费		3,950.98
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	53,698.12
负债合计		86,340.95
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	781,068.08
未分配利润	6.4.7.10	46,545.00
所有者权益合计		827,613.08
负债和所有者权益总计		913,954.03

注：1、报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额 781,068.08 份，其中 A 类份额净值 1.0598 元，份额总额 777,177.53 份；C 类份额净值 1.0093 元，份额总额 3,890.55 份。

2、本基金于 2018 年 3 月 15 日成立，无上年度可比期间数据。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰紫金智盈债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 3 月 15 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 3 月 15 日(基金合同生效日) 至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		1,417,795.05
1. 利息收入		1,423,899.19
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,081,435.93
债券利息收入		316,863.43
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		25,599.83
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-168,868.57
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-168,868.57

资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-
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	162,764.43
<b>减：二、费用</b>		206,070.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	117,855.22
2. 托管费	6.4.10.2.2	29,463.82
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4.29
4. 交易费用	6.4.7.19	27.01
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		1,046.11
7. 其他费用	6.4.7.20	57,673.87
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		1,211,724.73
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,211,724.73

注：本基金于 2018 年 3 月 15 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：华泰紫金智盈债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 3 月 15 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 3 月 15 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）	205,665,931.26	-	205,665,931.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,211,724.73	1,211,724.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-204,884,863.18	-1,165,179.73	-206,050,042.91
其中：1. 基金申购款	103.92	0.06	103.98
2. 基金赎回款	-204,884,967.10	-1,165,179.79	-206,050,146.89
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)	781,068.08	46,545.00	827,613.08

注:本基金于 2018 年 3 月 15 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

华泰紫金智盈债券型证券投资基金(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”)《关于准予华泰紫金智盈债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2017]944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《华泰紫金智盈债券型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2018 年 3 月 15 日生效。本基金为契约型、开放式基金,存续期限不定,首次设立募集规模为 205665931.26 份基金份额(其中:A 类基金份额为 205658839.90 份、C 类基金份额为 7091.36 份)。本基金的基金管理人为华泰资管,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华泰紫金智盈债券型证券投资基金基金合同》和《华泰紫金智盈债券型证券投资基金招募说明书》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交易的国债、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、政府机构债券、地方政府债券、中小企业私募债、可分离交易可转债中的纯债部分、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、国债期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金的业绩比较基准为中债信用债总指数收益率。

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、自 2018 年 3 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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。本期财务报表的实际编制期间为自 2018 年 3 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 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) 同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

(4) 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的初始投资成本，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的初始投资成本，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 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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	911,010.38
定期存款	-

其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月及以上	-
其他存款	-
合计	911,010.38

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

注：本基金本报告期末未持有交易性金融资产。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

注：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

注：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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,193.98
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	-
应收债券利息	-
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	0.80
合计	1,194.78

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

注：本基金本报告期末无应付交易费用。

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 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	53,698.12
合计	53,698.12

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

#### 华泰紫金智盈债券 A

项目	本期 2018 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	205,658,839.90	205,658,839.90
本期申购	103.92	103.92
本期赎回（以“-”号填列）	-204,881,766.29	-204,881,766.29
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	777,177.53	777,177.53

#### 华泰紫金智盈债券 C

项目	本期 2018 年 3 月 15 日（基金合同生效日）至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	7,091.36	7,091.36
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-3,200.81	-3,200.81
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,890.55	3,890.55

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰紫金智盈债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-

本期利润	1,211,677.65	3.87	1,211,681.52
本期基金份额交易产生的变动数	-1,165,214.29	41.43	-1,165,172.86
其中：基金申购款	0.06	-	0.06
基金赎回款	-1,165,214.35	41.43	-1,165,172.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	46,463.36	45.30	46,508.66
华泰紫金智盈债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	47.08	-3.87	43.21
本期基金份额交易产生的变动数	-10.93	4.06	-6.87
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-10.93	4.06	-6.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36.15	0.19	36.34

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月15日（基金合同生效日）至2018 年6月30日
活期存款利息收入	19,180.22
定期存款利息收入	1,061,576.39
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	672.87
其他	6.45
合计	1,081,435.93

#### 6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期无股票投资收益。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月15日（基金合同生效日）至 2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-168,868.57
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-168,868.57

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月15日（基金合同生效日）至2018 年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	22,523,432.95
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	21,763,193.57
减：应收利息总额	929,107.95
买卖债券差价收入	-168,868.57

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：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

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月15日(基金合同生效日)至2018 年6月30日
基金赎回费收入	154,537.80
其他	8,226.63
合计	162,764.43

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月15日(基金合同生效日)至2018 年6月30日
交易所市场交易费用	27.01
银行间市场交易费用	-
合计	27.01

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年3月15日(基金合同生效日)至2018 年6月30日
审计费用	16,780.54
信息披露费	36,917.58
银行手续费	3,215.75
银行费用	360.00
开户费	400.00
合计	57,673.87

#### 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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

本基金本报告期内存在控制关系或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
华泰证券(上海)资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年3月15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	25,612,975.97	100.00

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年3月15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	81,300,000.00	100.00

#### 6.4.10.1.4 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。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期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 2018年3月15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	117,855.22
其中:支付销售机构的客户维护费	1,280.18

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 0.4%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×0.4%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年3月15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	29,463.82

注:支付基金托管人建设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。

##### 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 2018年3月15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		
	华泰紫金智盈债券 A	华泰紫金智盈债券 C	合计
华泰证券股份有限公司	0.00	1.07	1.07

合计	0.00	1.07	1.07
----	------	------	------

注:本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值的 0.3%年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。计算公式为: C 类基金份额每日基金销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.3%/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

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。

#### 6.4.10.4 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

注:报告期内本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

注:本报告期末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

#### 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	
	2018 年 3 月 15 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
中国建设银行股份有限公司	911,010.38	19,180.22

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注:本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2018 年 06 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

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。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：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

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。

##### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只债券型基金，在证券投资基金中属于中等风险的品种，其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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交易的国债、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、政府机构债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可分离交易可转债中的纯债部分、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、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。本基金不投资股票、权证、可转债（可分离交易可转债中的纯债部分除外）。

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“风险和收益高于货币市场基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”的风险收益目标。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

公司建立健全与自身发展战略相适应的全面风险管理体系。公司全面风险管理体系包括可操作的管理制度、健全的组织架构、可靠的信息技术系统、量化的风险指标体系、专业的人才队伍、有效的风险应对机制以及良好的风险管理文化。

公司风险管理组织架构包括五个主要部分：董事会及风险控制委员会，监事，公司管理层及风险管理委员会，合规风控部及各类专业风险管理部门、各其他职能部门以及业务部门。

公司董事会是风险管理的最高决策机构，承担公司全面风险管理体系的最终责任。董事会下设风险控制委员会，主要负责审议公司风险管理制度、风险偏好、风险容忍度和风险评估报告。公司监事承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和管理层在风险管理方面的履职尽责

责情况并督促整改。公司管理层对全面风险管理承担主要责任，负责制度及完善公司风险管理制度，建立健全公司全面风险管理的经营管理架构，制定风险偏好、风险容忍度并定期评估公司整体风险。公司管理层下设风险管理委员会，负责批准适合各项业务发展的风险管理政策，提升公司风险管理的有效性，研究制定重大事件、重大决策和重要业务流程的风险评估报告以及重大风险的解决方案，审议公司定期和临时风险报告，指导风险管理相关部门工作等。公司设首席风险官，负责分管领导全面风险管理工作，公司保障首席风险官能够充分行使履行职责所必要的知情权，同时保障首席风险官的独立性。公司指定合规风控部履行全面风险管理职责，包括牵头建立完善公司全面风险管理体系，牵头管理公司的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险和法律风险，监测、计量、评估、报告公司整体风险水平和风险资本运用及牵头应对和处置公司层面重大风险事件。

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。

本公司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招商银行和其他商业信誉良好的股份制银行，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，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人制定了债券信用评级管理办法，不投资于信用等级在 AA+ 级以下的债券与非金融企业债务融资工具，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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：1、本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券；

2、本基金成立于 2018 年 3 月 15 日。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：1、本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券；

2、本基金成立于 2018 年 3 月 15 日。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：1、本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单；

2、本基金成立于 2018 年 3 月 15 日。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：1、本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券；

2、本基金成立于 2018 年 3 月 15 日。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：1、本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券；

2、本基金成立于 2018 年 3 月 15 日。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：1、本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单；

2、本基金成立于 2018 年 3 月 15 日。

#### 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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券部分在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同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》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、流通受限制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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中的 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。

本基金所持有大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，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

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根据质押品的资质确定质押率水平，持续检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本基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果以及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内的流动性情况良好。

#### 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。

本基金主要投资于交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018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	911,010.38	-	-	-	911,010.38
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	1,748.87	-	-	-	1,748.87
交易性金融资产	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,194.78	1,194.78
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	912,759.25	-	-	1,194.78	913,954.03
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2.12	2.12
应付管理人报酬	-	-	-	22,951.06	22,951.06
应付托管费	-	-	-	5,737.77	5,737.77
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	0.90	0.90
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3,950.98	3,950.98
其他负债	-	-	-	53,698.12	53,698.12
负债总计	-	-	-	86,340.95	86,340.95
利率敏感度缺口	912,759.25	-	-	-85,146.17	827,613.08

注：1、表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类；

2、本基金成立于 2018 年 3 月 15 日。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：1、本基金本报告期末未持有利率敏感性资产，故市场利率的波动对本基金无影响；

2、本基金成立于 2018 年 3 月 15 日。

#### 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。本基金主要投资于定期存款和银行间同业市场交易的

固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值于 2018 年 6 月 30 日，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中无属于第一层次、第二层次和第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有公允价值归属于第三层次的金融工具。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	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	911,010.38	99.68
8	其他各项资产	2,943.65	0.32
9	合计	913,954.03	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

注：本基金本报告期末未持有股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

## 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

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 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

注：本基金本报告期末投资股票。

### 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

注：本基金本报告期末投资股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期末投资股票。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 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

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**

本基金本报告期末无股指期货投资

**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**

本基金本报告期末无国债期货投资

**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**

本基金本报告期末无国债期货投资

**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**

本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

**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**

本基金本不得投资股票。

**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	1,748.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,194.78
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	2,943.65

#### 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

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 (%)
华泰紫金智盈债券 A	198	3,925.14	0.00	0.00	777,177.53	100.00
华泰紫金智盈债券 C	17	228.86	0.00	0.00	3,890.55	100.00
合计	215	3,632.87	0.00	0.00	781,068.08	100.00

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（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	华泰紫金智盈债券 A	61,651.61	7.4849
	华泰紫金智盈债券 C	1,071.59	27.2616
	合计	62,723.20	7.5788

### 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	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	华泰紫金智盈债券 A	0
	华泰紫金智盈债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰紫金智盈债券 A	0
	华泰紫金智盈债券 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰紫金智盈债券 A	华泰紫金智盈债券 C
基金合同生效日（2018 年 3 月 15 日）基金份额总额	205,658,839.90	7,091.36
本报告期期初基金份额总额	-	-
本报告期基金总申购份额	103.92	-
减：本报告期基金总赎回份额	204,881,766.29	3,200.81
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	777,177.53	3,890.55

## § 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

本基金投资策略在本报告期内没有重大改变。

#### 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	2	-	-	-	-	

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	25,612,975.97	100.00%	81,300,000.00	100.00%	-	-

#### 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	关于新增上海挖财金融信息服务有限公司为华泰紫金智盈债券型证券投资基金代销机构并参与认购费率优惠活动的公告	基金管理人官网、上海证券报、证券日报	2018年01月31日
2	关于新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为华泰紫金智盈债券型证券投资基金代销机构并参与认购费率优惠活动的公告	基金管理人官网、上海证券报、证券日报	2018年02月22日

3	关于新增北京肯特瑞财富投资管理有限公司为华泰紫金智盈债券型证券投资基金代销机构并参与认购期费率优惠活动的公告	基金管理人官网、上海证券报、证券日报	2018 年 02 月 26 日
4	华泰证券（上海）资产管理有限公司基金高级管理人员变更公告	基金管理人官网、上海证券报、证券日报	2018 年 03 月 01 日
5	华泰证券（上海）资产管理有限公司基金高级管理人员变更公告	基金管理人官网、上海证券报、证券日报	2018 年 03 月 01 日
6	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于华泰紫金智盈债券型证券投资基金提前结束募集的公告	基金管理人官网、上海证券报、证券日报	2018 年 03 月 09 日
7	华泰紫金智盈债券型证券投资基金基金合同生效公告	基金管理人官网、上海证券报、证券日报	2018 年 03 月 16 日
8	华泰紫金智盈债券型证券投资基金日常开放申购、赎回业务的公告	基金管理人官网、上海证券报、证券日报	2018 年 03 月 21 日
9	关于公司旗下华泰紫金智盈债券型证券投资基金在直销渠道开展申购费率优惠活动的公告	基金管理人官网、上海证券报、证券日报	2018 年 03 月 21 日
10	关于公司旗下华泰紫金智盈债券型证券投资基金在本公司直销渠道及部分代销渠道开展赎回费率优惠活动的公告	基金管理人官网、上海证券报、证券日报	2018 年 03 月 21 日
11	关于北京肯特瑞财富投资管理有限公司开展华泰紫金智盈债券型证券投资基金申购费率优惠活动的公告	基金管理人官网、上海证券报、证券日报	2018 年 03 月 21 日
12	关于华泰证券股份有限公司开展华泰紫金智盈债券型证券投资基金申购费率优惠活动的公告	基金管理人官网、上海证券报、证券日报	2018 年 03 月 21 日
13	关于嘉实财富管理有限公司开展华泰紫金智盈债券型证券投资基金申购费率优惠活动的公告	基金管理人官网、上海证券报、证券日报	2018 年 03 月 21 日
14	关于上海陆金所基金销售有限公司（原上海陆金所资产管理有限公司）开展华泰紫金智盈债券型证券投资基金申购费率优惠活动的公告	基金管理人官网、上海证券报、证券日报	2018 年 03 月 21 日
15	关于上海天天基金销售有限公司开展华泰紫金智盈债券型证券投资基金申购费率优惠活动的公告	基金管理人官网、上海证券报、证券日报	2018 年 03 月 21 日
16	关于上海挖财基金销售有限公司开展华泰紫金智盈债券型证券投资基金申购费率优惠活动的公告	基金管理人官网、上海证券报、证券日报	2018 年 03 月 21 日
17	关于上海长量基金销售投资顾问有限公司开展华泰紫金智盈债券型证券投资基金申购费率优惠活动的公	基金管理人官网、上海证券报、证券日报	2018 年 03 月 21 日

	告		
18	华泰紫金智盈债券型证券投资基金暂停向个人投资者开放申购业务的公告	基金管理人官网、上海证券报、证券日报	2018 年 03 月 22 日
19	关于华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下基金在中国银河证券股份有限公司开展申购、定投费率优惠活动的公告	基金管理人官网、上海证券报、证券日报	2018 年 05 月 21 日

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2018-3-15 至 2018-6-30	100,003,500.00	-	100,003,500.00	-	0
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							

- 1、本基金单一机构投资者所持有的基金份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响；
- 2、大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；
- 3、因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动；
- 4、单一投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；
- 5、单一机构投资者赎回后，若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；
- 6、大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；
- 7、大额赎回导致基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

## 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共，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 2018 年 3 月 22 日发布的《华泰紫金智盈债券型基金暂停向个人投资者开放申购业务的公告》，本基金自 2018 年 3 月 22 日起，暂停向个人投资者开放基金申购业务。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件；
- 2、《华泰紫金智盈债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金智盈债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《华泰紫金智盈债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、报告期内披露的各项公告；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会规定的其他备查文件。

## 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人、基金托管人的办公场所

## 12.3 查阅方式

部分备查文件可通过本基金管理人公司网站查询，也可咨询本基金管理人。客服电话（4008895597）；公司网址：<https://htamc.htsc.com.cn/>

华泰证券(上海)资产管理有限公司

2018年08月24日