

华泰紫金零钱宝货币市场基金 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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 1 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	华泰紫金零钱宝货币
基金主代码	004860
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 8 月 24 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	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	75,314,630.62 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持相对流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将资产配置和精选个券相结合，在动态调整现金类资产与固定收益类资产的投资比例的基础上，精选优质个券构建投资组合，在严格控制风险的基础上，实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种，其预期风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱鸣	张燕
	联系电话	021-68984388	0755-83199084
	电子邮箱	mingzhu@htsc.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008895597	95555
传真		025-84579938	0755—83195201

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 01 月 01 日-2018 年 06 月 30 日
本期已实现收益	1,754,045.60
本期利润	1,754,045.60
本期净值收益率	1.7787%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年 06 月 30 日
期末基金资产净值	75,314,630.62
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2018 年 06 月 30 日
累计净值收益率	3.2170%

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 2017 年 8 月 24 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 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

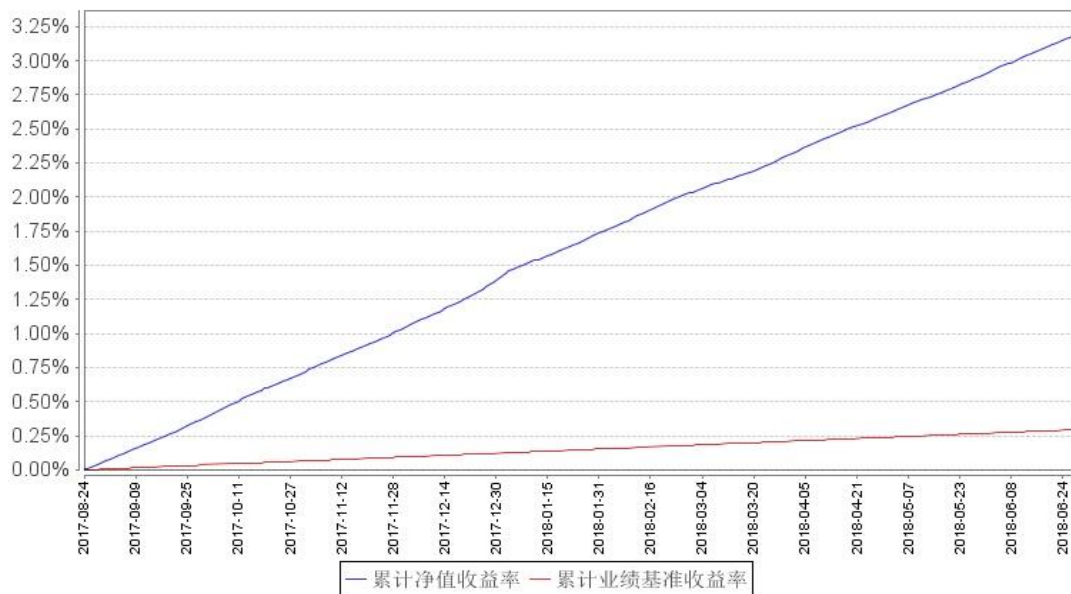
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3058%	0.0021%	0.0288%	0.0000%	0.2770%	0.0021%
过去三个月	0.8849%	0.0014%	0.0873%	0.0000%	0.7976%	0.0014%
过去六个月	1.7787%	0.0015%	0.1736%	0.0000%	1.6051%	0.0015%
自基金合同生效起至今	3.2170%	0.0017%	0.2982%	0.0000%	2.9188%	0.0017%

注:1、本基金的合同生效日为 2017 年 8 月 24 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作未满 1 年；

2、本基金基准收益率=活期存款收益率（税后）。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰紫金零钱宝货币累计净值收益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	2017 年 08 月 24 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职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《华泰紫金零钱宝货币市场基金基金合同》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。宽货币向宽信用传导路径不通畅，短端流动性泛滥，但是信用利差依旧在历史高位。

操作方面，报告期内基金以同业存单、中短期存款及逆回购为主要配置资产。跟随同业存单发行节奏，适度拉长组合的剩余期限，提升组合收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期净值收益率为 1.7787%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%。

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。伴随着社融数据回升，市场风险偏好修复，短端资金利率将逐步回升。但考虑到金融去杠杆效果显现，后续仍有降准的可能性，短端利率高点较之前将会有所下滑。

产品操作上，预判资金面市场的波动情况，努力抓住特殊时点市场流动性紧张带来的投资机会。

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

本基金份额在本年度累计分配收益 1,754,045.60 元，其中以红利再投资方式结转入 1,821,774.72 元，计入应付利润科目-67,729.12 元。

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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人一招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《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，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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，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：华泰紫金零钱宝货币市场基金

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	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		25,797,563.65	76,581,280.39
结算备付金		314,779.61	522,414.42
存出保证金		3,747.09	1,002.51
交易性金融资产		22,597,044.24	7,883,030.71
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		22,597,044.24	7,883,030.71
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		26,600,134.85	83,700,443.85
应收证券清算款		-	2,625.75
应收利息		394,139.98	625,462.52
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		75,707,409.42	169,316,260.15
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
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		300,000.00	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		17,114.67	22,932.90
应付托管费		3,422.95	4,586.60
应付销售服务费		1,711.49	2,293.33

应付交易费用		4,063.17	1,011.26
应交税费		835.87	-
应付利息		-	-
应付利润		19,138.77	89,385.48
递延所得税负债		-	-
其他负债		46,491.88	64,000.00
负债合计		392,778.80	184,209.57
所有者权益：			
实收基金		75,314,630.62	169,132,050.58
未分配利润		-	-
所有者权益合计		75,314,630.62	169,132,050.58
负债和所有者权益总计		75,707,409.42	169,316,260.15

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额 75,314,630.62 份，基金份额净值 1.0000 元。

6.2 利润表

会计主体：华泰紫金零钱宝货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		2,011,351.67
1. 利息收入		1,991,971.82
其中：存款利息收入		845,900.11
债券利息收入		595,385.13
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		550,686.58
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		19,379.85
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益		19,379.85
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		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		-
减：二、费用		257,306.07
1. 管理人报酬		124,019.76
2. 托管费		24,803.95
3. 销售服务费		12,402.06

4. 交易费用		-
5. 利息支出		21,134.08
其中：卖出回购金融资产支出		21,134.08
6. 税金及附加		-
7. 其他费用		74,946.22
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,754,045.60
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,754,045.60

注：本基金于 2017 年 8 月 24 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：华泰紫金零钱宝货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 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）	169,132,050.58	-	169,132,050.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,754,045.60	1,754,045.60
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）	-93,817,419.96	-	-93,817,419.96
其中：1. 基金申购款	497,100,393.42	-	497,100,393.42
2. 基金赎回款	-590,917,813.38	-	-590,917,813.38
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）	-	-1,754,045.60	-1,754,045.60
五、期末所有者权益（基金净值）	75,314,630.62	-	75,314,630.62

注：本基金于 2017 年 8 月 24 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：

崔春

朱前

朱鸣

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

华泰紫金零钱宝货币市场基金（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”）《关于准予华泰紫金零钱宝货币市场基金注册的批复》（证监许可[2017]907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《华泰紫金零钱宝货币市场基金基金合同》发售，基金合同于2017年8月24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265,160,626.53份基金份额。本基金的基金管理人为华泰资管，基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华泰紫金零钱宝货币市场基金基金合同》和《华泰紫金零钱宝货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在397天以内（含397天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。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。本基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

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 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

本基金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 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。

6.4.7.2 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、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(以下简称“华泰证	基金管理人的股东、基金销售机构

券”)	
-----	--

6.4.8 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。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1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	47,608,020.00	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1月1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	472,500,000.00	100.00

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期未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

注:本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	124,019.76
其中：支付销售机构的客户维护费	15,225.74

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 0.2%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×0.25%/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 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	24,803.95

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 0.09%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×0.05%/当年天数。

6.4.8.2.3 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 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费
华泰证券股份有限公司	3,383.50
华泰证券（上海）资产管理有 限公司	9,018.39
合计	12,401.89

注：合同约定支付销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日销售服务费=前一日基金资产净值×0.025% / 当年天数

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 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

基金合同生效日（2017年8月24日）持有的基金份额	32,007,200.00
期初持有的基金份额	12,732,089.49
期间申购/买入总份额	214,788.56
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	2,500,000.00
期末持有的基金份额	10,446,878.05
期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.87%

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
华泰并购基金1号集合资产管理计划	16,596,764.63	22.04	16,302,260.84	9.64
华泰并购基金2号集合资产管理计划	11,580,578.46	15.38	11,375,085.04	6.73
华泰资管佳立定向资产管理计划	1,031,997.99	1.37	1,013,685.42	0.60
华泰经纬中国人民币四期集合资产管理计划	2,450,756.79	3.25	2,646,875.46	1.56
华泰赛领领航1号集合资产管理计划	898,730.84	1.19	1,411,914.27	0.83

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 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	797,563.65	9,566.69

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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 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：本基金本报告期末无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§ 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	固定收益权益投资	22,597,044.24	29.85
	其中：债券	22,597,044.24	29.85
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	26,600,134.85	35.14
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	26,112,343.26	34.49
4	其他各项资产	397,887.07	0.53

5	合计	75,707,409.42	100.00
---	----	---------------	--------

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	1.16	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

注：本报告期内本基金不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的情况。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	39
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	53
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	7

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	36.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	21.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	41.73	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的	-	-

	浮动利率债		
5	120 天（含）—397 天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	100.00	-

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本基金本报告期内未存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

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	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	7,670,035.85	10.18
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	5,000,293.09	6.64
6	中期票据	-	-
7	同业存单	9,926,715.30	13.18
8	其他	-	-
9	合计	22,597,044.24	30.00
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	111818136	18 华夏银行 CD136	100,000	9,926,715.30	13.18
2	019571	17 国债 17	61,700	6,171,317.54	8.19
3	011800747	18 大同煤矿 SCP004	50,000	5,000,293.09	6.64
4	019522	15 国债 22	15,000	1,498,718.31	1.99

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0458%
报告期内偏离度的最低值	-0.0236%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0094%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内未存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金本报告期内未存在正偏离度达到 0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

7.9.2 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。

7.9.3 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	3,747.09
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	394,139.98
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	397,887.07

7.9.4 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 (%)
1,549	48,621.45	63,846,391.05	84.77	11,468,239.57	15.23

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
1	保险类机构	17,543,173.23	23.29
2	券商类机构	16,596,764.63	22.04
3	券商类机构	11,580,578.46	15.38
4	券商类机构	10,446,878.05	13.87
5	其他机构	3,113,028.21	4.13
6	个人	3,007,882.81	3.99
7	券商类机构	2,450,756.79	3.25
8	个人	1,225,431.83	1.63
9	券商类机构	1,031,997.99	1.37
10	个人	915,612.59	1.22

8.3 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	126,196.15	0.17

8.4 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 8 月 24 日）基金份额总额	265,160,626.53
本报告期期初基金份额总额	169,132,050.58
本报告期基金总申购份额	497,100,393.42
减：本报告期基金总赎回份额	590,917,813.38
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	75,314,630.62

注：红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源，统一计入本期总申购份额，基金转换转出作为本期赎回资金的来源，统一计入本期总赎回份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-------	------	-----------	----

	量	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	47,608,020.00	100.00%	472,500,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内未存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

§ 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		区 间					
机 构	1	2018-1-1 至 2018-6-30	45,005,228.09	500,478.67	2,500,000.00	43,005,706.76	57.10
	2	2018-2-12 至 2018-2-13、 2018-3-29 至 2018-6-13、 2018-6-25 至 2018-6-30	17,231,875.69	311,297.54	0	17,543,173.23	23.29
	3	2018-1-1 至 2018-1-2	36,215,000.00	67,254.61	36,282,254.61	0	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、本基金管理人于 2018 年 3 月 30 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旗下 2 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告”，根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》规定对本基金《基金合同》和《托管协议》进行了修改，并从 2018 年 3 月 31 日起生效，具体可见登载于本公司网站的修改后的《基金合同》、《托管协议》文本，敬请投资者阅读。

华泰证券(上海)资产管理有限公司

2018 年 08 月 24 日