

---

# 华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资 基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 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：2019 年 03 月 25 日

## 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 20 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 2 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

## 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	131, 510, 410. 03 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	<p>本基金是一只采取主动管理投资模式的股票基金。在投资策略上，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。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过定性与定量研究相结合的方法，确定投资组合中股票类资产和债券类资产的配置比例。</p> <p>本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标，确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在目标收益条件下，追求风险最小化目标，最终确定大类资产 投资权重，实现资产合理配置。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金主要采用多种量化模型进行股票的选择。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股构建投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。在实际运行过程中，将定期或不定期的进行修正，优化股票投资 组合。本基金采用的量化投资策略主要有：</p> <p>(1) 多因子选股模型：多因子选股模型由本基金管理人根据中国资本市场的实际情况开发的具有针对性和实用性的数量化选股模型。模型首先综合考虑经济因素、流动性因素、行业发展轨迹等大的市场环境，其次细致评估个股的估值情况、成长情况、动量 情况、交易行为情况等 进行多维度的筛选。模型按照多维因子，并经过数量量化 模型进行筛选，选出符合模型的个股组成一篮子投资组合，并定期更新投资组合。</p> <p>(2) 事件驱动模型：通过研究发现，有较多事件驱动策略在中国 A 股市</p>

	<p>场有效或阶段性有效。如一致预期变动策略、上市公司业绩超市场预期策略、管理层增持策略、大股东减持策略、指数成份股调整策略等。我们将在适当的时机选用合适的策略，用于捕捉阶段性的超额收益或绝对收益。</p> <p>(3) 行业轮动模型：本基金通过把握经济周期变化，依据对宏观经济、产业政策、行业景气度及市场波动、市场情绪轮动等因素的综合判断，识别出当阶段影响行业股价收益率的关键因素，判断行业是否在估值修复、触底回升等阶段，并计算各行业的绝对、相对上涨趋势强度，以实现各行业的合理和优化的配置。</p> <p>(4) 评级反转策略：评级反转策略综合利用证券分析师提供的研究报告信息、以及股票的市场交易信息进行选股。该策略倾向于选择具有以下特征的股票：在一段时期内，某个股票的多个研究报告均给出较正面的信息，即大部分的证券分析师看好该股的后市走势，然而在二级市场上，该股票的表现却滞后于行业指数的表现。当分析师已获取的信息和预测被市场进一步验证时，该类股票有望获得超额收益。</p> <p>3、债券类资产投资策略</p> <p>本基金的债券类投资品种主要有国债、企业债等中国证监会认可的，具有良好流动性的金融工具。债券类资产投资主要用于提高非股票资产的收益率，管理人将坚持价值投资的理念，严格控制风险，追求合理的回报。</p> <p>在债券投资方面，管理人将以宏观形势及利率分析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实施情况，以及国际金融市场基准利率水平及变化情况，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定量评价。</p> <p>4、中小企业私募债券投资策略</p> <p>由于中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。在进行投资时，将采取分散投资、锁定收益策略。在遴选债券时，将只投资有担保或者国有控股企业发行的中小企业私募债，以降低信用风险。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金资产支持证券的投资配置策略主要从信用风险、流动性、收益率几方面来考虑，采用自下而上的项目精选策略，以资产支持证券的优先级或次优先级为投资标的，精选违约或逾期风险可控、收益率较高的资产支持证券项目。根据不同资产支持证券的基础资产采取适度分散的地区配置策略和行业配置策略，在有效分散风险的前提下为投资人谋求较高的投资组合回报率。资产支持证券的信用风险分析采取内外结合的方法，以基金管理人的内部信用风险评估为主，并结合外部信用评级机构的分析报告，最终得出对每个资产支持证券项目的总体风险判断。另外，鉴于资产支持证券的流动性较差，本基金更倾向于久期较短的品种，即使持有到期压力也不会太大。</p> <p>6、衍生品投资策略</p> <p>本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。本基金将合理利用股指期货、国债期货、权证等衍生工具发掘可能的投资机会，稳健投资，实现基金资产的保值增值。</p>
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	王永民
	联系电话	021-68984388	010-66594896
	电子邮箱	mingzhu@htsc.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008895597	95566
传真		021-28972120	010-66594942

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	htamc.htsc.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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2月1日（基金合同生效日）-2018年12月31日
本期已实现收益	-32,383,282.64
本期利润	-37,490,905.74
加权平均基金份额本期利润	-0.2306
本期加权平均净值利润率	-25.06%
本期基金份额净值增长率	-27.09%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末
期末可供分配利润	-35,620,251.59
期末可供分配基金份额利润	-0.2709
期末基金资产净值	95,890,158.44
期末基金份额净值	0.7291

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、合同生效未满1年，无上年度可比数据。

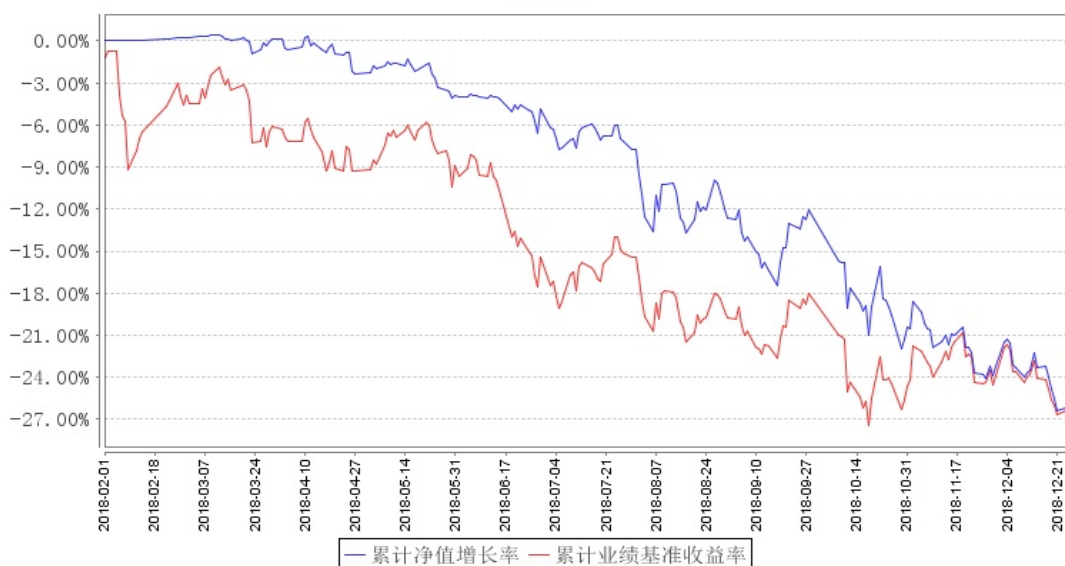
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去三个月	-17.11%	1.41%	-11.21%	1.49%	-5.90%	-0.08%
过去六个月	-23.40%	1.25%	-13.92%	1.34%	-9.48%	-0.09%
自基金合同生效起至今	-27.09%	0.97%	-27.24%	1.25%	0.15%	-0.28%

#### 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

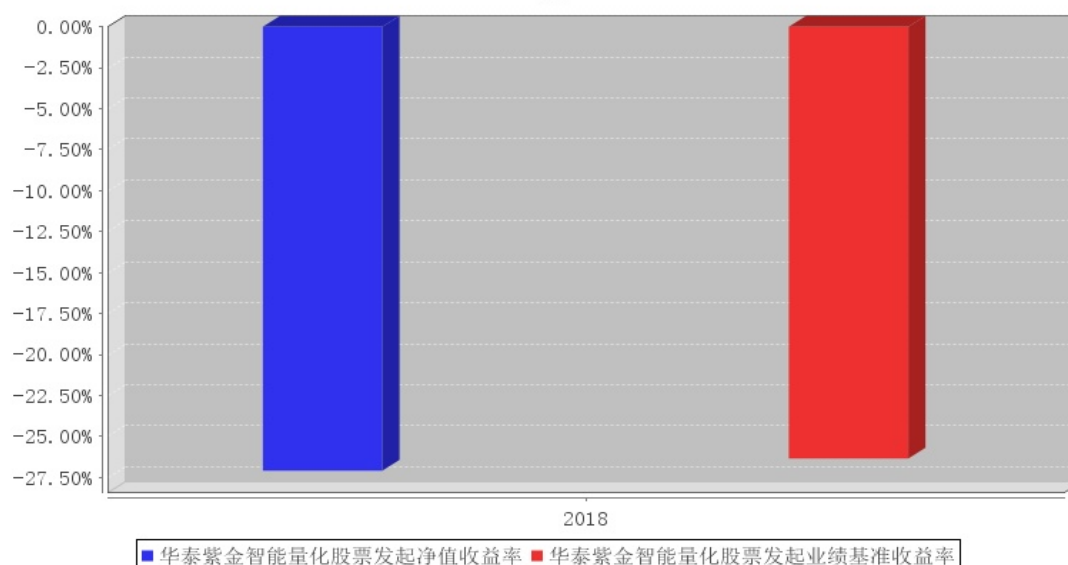
华泰紫金智能量化股票发起累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2018 年 2 月 1 日生效，截止本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰紫金智能量化股票发起基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注:1、本基金基准收益率=中证 800 指数收益率\*90%+上证国债指数收益率\*10%;

2、本基金合同生效日为 2018 年 2 月 1 日。合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算, 不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注:无

## § 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12月31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	2018-02-01	-	12 年	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	2018-03-10	-	8 年	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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、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，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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 A 股市场在年初经历了一轮快速上涨之后，受国内去杠杆、中美贸易摩擦等多个内外部因素影响，呈震荡下行走势，各主要股指跌幅显著。截至本报告期末，上证综指下跌 24.59%，深证成份指数下跌 34.42%，上证 50 指数下跌 19.83%，沪深 300 指数下跌 25.31%，中证 1000 指数下跌 36.87%，创业板指数下跌 28.65%。

本基金成立于 2 月 1 日，本报告期涵盖了基金的建仓期，在操作上，本基金利用量化模型精选个股，辅以量化风格择时策略，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

报告期内，本基金份额净值增长率为-27.09%，同期业绩比较基准收益率为-27.24%。

## 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 2019 年，国内去杠杆政策、财政政策、货币政策已经开始转向，虽然国内经济下行压力仍在，全球经济增长同步放缓，中美贸易摩擦的影响因素也暂未消除，但随着国内全面深化改革

革开放的推进，A 股市场将存在较好的投资机遇。管理人将依据量化模型，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，投资研究部、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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.9 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 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。

投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>	
银行存款	9,624,683.39
结算备付金	707,795.93
存出保证金	203,735.62
交易性金融资产	84,796,765.31
其中：股票投资	83,019,981.71
基金投资	-
债券投资	1,776,783.60
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	-
应收证券清算款	3,396,755.08
应收利息	52,421.94
应收股利	-
应收申购款	2,689.73
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	98,784,847.00
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 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	-
应付赎回款	22,406.54
应付管理人报酬	127,943.94
应付托管费	21,324.00
应付销售服务费	-
应付交易费用	2,466,061.93
应交税费	26,867.71
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	230,084.44
负债合计	2,894,688.56
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	131,510,410.03
未分配利润	-35,620,251.59
所有者权益合计	95,890,158.44
负债和所有者权益总计	98,784,847.00

注:报告截止日 2018 年 12 月 31 日, 基金份额净值 0.7291 元, 基金份额总额 131,510,410.03 份。

## 7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日
一、收入	-30,053,547.30
1. 利息收入	1,794,788.94
其中: 存款利息收入	901,680.86
债券利息收入	62,064.72
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	831,043.36
其他利息收入	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)	-27,649,584.80
其中: 股票投资收益	-28,237,215.58

基金投资收益	-
债券投资收益	1,536.90
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	586,093.88
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-5,107,623.10
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	908,871.66
减：二、费用	7,437,358.44
1. 管理人报酬	2,087,085.01
2. 托管费	347,847.55
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	4,722,134.55
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	280,291.33
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-37,490,905.74
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-37,490,905.74

### 7.3 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 12 月 31 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 12 月 31 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）	-	-37,490,905.74	-37,490,905.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以	-211,558,088.16	1,870,654.15	-209,687,434.01

“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	1,956,738.60	-99,736.65	1,857,001.95
2. 基金赎回款	-213,514,826.76	1,970,390.80	-211,544,435.96
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）	131,510,410.03	-35,620,251.59	95,890,158.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

朱前

刘玉生

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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343,068,498.19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(更新)》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。

## 7.4.2 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。

## 7.4.3 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及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况、自 2018 年 2 月 1 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 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 2 月 1 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 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。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的,把金融资产和金融负债分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为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资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。

在初始确认时,金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于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,相关交易费用直接计入当期损益;对于其他类别的金融资产或金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后,金融资产和金融负债的后续计量如下:



- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金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；

- 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值

- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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，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，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 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。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益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确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计

提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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；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；每一基金份额享有同等分配权；基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，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《中国证券监督管理委员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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、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,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票,根据中基协发[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》,在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《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》(以下简称“估值处理标准”),在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《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《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:

- (a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。
- (b) 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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

- (c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。
- (e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
- (f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。
- (g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 7.4.7 关联方关系

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“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，并以一般交易价格为定价基础。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 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 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
华泰证券	3,621,414,648.81	100.00

#### 7.4.8.1.2 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 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
华泰证券	15,711,046.10	100.00

#### 7.4.8.1.3 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 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
华泰证券	3,835,367,000.00	100.00

#### 7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

#### 7.4.8.1.5 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12月31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	2,648,335.93	100.00	2,466,061.93	100.00

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用华泰证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从华泰证券获得证券研究综合服务。

## 7.4.8.2 关联方报酬

### 7.4.8.2.1 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 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,087,085.01
其中：支付销售机构的客户维护费	952,539.99

注：支付基金管理人华泰证券(上海)资产管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值

1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。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

### 7.4.8.2.2 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 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	347,847.55

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

### 7.4.8.3 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

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 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 12 月 31 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
报告期初持有的基金份额	10,000,900.09
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	10,000,900.09
报告期末持有的基金份额占基金总份额比	7.6000%

例	
---	--

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。

#### 7.4.8.4.2 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:本基金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的情况。

#### 7.4.8.5 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12月 31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	9,624,683.39	268,570.09

注:本基金通过“中国银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金,于2018年12月31日的相关余额为人民币707,795.93元。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2018年2月1日(基金合同生效日)至2018年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 张)	总金额
-	-	-	-	-	-

注:本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内,本基金买入托管行中国银行股份有限公司发行的股票中国银行(601988),相关交易在公开市场以公平价格进行。

#### 7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:根据《证券发行与承销管理办法》,证券投资基金参与网下配售,可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

于2018年12月31日,本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。



#### 7.4.9.2 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
600030	中信证券	2018年12月25日	重大事项停牌	16.01	2019-1-10	16.80	115,300	1,953,210.00	1,845,953.00	-

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注:于 2018 年 12 月 31 日, 本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的债券。

##### 7.4.9.3.2 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。

#### 7.4.10 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 12 月 31 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属于第一层次的余额为 81,174,028.71 元, 属于第二层次的余额为 3,622,736.60 元, 无属于第三层次的余额。

(ii) 对于本基金投资的证券交易所上市的证券, 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时, 本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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, 确定相关证券公允价值的层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2018 年 12 月 31 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 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

(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。。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	83,019,981.71	84.04
	其中：股票	83,019,981.71	84.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,776,783.60	1.80
	其中：债券	1,776,783.60	1.80
	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	10,332,479.32	10.46
8	其他各项资产	3,655,602.37	3.70
9	合计	98,784,847.00	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,356,414.00	1.41
B	采矿业	3,656,474.00	3.81
C	制造业	33,893,848.20	35.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,322,536.00	3.46
E	建筑业	3,063,509.00	3.19
F	批发和零售业	822,906.00	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	3,766,313.00	3.93
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,252,270.46	3.39
J	金融业	24,946,149.05	26.02
K	房地产业	2,948,162.00	3.07
L	租赁和商务服务业	314,400.00	0.33
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	1,677,000.00	1.75
S	综合	-	-
	合计	83,019,981.71	86.58

### 8.2.2 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投资类股票。

### 8.3 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	000651	格力电器	69,200	2,469,748.00	2.58
2	601398	工商银行	461,000	2,438,690.00	2.54
3	600436	片仔癀	27,300	2,365,545.00	2.47
4	601318	中国平安	40,600	2,277,660.00	2.38
5	600036	招商银行	89,900	2,265,480.00	2.36
6	601939	建设银行	338,100	2,153,697.00	2.25
7	601006	大秦铁路	261,500	2,152,145.00	2.24
8	601166	兴业银行	142,000	2,121,480.00	2.21
9	601601	中国太保	70,000	1,990,100.00	2.08
10	600030	中信证券	115,300	1,845,953.00	1.93

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 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	24,733,921.58	25.79
2	600036	招商银行	23,075,089.41	24.06
3	601398	工商银行	20,671,460.00	21.56
4	000001	平安银行	19,985,214.17	20.84
5	601088	中国神华	18,445,543.53	19.24
6	000938	紫光股份	17,954,643.30	18.72
7	000568	泸州老窖	17,675,605.46	18.43

8	300070	碧水源	17,178,676.00	17.91
9	600588	用友网络	16,984,201.91	17.71
10	600019	宝钢股份	16,871,305.00	17.59
11	601857	中国石油	16,154,796.28	16.85
12	601628	中国人寿	15,444,995.40	16.11
13	300036	超图软件	14,944,914.80	15.59
14	300188	美亚柏科	14,304,872.77	14.92
15	600900	长江电力	13,961,072.00	14.56
16	601601	中国太保	13,631,737.26	14.22
17	601699	潞安环能	13,564,624.90	14.15
18	601318	中国平安	13,408,844.00	13.98
19	600498	烽火通信	12,732,382.00	13.28
20	600271	航天信息	12,469,017.00	13.00
21	601211	国泰君安	11,959,183.00	12.47
22	600521	华海药业	11,492,275.58	11.98
23	001979	招商蛇口	11,359,462.98	11.85
24	300124	汇川技术	11,294,388.00	11.78
25	000651	格力电器	11,263,404.00	11.75
26	600872	中炬高新	11,059,479.00	11.53
27	601166	兴业银行	10,906,074.38	11.37
28	600837	海通证券	10,794,304.00	11.26
29	600030	中信证券	10,754,841.00	11.22
30	300003	乐普医疗	9,487,990.20	9.89
31	300115	长盈精密	9,357,671.68	9.76
32	600348	阳泉煤业	9,308,304.59	9.71
33	600362	江西铜业	9,206,374.99	9.60
34	603589	口子窖	9,158,220.00	9.55
35	002236	大华股份	9,134,665.80	9.53
36	600282	南钢股份	9,048,883.00	9.44
37	600809	山西汾酒	9,031,129.78	9.42
38	600188	兖州煤业	8,973,946.27	9.36
39	601377	兴业证券	8,887,466.00	9.27
40	601336	新华保险	8,791,908.00	9.17
41	300401	花园生物	8,761,970.00	9.14
42	002142	宁波银行	8,581,227.72	8.95
43	600383	金地集团	8,522,486.98	8.89
44	000898	鞍钢股份	8,385,433.36	8.74
45	600782	新钢股份	8,273,566.46	8.63
46	000858	五粮液	8,260,066.12	8.61
47	002110	三钢闽光	8,228,267.00	8.58
48	000799	酒鬼酒	8,196,400.00	8.55
49	300348	长亮科技	8,096,298.00	8.44

50	002415	海康威视	8,078,892.06	8.43
51	600519	贵州茅台	8,019,829.00	8.36
52	600867	通化东宝	7,883,620.84	8.22
53	600507	方大特钢	7,875,015.00	8.21
54	000963	华东医药	7,871,816.90	8.21
55	300088	长信科技	7,766,329.00	8.10
56	300377	赢时胜	7,765,118.50	8.10
57	601888	中国国旅	7,732,608.00	8.06
58	000807	云铝股份	7,579,206.00	7.90
59	002013	中航机电	7,558,500.41	7.88
60	600298	安琪酵母	7,511,709.90	7.83
61	600585	海螺水泥	7,437,162.00	7.76
62	002233	塔牌集团	7,407,196.00	7.72
63	000002	万科A	7,333,294.00	7.65
64	600703	三安光电	7,131,375.00	7.44
65	300373	扬杰科技	7,118,798.00	7.42
66	000768	中航飞机	7,058,274.00	7.36
67	600436	片仔癀	6,950,881.00	7.25
68	601186	中国铁建	6,947,167.00	7.24
69	600690	青岛海尔	6,896,304.00	7.19
70	000717	韶钢松山	6,852,825.00	7.15
71	600216	浙江医药	6,723,035.20	7.01
72	601766	中国中车	6,671,666.00	6.96
73	601390	中国中铁	6,626,881.80	6.91
74	600000	浦发银行	6,615,226.45	6.90
75	300017	网宿科技	6,604,325.00	6.89
76	600276	恒瑞医药	6,591,281.31	6.87
77	300166	东方国信	6,581,899.80	6.86
78	600566	济川药业	6,563,655.00	6.84
79	601009	南京银行	6,560,222.00	6.84
80	300253	卫宁健康	6,424,784.00	6.70
81	002001	新和成	6,402,197.77	6.68
82	002304	洋河股份	6,387,970.50	6.66
83	002475	立讯精密	6,373,348.79	6.65
84	600340	华夏幸福	6,371,075.00	6.64
85	600596	新安股份	6,362,000.00	6.63
86	601788	光大证券	6,336,334.85	6.61
87	600016	民生银行	6,335,835.00	6.61
88	601668	中国建筑	6,293,059.40	6.56
89	002007	华兰生物	6,267,703.00	6.54
90	601169	北京银行	6,242,245.00	6.51
91	000977	浪潮信息	6,201,680.00	6.47

92	002714	牧原股份	6,162,469.76	6.43
93	002273	水晶光电	6,126,936.83	6.39
94	600056	中国医药	6,123,040.86	6.39
95	000789	万年青	6,093,489.49	6.35
96	000418	小天鹅A	6,088,478.22	6.35
97	600048	保利地产	6,046,087.00	6.31
98	603993	洛阳钼业	5,990,465.00	6.25
99	603986	兆易创新	5,956,423.32	6.21
100	600028	中国石化	5,822,421.00	6.07
101	600887	伊利股份	5,814,894.66	6.06
102	600487	亨通光电	5,752,145.96	6.00
103	000581	威孚高科	5,658,567.00	5.90
104	000878	云南铜业	5,648,106.99	5.89
105	600741	华域汽车	5,623,537.78	5.86
106	002460	赣锋锂业	5,572,378.00	5.81
107	600801	华新水泥	5,503,147.00	5.74
108	600376	首开股份	5,483,773.30	5.72
109	600503	华丽家族	5,482,415.73	5.72
110	600266	北京城建	5,457,783.00	5.69
111	600839	四川长虹	5,417,641.30	5.65
112	000039	中集集团	5,368,404.42	5.60
113	002128	露天煤业	5,259,491.92	5.48
114	300353	东土科技	5,244,619.00	5.47
115	600771	广誉远	5,165,389.60	5.39
116	002080	中材科技	5,162,780.00	5.38
117	300014	亿纬锂能	5,061,469.58	5.28
118	600460	士兰微	5,058,459.00	5.28
119	601111	中国国航	5,055,155.00	5.27
120	002456	欧菲科技	4,945,542.50	5.16
121	600066	宇通客车	4,939,020.00	5.15
122	300383	光环新网	4,920,314.20	5.13
123	002405	四维图新	4,845,934.00	5.05
124	600667	太极实业	4,831,084.00	5.04
125	603658	安图生物	4,813,663.00	5.02
126	600516	方大炭素	4,784,192.00	4.99
127	601933	永辉超市	4,743,477.00	4.95
128	002008	大族激光	4,740,446.00	4.94
129	600115	东方航空	4,737,862.02	4.94
130	002572	索菲亚	4,682,858.68	4.88
131	600426	华鲁恒升	4,679,125.32	4.88
132	601012	隆基股份	4,611,205.14	4.81
133	600409	三友化工	4,574,379.70	4.77

134	601225	陕西煤业	4,562,153.02	4.76
135	300347	泰格医药	4,559,121.00	4.75
136	600258	首旅酒店	4,548,631.20	4.74
137	601006	大秦铁路	4,547,523.00	4.74
138	300677	英科医疗	4,541,015.00	4.74
139	002635	安洁科技	4,461,789.50	4.65
140	600373	中文传媒	4,461,043.14	4.65
141	002310	东方园林	4,425,722.50	4.62
142	600489	中金黄金	4,423,043.00	4.61
143	002573	清新环境	4,420,070.00	4.61
144	601168	西部矿业	4,417,187.40	4.61
145	601288	农业银行	4,372,142.00	4.56
146	601328	交通银行	4,354,613.00	4.54
147	002371	北方华创	4,352,246.22	4.54
148	600197	伊力特	4,315,215.00	4.50
149	600908	无锡银行	4,297,798.00	4.48
150	600522	中天科技	4,285,879.00	4.47
151	300212	易华录	4,276,855.80	4.46
152	002127	南极电商	4,253,394.56	4.44
153	600183	生益科技	4,239,874.00	4.42
154	000823	超声电子	4,216,906.34	4.40
155	600260	凯乐科技	4,212,382.00	4.39
156	300073	当升科技	4,206,517.00	4.39
157	600967	内蒙一机	4,193,309.97	4.37
158	002497	雅化集团	4,192,373.00	4.37
159	300122	智飞生物	4,182,363.00	4.36
160	002340	格林美	4,161,887.10	4.34
161	600352	浙江龙盛	4,151,039.00	4.33
162	600879	航天电子	4,140,736.00	4.32
163	600970	中材国际	4,121,550.89	4.30
164	600291	西水股份	4,121,129.00	4.30
165	601636	旗滨集团	4,109,880.00	4.29
166	002294	信立泰	4,103,407.32	4.28
167	600093	易见股份	4,097,853.00	4.27
168	300296	利亚德	4,029,354.12	4.20
169	000681	视觉中国	4,011,528.00	4.18
170	002223	鱼跃医疗	3,950,975.50	4.12
171	000732	泰禾集团	3,898,772.00	4.07
172	600699	均胜电子	3,898,128.16	4.07
173	600068	葛洲坝	3,838,310.00	4.00
174	600256	广汇能源	3,829,154.00	3.99
175	600803	新奥股份	3,825,530.97	3.99

176	000333	美的集团	3,799,931.00	3.96
177	603799	华友钴业	3,742,329.00	3.90
178	601117	中国化学	3,733,297.00	3.89
179	300136	信维通信	3,725,943.00	3.89
180	300271	华宇软件	3,705,558.04	3.86
181	601238	广汽集团	3,689,811.00	3.85
182	300144	宋城演艺	3,664,945.18	3.82
183	601155	新城控股	3,656,651.84	3.81
184	600231	凌钢股份	3,637,539.00	3.79
185	300047	天源迪科	3,600,474.00	3.75
186	002709	天赐材料	3,572,513.00	3.73
187	601998	中信银行	3,561,166.26	3.71
188	000528	柳工	3,558,508.00	3.71
189	600597	光明乳业	3,555,834.00	3.71
190	600050	中国联通	3,554,354.00	3.71
191	600060	海信电器	3,530,827.00	3.68
192	002500	山西证券	3,530,542.00	3.68
193	601233	桐昆股份	3,529,800.84	3.68
194	600160	巨化股份	3,528,474.00	3.68
195	601997	贵阳银行	3,474,120.93	3.62
196	600025	华能水电	3,465,000.00	3.61
197	300072	三聚环保	3,437,756.00	3.59
198	300450	先导智能	3,417,996.18	3.56
199	300463	迈克生物	3,390,874.00	3.54
200	300058	蓝色光标	3,367,138.00	3.51
201	601003	柳钢股份	3,354,189.35	3.50
202	601600	中国铝业	3,346,170.00	3.49
203	002044	美年健康	3,341,125.40	3.48
204	000983	西山煤电	3,322,037.12	3.46
205	600482	中国动力	3,308,761.81	3.45
206	002396	星网锐捷	3,302,589.80	3.44
207	000425	徐工机械	3,302,492.00	3.44
208	600015	华夏银行	3,299,993.00	3.44
209	600893	航发动力	3,275,328.00	3.42
210	002508	老板电器	3,264,687.77	3.40
211	300558	贝达药业	3,262,004.00	3.40
212	000338	潍柴动力	3,250,180.00	3.39
213	300009	安科生物	3,230,373.72	3.37
214	601985	中国核电	3,204,834.00	3.34
215	300015	爱尔眼科	3,193,663.06	3.33
216	600009	上海机场	3,138,506.00	3.27
217	002422	科伦药业	3,120,374.00	3.25



218	000960	锡业股份	3,103,989.00	3.24
219	002626	金达威	3,071,166.62	3.20
220	002271	东方雨虹	3,070,024.00	3.20
221	002466	天齐锂业	3,062,227.11	3.19
222	600567	山鹰纸业	2,949,871.00	3.08
223	002589	瑞康医药	2,944,592.94	3.07
224	600705	中航资本	2,938,839.00	3.06
225	002146	荣盛发展	2,932,333.00	3.06
226	600886	国投电力	2,925,260.00	3.05
227	002465	海格通信	2,906,208.00	3.03
228	600011	华能国际	2,886,393.00	3.01
229	603816	顾家家居	2,868,177.00	2.99
230	603369	今世缘	2,792,988.00	2.91
231	600549	厦门钨业	2,770,685.00	2.89
232	600110	诺德股份	2,770,336.60	2.89
233	600584	长电科技	2,764,512.00	2.88
234	002185	华天科技	2,753,997.38	2.87
235	600547	山东黄金	2,735,306.47	2.85
236	601229	上海银行	2,732,610.60	2.85
237	002241	歌尔股份	2,728,079.75	2.85
238	000830	鲁西化工	2,711,377.00	2.83
239	600763	通策医疗	2,708,942.00	2.83
240	600525	长园集团	2,704,611.00	2.82
241	002195	二三四五	2,685,605.60	2.80
242	600518	康美药业	2,675,377.00	2.79
243	600760	中航沈飞	2,653,673.00	2.77
244	600702	舍得酒业	2,579,348.00	2.69
245	600926	杭州银行	2,575,422.00	2.69
246	600728	佳都科技	2,570,749.00	2.68
247	601899	紫金矿业	2,555,550.00	2.67
248	600309	万华化学	2,531,990.00	2.64
249	601717	郑煤机	2,523,335.00	2.63
250	600330	天通股份	2,505,298.00	2.61
251	000728	国元证券	2,500,960.00	2.61
252	002507	涪陵榨菜	2,489,306.00	2.60
253	600079	人福医药	2,482,079.10	2.59
254	002279	久其软件	2,465,282.00	2.57
255	600029	南方航空	2,450,716.65	2.56
256	300349	金卡智能	2,450,707.00	2.56
257	002179	中航光电	2,447,085.00	2.55
258	300197	铁汉生态	2,446,000.00	2.55
259	000157	中联重科	2,439,877.34	2.54

260	600810	神马股份	2,439,118.13	2.54
261	600845	宝信软件	2,425,682.00	2.53
262	603225	新凤鸣	2,412,176.80	2.52
263	002640	跨境通	2,362,788.00	2.46
264	600660	福耀玻璃	2,349,067.00	2.45
265	000703	恒逸石化	2,340,046.90	2.44
266	002244	滨江集团	2,335,387.50	2.44
267	000069	华侨城 A	2,325,718.00	2.43
268	000050	深天马 A	2,315,014.12	2.41
269	000060	中金岭南	2,314,814.00	2.41
270	002376	新北洋	2,309,816.00	2.41
271	600486	扬农化工	2,299,507.00	2.40
272	300355	蒙草生态	2,287,827.12	2.39
273	000776	广发证券	2,278,033.00	2.38
274	000988	华工科技	2,268,911.00	2.37
275	000886	海南高速	2,266,121.00	2.36
276	300418	昆仑万维	2,259,324.00	2.36
277	300324	旋极信息	2,254,127.00	2.35
278	300618	寒锐钴业	2,249,694.40	2.35
279	002383	合众思壮	2,241,160.00	2.34
280	600104	上汽集团	2,222,821.00	2.32
281	002092	中泰化学	2,198,878.00	2.29
282	000423	东阿阿胶	2,159,819.64	2.25
283	600392	盛和资源	2,157,448.00	2.25
284	300367	东方网力	2,155,955.80	2.25
285	600581	八一钢铁	2,151,624.00	2.24
286	601877	正泰电器	2,141,411.00	2.23
287	002493	荣盛石化	2,125,736.00	2.22
288	002016	世荣兆业	2,116,416.00	2.21
289	600208	新湖中宝	2,115,773.00	2.21
290	002648	卫星石化	2,110,780.00	2.20
291	600380	健康元	2,107,520.00	2.20
292	000021	深科技	2,106,432.00	2.20
293	600563	法拉电子	2,100,919.04	2.19
294	300327	中颖电子	2,078,814.00	2.17
295	600628	新世界	2,050,364.00	2.14
296	600325	华发股份	2,045,075.99	2.13
297	000933	神火股份	2,043,109.00	2.13
298	002373	千方科技	2,039,421.76	2.13
299	600153	建发股份	1,997,579.00	2.08
300	300288	朗玛信息	1,996,811.00	2.08
301	000877	天山股份	1,980,314.13	2.07

302	002176	江特电机	1,979,388.00	2.06
303	000970	中科三环	1,976,271.00	2.06
304	002727	一心堂	1,958,374.00	2.04
305	002463	沪电股份	1,940,000.00	2.02
306	002285	世联行	1,934,106.28	2.02
307	002859	洁美科技	1,919,806.00	2.00

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 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	22,166,856.60	23.12
2	600036	招商银行	20,450,620.00	21.33
3	000001	平安银行	18,623,022.50	19.42
4	601398	工商银行	18,055,814.00	18.83
5	601088	中国神华	17,755,437.56	18.52
6	000568	泸州老窖	17,738,744.73	18.50
7	000938	紫光股份	17,400,524.81	18.15
8	300070	碧水源	16,637,220.49	17.35
9	600588	用友网络	15,974,532.00	16.66
10	601857	中国石油	15,614,254.44	16.28
11	600019	宝钢股份	15,412,226.70	16.07
12	300036	超图软件	14,820,061.92	15.46
13	300188	美亚柏科	14,306,565.04	14.92
14	601628	中国人寿	13,482,388.16	14.06
15	601699	潞安环能	13,153,163.32	13.72
16	600900	长江电力	12,921,385.84	13.48
17	600271	航天信息	11,641,736.75	12.14
18	600521	华海药业	11,329,415.95	11.81
19	001979	招商蛇口	11,194,745.50	11.67
20	600498	烽火通信	11,068,010.62	11.54
21	300124	汇川技术	11,066,456.38	11.54
22	601601	中国太保	10,968,280.91	11.44
23	600872	中炬高新	10,873,892.60	11.34
24	601318	中国平安	10,805,208.00	11.27
25	601211	国泰君安	10,454,411.00	10.90
26	600837	海通证券	9,391,574.98	9.79
27	300003	乐普医疗	9,322,550.00	9.72
28	600362	江西铜业	9,231,594.68	9.63
29	600348	阳泉煤业	9,217,434.00	9.61
30	002236	大华股份	9,071,885.16	9.46
31	601377	兴业证券	8,966,362.60	9.35

32	600282	南钢股份	8,846,717.20	9.23
33	601336	新华保险	8,825,771.00	9.20
34	603589	口子窖	8,788,569.83	9.17
35	601166	兴业银行	8,772,014.66	9.15
36	300115	长盈精密	8,759,291.77	9.13
37	300401	花园生物	8,655,579.67	9.03
38	002142	宁波银行	8,608,370.22	8.98
39	600030	中信证券	8,586,634.68	8.95
40	000651	格力电器	8,391,642.00	8.75
41	000898	鞍钢股份	8,364,863.60	8.72
42	300348	长亮科技	8,257,992.00	8.61
43	600782	新钢股份	7,970,811.97	8.31
44	601888	中国国旅	7,923,296.82	8.26
45	000799	酒鬼酒	7,922,498.00	8.26
46	600188	兖州煤业	7,879,927.03	8.22
47	600383	金地集团	7,848,814.91	8.19
48	002110	三钢闽光	7,758,643.39	8.09
49	600507	方大特钢	7,742,649.00	8.07
50	002415	海康威视	7,713,189.66	8.04
51	300088	长信科技	7,676,645.00	8.01
52	002233	塔牌集团	7,654,632.00	7.98
53	300377	赢时胜	7,611,296.05	7.94
54	000807	云铝股份	7,584,739.00	7.91
55	600298	安琪酵母	7,530,770.56	7.85
56	000002	万科A	7,315,964.00	7.63
57	600809	山西汾酒	7,283,349.89	7.60
58	600867	通化东宝	7,152,487.48	7.46
59	000768	中航飞机	7,118,701.01	7.42
60	600585	海螺水泥	6,814,565.57	7.11
61	002013	中航机电	6,810,709.27	7.10
62	600690	青岛海尔	6,784,784.26	7.08
63	000717	韶钢松山	6,706,987.00	6.99
64	002007	华兰生物	6,703,650.17	6.99
65	601766	中国中车	6,655,966.00	6.94
66	300017	网宿科技	6,572,865.15	6.85
67	600276	恒瑞医药	6,412,204.92	6.69
68	600216	浙江医药	6,410,131.58	6.68
69	600016	民生银行	6,367,355.00	6.64
70	600340	华夏幸福	6,348,663.00	6.62
71	000963	华东医药	6,332,252.65	6.60
72	600596	新安股份	6,274,140.91	6.54
73	002304	洋河股份	6,251,517.59	6.52

74	600566	济川药业	6,244,944.00	6.51
75	601169	北京银行	6,214,964.00	6.48
76	300166	东方国信	6,211,102.40	6.48
77	000858	五粮液	6,204,267.05	6.47
78	300253	卫宁健康	6,202,101.18	6.47
79	000789	万年青	6,192,488.85	6.46
80	600000	浦发银行	6,123,202.00	6.39
81	000418	小天鹅A	6,078,295.79	6.34
82	300373	扬杰科技	6,049,745.51	6.31
83	002273	水晶光电	6,046,718.32	6.31
84	002475	立讯精密	6,043,405.25	6.30
85	603993	洛阳钼业	5,899,050.00	6.15
86	600487	亨通光电	5,864,976.98	6.12
87	600519	贵州茅台	5,792,349.00	6.04
88	600056	中国医药	5,773,602.00	6.02
89	603986	兆易创新	5,752,209.00	6.00
90	600703	三安光电	5,727,065.00	5.97
91	000977	浪潮信息	5,670,916.00	5.91
92	600801	华新水泥	5,669,141.00	5.91
93	000878	云南铜业	5,639,687.90	5.88
94	000581	威孚高科	5,629,283.32	5.87
95	601186	中国铁建	5,622,640.88	5.86
96	601009	南京银行	5,562,694.00	5.80
97	601390	中国中铁	5,518,602.80	5.76
98	600503	华丽家族	5,495,227.68	5.73
99	600376	首开股份	5,485,845.00	5.72
100	601668	中国建筑	5,459,680.00	5.69
101	000039	中集集团	5,388,357.78	5.62
102	600266	北京城建	5,368,035.00	5.60
103	002714	牧原股份	5,364,056.41	5.59
104	002460	赣锋锂业	5,286,269.00	5.51
105	002128	露天煤业	5,282,874.40	5.51
106	600839	四川长虹	5,280,750.15	5.51
107	002001	新和成	5,225,315.06	5.45
108	002456	欧菲科技	5,029,682.88	5.25
109	300353	东土科技	4,993,920.00	5.21
110	300014	亿纬锂能	4,979,222.06	5.19
111	601111	中国国航	4,950,846.72	5.16
112	600771	广誉远	4,947,967.00	5.16
113	002080	中材科技	4,945,764.00	5.16
114	600460	士兰微	4,922,597.56	5.13
115	002405	四维图新	4,803,399.00	5.01

116	600066	宇通客车	4,777,947.00	4.98
117	600028	中国石化	4,749,863.00	4.95
118	600667	太极实业	4,744,850.83	4.95
119	600516	方大炭素	4,737,825.00	4.94
120	601933	永辉超市	4,736,668.00	4.94
121	603658	安图生物	4,707,065.05	4.91
122	600115	东方航空	4,668,230.00	4.87
123	600409	三友化工	4,660,362.00	4.86
124	600426	华鲁恒升	4,648,217.00	4.85
125	600741	华域汽车	4,635,909.87	4.83
126	601788	光大证券	4,628,924.89	4.83
127	300383	光环新网	4,620,010.00	4.82
128	600436	片仔癀	4,610,189.00	4.81
129	002008	大族激光	4,599,516.00	4.80
130	002572	索菲亚	4,573,906.52	4.77
131	600489	中金黄金	4,561,653.44	4.76
132	601225	陕西煤业	4,547,853.28	4.74
133	300677	英科医疗	4,519,391.00	4.71
134	300347	泰格医药	4,416,623.92	4.61
135	002371	北方华创	4,383,740.35	4.57
136	601168	西部矿业	4,371,147.44	4.56
137	002573	清新环境	4,354,769.00	4.54
138	600887	伊利股份	4,346,366.00	4.53
139	600258	首旅酒店	4,338,623.30	4.52
140	601328	交通银行	4,336,128.00	4.52
141	600373	中文传媒	4,322,212.56	4.51
142	002310	东方园林	4,286,776.00	4.47
143	600522	中天科技	4,282,712.28	4.47
144	601012	隆基股份	4,282,259.11	4.47
145	600908	无锡银行	4,231,490.00	4.41
146	300212	易华录	4,204,816.40	4.39
147	002497	雅化集团	4,200,046.00	4.38
148	601288	农业银行	4,198,055.00	4.38
149	600352	浙江龙盛	4,179,339.00	4.36
150	600093	易见股份	4,173,830.67	4.35
151	002127	南极电商	4,164,650.50	4.34
152	600048	保利地产	4,161,310.00	4.34
153	002340	格林美	4,155,453.91	4.33
154	300073	当升科技	4,140,726.20	4.32
155	600879	航天电子	4,116,024.97	4.29
156	000823	超声电子	4,111,457.06	4.29
157	600970	中材国际	4,100,409.94	4.28

158	600291	西水股份	4,068,869.00	4.24
159	000681	视觉中国	3,997,575.00	4.17
160	300122	智飞生物	3,988,145.00	4.16
161	600260	凯乐科技	3,943,270.00	4.11
162	000732	泰禾集团	3,937,589.00	4.11
163	600699	均胜电子	3,924,024.36	4.09
164	002294	信立泰	3,904,047.72	4.07
165	601636	旗滨集团	3,901,777.00	4.07
166	600256	广汇能源	3,876,116.00	4.04
167	300296	利亚德	3,853,576.50	4.02
168	600197	伊力特	3,851,719.00	4.02
169	002223	鱼跃医疗	3,846,517.00	4.01
170	600803	新奥股份	3,842,727.54	4.01
171	600183	生益科技	3,780,854.07	3.94
172	002635	安洁科技	3,720,839.00	3.88
173	601238	广汽集团	3,710,842.00	3.87
174	300271	华宇软件	3,710,743.00	3.87
175	600231	凌钢股份	3,624,385.00	3.78
176	601117	中国化学	3,604,770.00	3.76
177	600060	海信电器	3,600,370.00	3.75
178	601233	桐昆股份	3,585,401.58	3.74
179	600160	巨化股份	3,570,745.00	3.72
180	002709	天赐材料	3,565,361.00	3.72
181	600967	内蒙一机	3,550,020.00	3.70
182	300047	天源迪科	3,548,210.00	3.70
183	300072	三聚环保	3,545,769.20	3.70
184	600068	葛洲坝	3,529,114.00	3.68
185	002500	山西证券	3,509,468.92	3.66
186	600025	华能水电	3,475,000.00	3.62
187	601997	贵阳银行	3,471,016.62	3.62
188	600597	光明乳业	3,430,987.00	3.58
189	601998	中信银行	3,422,192.00	3.57
190	000983	西山煤电	3,388,384.48	3.53
191	300450	先导智能	3,366,619.80	3.51
192	000425	徐工机械	3,338,188.00	3.48
193	300136	信维通信	3,332,580.00	3.48
194	601600	中国铝业	3,322,785.00	3.47
195	300463	迈克生物	3,302,477.28	3.44
196	600015	华夏银行	3,298,762.60	3.44
197	002396	星网锐捷	3,270,984.79	3.41
198	000338	潍柴动力	3,240,133.00	3.38
199	300015	爱尔眼科	3,235,551.54	3.37

200	300558	贝达药业	3,226,225.00	3.36
201	601985	中国核电	3,213,812.00	3.35
202	600482	中国动力	3,177,232.10	3.31
203	300058	蓝色光标	3,151,777.37	3.29
204	000960	锡业股份	3,151,092.95	3.29
205	601155	新城控股	3,132,426.00	3.27
206	002626	金达威	3,094,844.00	3.23
207	002508	老板电器	3,090,264.30	3.22
208	002044	美年健康	3,001,692.80	3.13
209	300009	安科生物	2,993,898.56	3.12
210	002271	东方雨虹	2,970,205.00	3.10
211	601003	柳钢股份	2,966,236.00	3.09
212	002422	科伦药业	2,964,352.60	3.09
213	600886	国投电力	2,944,019.00	3.07
214	600567	山鹰纸业	2,923,560.00	3.05
215	002465	海格通信	2,919,581.00	3.04
216	002589	瑞康医药	2,908,110.70	3.03
217	603816	顾家家居	2,902,615.76	3.03
218	600705	中航资本	2,896,001.80	3.02
219	002146	荣盛发展	2,886,733.00	3.01
220	600763	通策医疗	2,842,400.00	2.96
221	300144	宋城演艺	2,826,444.00	2.95
222	600584	长电科技	2,769,723.40	2.89
223	603799	华友钴业	2,745,325.92	2.86
224	600518	康美药业	2,741,453.00	2.86
225	601229	上海银行	2,708,171.60	2.82
226	600525	长园集团	2,706,111.00	2.82
227	601717	郑煤机	2,705,814.00	2.82
228	603369	今世缘	2,686,801.00	2.80
229	300349	金卡智能	2,686,689.00	2.80
230	002195	二三四五	2,685,971.00	2.80
231	002185	华天科技	2,672,031.40	2.79
232	600549	厦门钨业	2,664,758.38	2.78
233	000830	鲁西化工	2,646,131.00	2.76
234	600110	诺德股份	2,628,963.50	2.74
235	002241	歌尔股份	2,599,702.00	2.71
236	600330	天通股份	2,575,739.96	2.69
237	600728	佳都科技	2,523,802.00	2.63
238	600926	杭州银行	2,520,405.96	2.63
239	600845	宝信软件	2,517,553.00	2.63
240	600893	航发动力	2,517,160.95	2.63
241	600079	人福医药	2,509,918.50	2.62



242	000703	恒逸石化	2,505,711.70	2.61
243	601899	紫金矿业	2,498,760.00	2.61
244	600029	南方航空	2,494,167.00	2.60
245	000728	国元证券	2,458,675.00	2.56
246	002179	中航光电	2,455,001.00	2.56
247	600810	神马股份	2,450,052.00	2.56
248	000157	中联重科	2,425,487.46	2.53
249	002507	涪陵榨菜	2,403,752.00	2.51
250	603225	新凤鸣	2,394,877.95	2.50
251	002279	久其软件	2,345,753.00	2.45
252	000050	深天马 A	2,341,647.00	2.44
253	002640	跨境通	2,337,222.00	2.44
254	000069	华侨城 A	2,336,038.00	2.44
255	002376	新北洋	2,329,833.22	2.43
256	300355	蒙草生态	2,314,284.96	2.41
257	002244	滨江集团	2,304,497.14	2.40
258	600660	福耀玻璃	2,303,183.03	2.40
259	600011	华能国际	2,281,225.66	2.38
260	600486	扬农化工	2,266,789.00	2.36
261	000886	海南高速	2,257,402.32	2.35
262	600760	中航沈飞	2,252,309.00	2.35
263	002092	中泰化学	2,246,937.00	2.34
264	000060	中金岭南	2,240,954.00	2.34
265	000776	广发证券	2,238,446.00	2.33
266	300418	昆仑万维	2,218,680.56	2.31
267	002466	天齐锂业	2,208,475.00	2.30
268	002383	合众思壮	2,205,571.54	2.30
269	000988	华工科技	2,199,166.00	2.29
270	601006	大秦铁路	2,195,904.00	2.29
271	600563	法拉电子	2,194,356.24	2.29
272	300324	旋极信息	2,193,472.56	2.29
273	300288	朗玛信息	2,170,586.00	2.26
274	000333	美的集团	2,164,565.00	2.26
275	000423	东阿阿胶	2,135,081.64	2.23
276	600392	盛和资源	2,134,980.60	2.23
277	600208	新湖中宝	2,134,349.98	2.23
278	000021	深科技	2,127,030.00	2.22
279	002493	荣盛石化	2,124,923.50	2.22
280	002016	世荣兆业	2,123,271.00	2.21
281	300367	东方网力	2,108,206.00	2.20
282	300327	中颖电子	2,088,660.20	2.18
283	000933	神火股份	2,078,643.00	2.17

284	600581	八一钢铁	2,074,087.00	2.16
285	600380	健康元	2,073,725.00	2.16
286	002859	洁美科技	2,061,929.61	2.15
287	000877	天山股份	2,055,155.92	2.14
288	600628	新世界	2,052,600.00	2.14
289	002373	千方科技	2,051,016.00	2.14
290	000970	中科三环	2,021,286.00	2.11
291	600153	建发股份	2,009,192.00	2.10
292	600325	华发股份	1,981,972.60	2.07
293	002648	卫星石化	1,981,230.00	2.07
294	002176	江特电机	1,950,425.00	2.03
295	002727	一心堂	1,944,267.00	2.03
296	002285	世联行	1,942,823.84	2.03
297	300618	寒锐钴业	1,941,638.16	2.02

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

#### 8.4.3 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	1,868,887,434.90
卖出股票收入（成交）总额	1,752,527,213.91

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,776,783.60	1.85
	其中：政策性金融债	1,776,783.60	1.85
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	1,776,783.60	1.85

#### 8.6 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	018005	国开 1701	17,690	1,776,783.60	1.85

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 8.10.2 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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 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。

#### 8.11.2 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。

#### 8.11.3 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。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 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。

2018 年 7 月 10 日，招商银行天津分行因向不符合条件的借款人发放贷款、贷后管理失职两问题，被天津银监局处以 40 万人民币罚款。

2018 年 8 月 17 日，招商银行成都分行违反帐户、银行卡、反洗钱等相关规定，中国人民银行成都分行决定对其予以警告，没收违法所得人民币 40.32 万元，处人民币 221 万元罚款，对相关人员处人民币 11 万元罚款。

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。

#### 8.12.2 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。

#### 8.12.3 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	203,735.62
2	应收证券清算款	3,396,755.08
3	应收股利	-
4	应收利息	52,421.94
5	应收申购款	2,689.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,655,602.37

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600030	中信证券	1,845,953.00	1.93	重大事项停牌

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 (%)
1,612	81,582.14	26,016,332.40	19.78	105,494,077.63	80.22

### 9.2 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	13,185.86	0.0100

### 9.3 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

### 9.4 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	7.60	10,000,000.00	7.60	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	7.60	10,000,000.00	7.60	3 年
----	---------------	------	---------------	------	-----

## § 10 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
本报告期基金总申购份额	1,956,738.60
减：本报告期基金总赎回份额	213,514,826.76
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	131,510,410.03

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：2018 年 2 月 27 日正式任命甘华先生、席晓峰先生为公司副总经理；2018 年 7 月 5 日，刘玉生先生职务由督察长调整为副总经理、席晓峰先生职务由副总经理调整为督察长。

报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人公募基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 60,000.00 元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效日（2018 年 2 月 1 日）起至本报告期末。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2018 年 2 月 23 日，本基金管理人收到上海证监局针对 2017 年常规检查结果出具的《关于对华泰证券（上海）资产管理有限公司出具采取警示函监管措施的决定》（沪证监决【2018】15 号），认为本基金管理人在业务开展中存在以下问题：“一是投资者适当性管理落实不到位，存在风险测评问卷填写不完整、部分客户信息填写前后矛盾等问题；二是投资、交易制度不健全，存在交易对手管理薄弱、债券信用评级管理未全面覆盖、询价管理不规范、异常交易管理不到位等问题”。对此，本基金管理人高度重视，立即组织公司相关部门对上述问题进行了深刻剖析，逐项制定了整改方案并完成了整改落实工作，责成相关部门及时采取措施，严格落实监管要求，并上报了整改报告。截止目前，上海证监局在检查意见中所提出问题均已整改完毕。

除上述事件外，报告期内，未出现本基金管理人、托管人及其高级管理人员接受稽查或被监管处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	3,621,414,648.81	100.00%	2,648,335.93	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。

#### 11.7.2 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	15,711,046.10	100.00%	3,835,367,000.00	100.00%	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 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

3、本基金管理人于 2018 年 7 月 7 日在《中国证券报》、《上海证券报》及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》，任命刘玉生先生为公司副总经理，不再担任公司合规总监、首席风险官、督察长职务，任职日期为 2018 年 7 月 5 日。

4、本基金管理人于 2018 年 7 月 7 日在《中国证券报》、《上海证券报》及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》，任命席晓峰先生为公司合规总监、首席风险官、督察长，不再担任公司副总经理职务，任职日期为 2018 年 7 月 5 日。