

华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合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：华泰保兴基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年三月二十六日

## §1 重要提示

### 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独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 22 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。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

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。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华泰保兴吉年福
基金主代码	005522
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 28 日
基金管理人	华泰保兴基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	229,987,000.00 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过对股票、固定收益证券和现金等大类资产适度配置，灵活运用多种投资策略，把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在封闭期与开放期分别采取不同的投资策略。在封闭期内，本基金遵循经济周期性波动规律，通过定性与定量分析，动态把握不同资产类别在不同时期

	的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化，追求股票、固定收益证券和现金等大类资产的适度平衡配置。在严格控制投资风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中债总指数（全价）收益率*50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

### 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		华泰保兴基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	尤小刚	郭明
	联系电话	021-80299000	010-66105798
	电子邮箱	fund_xxpl@ehuatai.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-632-9090	95588
传真		021-60963566	010-66105799

### 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	www.ehuataifund.com
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	2017 年 12 月 28 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-5,045,246.68	10,042.78
本期利润	-4,209,208.71	10,042.78
加权平均基金份额本期利润	-0.0183	0.0000
本期基金份额净值增长率	-1.83%	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0219	0.0000
期末基金资产净值	225,787,834.07	229,997,042.78
期末基金份额净值	0.9817	1.0000

注：1、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。

2、期末可供分配利润是指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。

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

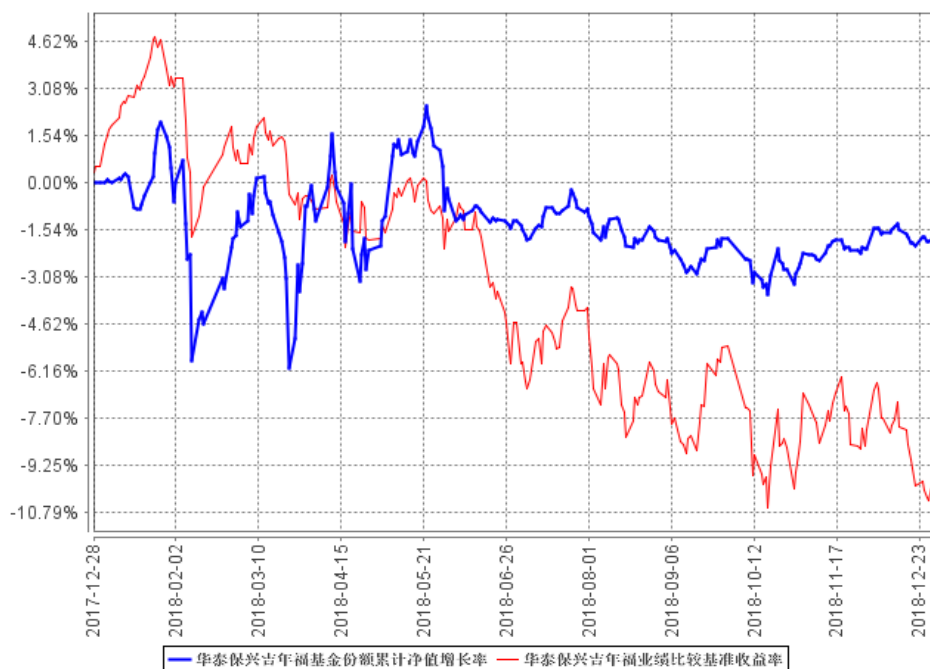
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.03%	0.27%	-4.88%	0.81%	4.85%	-0.54%
过去六个月	-0.60%	0.24%	-5.63%	0.74%	5.03%	-0.50%
过去一年	-1.83%	0.62%	-10.43%	0.66%	8.60%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-1.83%	0.61%	-9.95%	0.66%	8.12%	-0.05%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*50%+中债总指数（全价）收益率\*50%。

#### 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

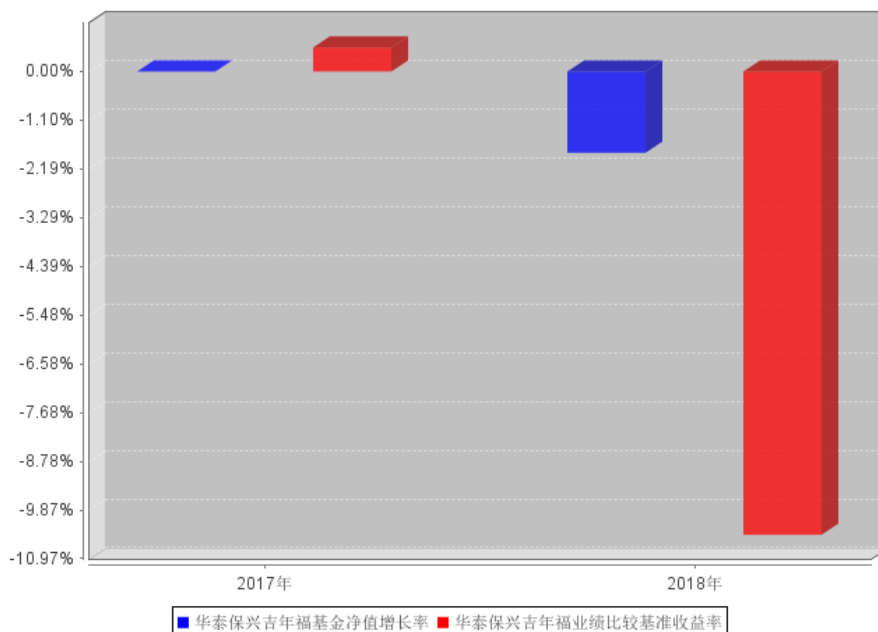
华泰保兴吉年福基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：截至报告期末，本基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

### 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

华泰保兴吉年福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对比图



注：本基金合同于 2017 年 12 月 28 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，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：本基金自 2017 年 12 月 28 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日未进行利润分配。

## §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

华泰保兴基金管理有限公司经中国证监会证监许可[2016]1309 号文核准，于 2016 年 7 月 26 日成立，注册资本 1.8 亿元人民币，公司股东分别为华泰保险集团股份有限公司（下称“华泰保险集团”）、上海飞恒资产管理中心（有限合伙）（下称“飞恒资产”）、上海旷正资产管理中心（有限合伙）（下称“旷正资产”）、上海泰颐资产管理中心（有限合伙）（下称“泰颐资产”）、上海哲昌资产管理中心（有限合伙）（下称“哲昌资产”）、上海志庄资产管理中心（有限合伙）（下称“志庄资产”），其中，华泰保险集团持股比例为 80%，飞恒资产、旷正资产、泰颐资产、哲昌资产、志庄资产均为公司高级管理人员及核心业务骨干股权激励持股平台，合计持股比例为 20%。

截至 2018 年 12 月 31 日，公司公募证券投资基金管理规模为人民币 101.05 亿元，包括华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金、华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金、华泰保兴货币市场基金、华泰保兴策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、华泰保兴尊合债券型证券投资基金、华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、华泰保兴尊信定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、华泰保兴成长优选混合型证券投资基金、华泰保兴尊利债券型证券投资基金、华泰保兴尊颐定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰保兴研究智选灵活配置混合型证券投资基金、华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金等 12 只产品。

#### 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		
章劲	基金经理	2017 年 12 月 28 日	-	13 年	上海大学文学学士。历任上海银行人力资源部科员、资金营运中心交易员、经理，华夏基金管理有限公司基金经理、华泰资产管理有限公司投资管理部副总经理、投资管理部总经理、固定收益投资部总经理、证券投资副总监、证券投资总监。2016 年 8 月加入华泰保兴基金管理有限公司，担任公司副总经理兼首席投资官。
傅奕翔	基金经理	2017 年 12 月 28 日	-	6 年	上海财经大学经济学硕士。历任华泰资产管理有限公司固定收益部研究员、投资助理，权益投资部投资助理，投资研究曾覆盖电子、传媒、计算机等行业。2016 年 8 月加入华泰保兴基金管理有限公司。
赵旭照	基金经理	2018 年 1 月 15 日	-	5 年	北京大学金融学硕士。历任国泰君安证券股份有限公司研究员。2016 年 12 月加入华泰保兴基金管理有限公司，历任公司研究部研究员。

赵健	基金经理	2018 年 6 月 12 日	-	8 年	复旦大学硕士。历任海通证券股份有限公司研究所助理分析师、分析师、高级分析师、首席分析师。2016 年 8 月加入华泰保兴基金管理有限公司，担任研究部总经理。
----	------	-----------------	---	-----	--

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、规范性文件要求和本基金基金合同约定，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，基金运作无违法违规、未履行基金合同或其他损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（证监会公告[2011]18号），公司制定了《华泰保兴基金管理有限公司公平交易制度》，该制度及控制方法适用公司管理所有投资组合（包括封闭式基金、开放式基金、社保组合、企业年金、特定客户资产管理组合等），对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资和交易管理活动相关的各个业务环节。

研究分析方面，公司研究部全面负责公司各投资组合投资业务的研究工作，研究部公平地为各投资组合管理部门提供研究服务，其研究报告在不同的投资组合之间均可共享，且在研究报告内容、质量、数量及提供时间上均保持公平性。公司所有研究报告均在公司内部研究报告系统上统一发布。

授权和投资决策方面，对于证券投资基金业务，分别明确基金投资决策委员会、基金投资部负责人、基金经理的职责和权限划分，并合理确定基金经理的投资权限，基金投资决策委员会、基金投资部负责人等管理机构和人员不得对基金经理在授权范围内的投资活动进行干预。基金经理在授权范围内可以自主决策，但超过投资权限的操作需要经过严格的审批；对于特定客户资产管理业务，分别明确专户投资决策委员会、专户投资部负责人、专户投资经理等各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定专户投资部负责人及投资经理的投资权限。专户投资决策委员会和

专户投资部负责人等管理机构和人员不得对专户投资经理在授权范围内的投资活动进行干预。专户投资经理在授权范围内可以自主决策，但超过投资权限的操作需要经过严格的审批。公司建立严格的投资组合投资信息管理及保密制度。在投资交易管理系统中设置基金经理/投资经理的查询和操作权限，并进行定期检查系统中的权限设置情况，确保不同基金经理/投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息均做到相互隔离。

交易执行方面，公司实行集中交易制度，设立独立交易室，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。所有投资对象的投资指令必须经由交易室负责人或其授权人审核分配至交易员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待，原则上应保证不同投资组合在同一时点就同一投资对象下达的相同方向的投资指令分配给同一交易员完成。交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，除需经过公平性审核的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关：（一）对于同一时间段的不同交易价格，投资交易系统对于不同投资组合一律按价格优先的顺序成交；（二）对于同一时间段的相同交易价格，投资交易系统对于不同投资组合自动按比例分配成交量，即按照不同投资组合平均分配的原则。

事后监督，风险管理部负责对不同投资组合公平交易行为进行交易价差等数量化分析，并通过定量分析结果对公平交易的过程、结果实施监督：每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析；每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行 1 日、3 日、5 日同向交易价差分析。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司公平交易制度的执行情况主要包括：公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；建立统一的研究报告发布和信息共享平台，使各投资组合得到公平的投资研究服务；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行投资授权制度及授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度，以“时间优先、价格优先”为基本原则，结合投资交易系统内的公平交易模块，尽最大可能保证公平对待各投资组合；建立各投资组合投资信息严格管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对各投资组合投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。



本报告期内，未发现各投资组合因非公平交易等导致的利益输送行为及其他违反公平交易制度的情况，公平交易制度的整体执行情况良好。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待不同的投资组合，公司制定《异常交易监控与报告制度》对涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行了界定，并拟定相应的监控、识别、分析与防控措施；公司禁止同一交易日内同一投资组合内部、不同投资组合之间的反向交易以及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为。

公司对各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易、反向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易制度的异常交易行为。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 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

本基金 2018 年上半年配置了交运、消费、计算机等行业，个股选择上倾向于成长性较好的优质龙头。在 2018 年年中判断经济下行压力将叠加贸易战影响，主动降低仓位到 20% 以下，同时持股较为稳健，基本集中在增长确定的，但估值不高的成长个股，整体看，全年基本规避了市场的大幅下跌。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9817 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.83%，业绩比较基准收益率为-10.43%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于 2019 年，我们认为随着货币政策、财政政策的发力，以及中美贸易战的缓和，市场整体压力显著减小，也进入“可为”阶段，整体看法比 2018 年下半年积极。但是我们也注意到年初以来市场急速上涨、风险偏好大幅提升，短期有部分行业交易拥挤、过度乐观的情况出现。考虑到实体经济、尤其是房地产的拖累，在两会后，市场可能逐步进入分化阶段。

在目前阶段，我们重点会关注基本面坚实、估值尚可的优质成长个股，这类公司在去年估值大幅下行之后，有望通过自身坚实的业绩提升实现估值修复，并纠正市场过度悲观的预期。从配置方向上，我们看好相对稳健的消费以及具备全球竞争力的先进制造行业，从中期看，这些行业

目前估值尚处于合理甚至偏低的位置，在外资持续流入的大背景下，该类行业也将显著受益于 A 股估值体系的国际化进程。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理、科学和一致性，保护基金份额持有人的合法权益，成立了估值委员会。估值委员会负责制订、评估和修订公司的估值管理办法，定期评估估值程序和估值技术，对估值技术进行最终决策，指导和监督整个估值流程。估值委员会委员由分管运营的副总经理、研究部、风险管理部、监察稽核部和运营保障部的指定人员担任。估值委员会委员在基金估值研究或运作方面具有丰富经验，熟悉相关法规、估值原则和估值技术，在估值工作中保持判断的专业性和客观性。

研究部负责对特殊投资品种估值进行分析研究，并就可能影响投资品种公允价值的重大事项进行监控和报告，对拟采用的估值方法进行初步判断，提出适用的估值模型和参数。风险管理部负责对特殊投资品种的估值方法和估值模型进行研究，通过实证分析等方法完善估值模型，验证研究部提供的估值模型参数并协助提供数据支持文件。监察稽核部检查、督促相关部门严格遵守法规和公司制度的规定，采用适当程序进行基金估值及调整；检查、督促相关部门及时进行信息披露；根据相关规定及估值委员会的决议对估值相关公告进行合规性审核。运营保障部根据相关法规和公司估值管理办法对基金进行估值；根据指定方法监控并汇报基金持有停牌股票的情况，根据公司估值委员会的决议进行估值并与托管人核对，与会计师事务所沟通；根据相关法规规定及时进行信息披露。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截止报告期末本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的固定收益品种/在证券交易所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）的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金的基金合同等规定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未实施利润分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同的规定实施利润分配。

#### 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

本基金为发起式基金，截至报告期末基金合同生效未满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款规定。

## §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，本基金托管人在对华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金的管理人——华泰保兴基金管理有限公司在华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对华泰保兴基金管理有限公司编制和披露的华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018 年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

本报告经江苏苏亚金诚会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具的是标准无保留意见的审计报告。投资者可通过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：华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合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	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	1,694,485.61	229,987,000.00

结算备付金	37,916,856.16	-
存出保证金	69,113.42	-
交易性金融资产	89,636,194.68	-
其中：股票投资	29,586,194.68	-
基金投资	-	-
债券投资	60,050,000.00	-
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	95,500,260.75	-
应收证券清算款	1,580,589.60	-
应收利息	1,077,271.08	27,598.44
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	227,474,771.30	230,014,598.44
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2018 年 12 月 31 日</b>	<b>2017 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	891,121.39	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	153,526.25	15,123.25
应付托管费	19,190.78	1,890.41
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	507,136.27	-
应交税费	6,962.54	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	109,000.00	542.00
负债合计	1,686,937.23	17,555.66
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	229,987,000.00	229,987,000.00
未分配利润	-4,199,165.93	10,042.78
所有者权益合计	225,787,834.07	229,997,042.78
负债和所有者权益总计	227,474,771.30	230,014,598.44

注：1.报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9817 元，基金份额总额

229,987,000.00 份。于 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额

229,987,000.00 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2018 年度和 2017 年 12 月 28 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期： 2018 年度及 2017 年 12 月 28 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 12 月 28 日(基金 合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	1,319,949.66	27,598.44
1.利息收入	4,159,251.74	27,598.44
其中：存款利息收入	434,772.28	27,598.44
债券利息收入	1,493,616.43	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,230,863.03	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-3,675,340.05	-
其中：股票投资收益	-4,165,349.89	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-110,403.26	-
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	600,413.10	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	836,037.97	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
<b>减：二、费用</b>	5,529,158.37	17,555.66
1. 管理人报酬	1,813,064.65	15,123.25
2. 托管费	226,633.13	1,890.41
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,361,072.19	-
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	2,373.40	-
7. 其他费用	126,015.00	542.00

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-4,209,208.71	10,042.78
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-4,209,208.71	10,042.78

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年度及 2017 年 12 月 28 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 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）	229,987,000.00	10,042.78	229,997,042.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,209,208.71	-4,209,208.71
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	229,987,000.00	-4,199,165.93	225,787,834.07
项目	上年度可比期间 2017 年 12 月 28 日(基金合同生效日)至 2017 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）	229,987,000.00	-	229,987,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,042.78	10,042.78
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)			
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	229,987,000.00	10,042.78	229,997,042.78

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：

王冠龙	寻卫国	王云凌
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

华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合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”)证监许可[2017]2160号《关于准予华泰保兴吉年福混合型发起式证券投资基金变更注册的批复》核准，由华泰保兴基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 229,987,000.00 元，业经江苏苏亚金诚会计师事务所(特殊普通合伙)苏亚审验[2017]53号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 229,987,000.00 份。本基金的基金管理人为华泰保兴基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,000.00 基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》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的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、可转换债

券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券(含超短期融资券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他存款)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或经中国证监会批准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：沪深 300 指数收益率\*50%+中债总指数(全价)收益率\*50%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰保兴基金管理有限公司于 2019 年 3 月 25 日批准报出。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度和 2017 年 12 月 28 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日和 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度和 2017 年 12 月 28 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2018 年度和 2017 年 12 月 28 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类



金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂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。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 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；或者(3) 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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 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

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确

认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **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。

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。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益默认以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)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)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，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。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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《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[2016]36号《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《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《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》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰保兴基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
华泰保险集团股份有限公司	基金管理人的主要股东
上海飞恒资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
上海旷正资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
上海泰颐资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
上海哲昌资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
上海志庄资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
华泰财产保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构
华泰人寿保险股份有限公司	基金管理人主要股东控制的机构

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。

### 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的交易。

#### 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1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年12月28日(基金合同生效 日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,813,064.65	15,123.25
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	0.00

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年12月28日(基金合同生效 日)至2017年12月31日
----	---------------------------------	---

当期发生的基金应支付的托管费	226,633.13	1,890.41
----------------	------------	----------

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

注：本基金不收取销售服务费。

#### 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

注：本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 12 月 31 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
华泰财产保险 有限公司	99,989,000.00	43.48%	99,989,000.00	43.48%
华泰保险集团 股份有限公司	10,000,000.00	4.35%	10,000,000.00	4.35%
华泰人寿保险 股份有限公司	119,998,000.00	52.18%	119,998,000.00	52.18%

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

#### 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 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 12 月 28 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,694,485.61	215,258.00	229,987,000.00	27,598.44

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 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。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：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。

### 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601138	工业富联	2018 年 6 月 8 日	2019 年 6 月 7 日	首发机构配售	13.77	10.97	66,791	919,712.07	732,697.27	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110049	海尔转债	2018 年 12 月 20 日	2019 年 1 月 18 日	新债未上市	100.00	100.00	5,900	590,000.00	590,000.00	-

#### 7.4.9.2 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。

#### 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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。



### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 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 29,586,194.68 元，属于第二层次的余额为 60,050,000.00 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：无第一、第二、第三层次)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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股票和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，确定相关股票和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

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

##### (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)其他

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	29,586,194.68	13.01
	其中：股票	29,586,194.68	13.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	60,050,000.00	26.40
	其中：债券	60,050,000.00	26.40
	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	95,500,260.75	41.98
	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	39,611,341.77	17.41
8	其他各项资产	2,726,974.10	1.20
9	合计	227,474,771.30	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	24,187,103.00	10.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,800,064.00	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	900,600.00	0.40
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	2,698,427.68	1.20
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	29,586,194.68	13.10

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	603338	浙江鼎力	121,179	6,824,801.28	3.02
2	603337	杰克股份	128,905	4,729,524.45	2.09
3	603228	景旺电子	87,900	4,394,121.00	1.95
4	603605	珀莱雅	96,124	4,236,184.68	1.88
5	603018	中设集团	154,904	2,698,427.68	1.20
6	300230	永利股份	445,964	2,176,304.32	0.96
7	603708	家家悦	89,600	1,800,064.00	0.80
8	600104	上汽集团	41,000	1,093,470.00	0.48
9	300271	华宇软件	60,000	900,600.00	0.40
10	601138	工业富联	66,791	732,697.27	0.32

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

### 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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600029	南方航空	45,761,730.25	19.90
2	002244	滨江集团	36,460,517.33	15.85
3	601939	建设银行	35,830,012.97	15.58
4	601288	农业银行	34,644,000.00	15.06
5	600115	东方航空	32,731,383.40	14.23
6	300324	旋极信息	31,248,365.43	13.59
7	601166	兴业银行	30,013,135.00	13.05

8	601169	北京银行	28,584,106.08	12.43
9	600340	华夏幸福	27,770,080.05	12.07
10	002065	东华软件	26,979,525.00	11.73
11	600048	保利地产	26,860,914.84	11.68
12	601111	中国国航	26,689,966.54	11.60
13	000069	华侨城 A	26,593,333.87	11.56
14	601991	大唐发电	25,878,552.55	11.25
15	002341	新纶科技	23,571,324.35	10.25
16	601998	中信银行	21,534,854.00	9.36
17	300113	顺网科技	21,172,326.00	9.21
18	600259	广晟有色	20,153,084.41	8.76
19	600271	航天信息	19,207,387.94	8.35
20	600299	安迪苏	18,680,969.00	8.12
21	000671	阳光城	18,274,971.00	7.95
22	601229	上海银行	17,882,619.00	7.78
23	600190	锦州港	17,238,420.90	7.50
24	601318	中国平安	16,794,027.00	7.30
25	600686	金龙汽车	16,344,182.60	7.11
26	002624	完美世界	16,307,099.30	7.09
27	000717	韶钢松山	16,154,375.00	7.02
28	000636	风华高科	15,658,470.00	6.81
29	300053	欧比特	15,273,559.00	6.64
30	002732	燕塘乳业	14,845,504.20	6.45
31	000963	华东医药	14,743,870.00	6.41
32	002386	天原集团	14,691,123.00	6.39
33	600111	北方稀土	14,293,604.58	6.21
34	600392	盛和资源	14,209,364.53	6.18
35	601899	紫金矿业	14,136,000.00	6.15
36	600050	中国联通	13,871,499.00	6.03
37	000002	万科 A	13,779,515.00	5.99
38	000538	云南白药	13,653,860.22	5.94
39	000732	泰禾集团	12,866,405.00	5.59
40	300395	菲利华	12,691,465.70	5.52
41	300107	建新股份	12,418,079.78	5.40
42	600409	三友化工	11,931,160.50	5.19
43	300383	光环新网	11,446,302.16	4.98

44	000807	云铝股份	11,343,100.00	4.93
45	002325	洪涛股份	10,995,068.78	4.78
46	600019	宝钢股份	10,810,500.00	4.70
47	002262	恩华药业	10,751,996.00	4.67
48	600093	易见股份	10,697,989.98	4.65
49	300628	亿联网络	10,185,316.00	4.43
50	601880	大连港	10,013,400.00	4.35
51	000831	五矿稀土	9,728,788.60	4.23
52	600027	华电国际	9,426,071.00	4.10
53	002007	华兰生物	8,706,117.00	3.79
54	603605	珀莱雅	8,334,716.72	3.62
55	601233	桐昆股份	8,094,066.00	3.52
56	000977	浪潮信息	7,913,451.80	3.44
57	002439	启明星辰	7,858,005.00	3.42
58	600519	贵州茅台	7,639,838.00	3.32
59	300147	香雪制药	7,579,420.00	3.30
60	002572	索菲亚	7,476,717.00	3.25
61	601377	兴业证券	7,425,033.00	3.23
62	603338	浙江鼎力	7,246,234.70	3.15
63	603228	景旺电子	7,160,432.00	3.11
64	601600	中国铝业	7,089,750.00	3.08
65	300251	光线传媒	7,085,887.00	3.08
66	603018	中设集团	6,959,121.00	3.03
67	603337	杰克股份	6,952,192.58	3.02
68	000970	中科三环	6,763,420.69	2.94
69	002029	七匹狼	6,309,294.00	2.74
70	600317	营口港	6,032,866.00	2.62
71	600208	新潮中宝	5,977,600.00	2.60
72	002777	久远银海	5,861,701.44	2.55
73	002372	伟星新材	5,688,270.30	2.47
74	000661	长春高新	5,668,947.00	2.46
75	300284	苏交科	5,616,770.45	2.44
76	300424	航新科技	5,564,503.00	2.42
77	600547	山东黄金	5,162,698.00	2.24
78	600104	上汽集团	4,890,694.68	2.13
79	000932	华菱钢铁	4,765,899.00	2.07

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600029	南方航空	45,136,780.44	19.62
2	601939	建设银行	35,511,387.84	15.44
3	601288	农业银行	34,755,500.00	15.11
4	002244	滨江集团	34,136,587.63	14.84
5	300324	旋极信息	32,526,835.53	14.14
6	600115	东方航空	31,326,061.80	13.62
7	601166	兴业银行	29,986,117.00	13.04
8	601169	北京银行	28,674,008.11	12.47
9	002065	东华软件	28,413,534.00	12.35
10	002341	新纶科技	27,478,093.99	11.95
11	600048	保利地产	26,146,614.00	11.37
12	601111	中国国航	25,759,899.00	11.20
13	600340	华夏幸福	25,755,701.20	11.20
14	601991	大唐发电	25,386,590.87	11.04
15	000069	华侨城 A	24,390,791.51	10.60
16	600271	航天信息	23,733,604.84	10.32
17	300113	顺网科技	23,377,416.00	10.16
18	601998	中信银行	21,650,261.98	9.41
19	600259	广晟有色	20,523,936.02	8.92
20	000671	阳光城	18,165,367.00	7.90
21	600299	安迪苏	17,906,730.06	7.79
22	600686	金龙汽车	17,337,087.94	7.54
23	601229	上海银行	17,264,878.86	7.51
24	601318	中国平安	16,435,651.61	7.15
25	000717	韶钢松山	16,246,063.34	7.06
26	000963	华东医药	16,234,514.00	7.06
27	002624	完美世界	16,168,282.43	7.03
28	300053	欧比特	15,707,995.53	6.83
29	600190	锦州港	15,400,444.45	6.70
30	000538	云南白药	15,367,983.05	6.68
31	601899	紫金矿业	14,848,147.75	6.46
32	002386	天原集团	14,317,430.12	6.23

33	002732	燕塘乳业	14,244,136.00	6.19
34	000636	风华高科	13,739,940.00	5.97
35	600111	北方稀土	13,295,380.49	5.78
36	600050	中国联通	13,193,393.50	5.74
37	600392	盛和资源	13,009,265.00	5.66
38	000002	万科 A	12,832,727.83	5.58
39	300107	建新股份	12,741,402.62	5.54
40	002262	恩华药业	12,717,926.16	5.53
41	000732	泰禾集团	12,676,701.00	5.51
42	300395	菲利华	12,591,617.75	5.47
43	600019	宝钢股份	11,788,750.32	5.13
44	600409	三友化工	11,384,605.26	4.95
45	600093	易见股份	10,653,366.00	4.63
46	000807	云铝股份	10,535,229.00	4.58
47	002325	洪涛股份	10,435,003.72	4.54
48	300383	光环新网	10,358,437.00	4.50
49	300628	亿联网络	10,318,279.72	4.49
50	000831	五矿稀土	9,825,924.00	4.27
51	601880	大连港	9,761,400.00	4.24
52	600027	华电国际	9,057,023.00	3.94
53	000977	浪潮信息	8,903,689.00	3.87
54	002007	华兰生物	8,715,375.00	3.79
55	601233	桐昆股份	8,169,939.15	3.55
56	002572	索菲亚	7,877,475.00	3.43
57	002439	启明星辰	7,768,407.00	3.38
58	601377	兴业证券	7,691,812.00	3.34
59	300147	香雪制药	7,303,571.12	3.18
60	300251	光线传媒	7,090,021.00	3.08
61	601600	中国铝业	6,721,451.00	2.92
62	000970	中科三环	6,706,571.87	2.92
63	002029	七匹狼	6,285,029.00	2.73
64	300284	苏交科	6,180,240.60	2.69
65	600519	贵州茅台	5,913,801.00	2.57
66	000661	长春高新	5,808,697.00	2.53
67	600208	新湖中宝	5,701,047.00	2.48
68	300424	航新科技	5,599,936.10	2.43
69	600317	营口港	5,544,964.36	2.41
70	002777	久远银海	5,359,448.00	2.33

71	600547	山东黄金	5,337,989.00	2.32
72	002372	伟星新材	4,884,668.00	2.12
73	002465	海格通信	4,725,025.12	2.05
74	000001	平安银行	4,699,400.00	2.04
75	000932	华菱钢铁	4,644,894.00	2.02

### 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	1,315,515,417.69
卖出股票收入（成交）总额	1,282,577,412.99

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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	20,088,000.00	8.90
	其中：政策性金融债	20,088,000.00	8.90
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）	590,000.00	0.26
8	同业存单	39,372,000.00	17.44
9	其他	-	-
10	合计	60,050,000.00	26.60

### 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	200,000	20,088,000.00	8.90
2	111809276	18 浦发银行 CD276	200,000	19,688,000.00	8.72
3	111815503	18 民生银行 CD503	200,000	19,684,000.00	8.72
4	110049	海尔转债	5,900	590,000.00	0.26



## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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

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

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

1、18 浦发银行 CD276（代码：111809276）为华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金的前十大持仓证券。经中国银保监会官网 2018 年 5 月 4 日发布信息显示，2018 年 2 月 12 日，原中国银监会针对浦发银行十九项违法违规行为，对浦发银行处以罚款 5845 万元，没收违法所得 10.927 万元，罚没合计 5855.927 万元的行政处罚；经中国人民银行 2018 年 8 月 1 日发布信息显示，2018 年 7 月 26 日，中国人民银行对浦发银行未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易等反洗钱违法违规行为出具了银反洗罚决字（2018）3 号行政处罚决定书。

2、18 民生银行 CD503（代码：111815503）为华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金的前十大持仓证券。经中国银保监会官网 2018 年 12 月 7 日发布信息显示，2018 年 11 月 9 日，中国银保监会针对民生银行贷款业务严重违反审慎经营规则的违法违规行为，对民生银行处以罚款 200 万元的行政处罚；同时，中国银保监会针对民生银行内控管理严重违反审慎经营规则等七项违法违规行为，对民生银行处以罚款 3160 万元的行政处罚。

本基金投资 18 浦发银行 CD276、18 民生银行 CD503 的投资决策程序，符合法律法规及公司投资制度有关规定。除 18 浦发银行 CD276、18 民生银行 CD503 外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查或在报告编制日一年前受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，无基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 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	69,113.42
2	应收证券清算款	1,580,589.60
3	应收股利	-
4	应收利息	1,077,271.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,726,974.10

### 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	601138	工业富联	732,697.27	0.32	流通受限

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §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
3	76,662,333.33	229,987,000.00	100.00%	0.00	0.00%

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本基金的基金管理人的从业人员于本报告期末未持有本基金。

## 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的情况

注：本公司高管及投研部门负责人、本基金基金经理于本报告期末未持有本基金。

## 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	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金经理等人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金管理人股东	10,000,000.00	4.35	10,000,000.00	4.35	自基金合同生效之日起不少于 3 年
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	-
合计	10,000,000.00	4.35	10,000,000.00	4.35	-

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年12月28日）基金份额总额	229,987,000.00
本报告期期初基金份额总额	229,987,000.00
本报告期期间基金总申购份额	-
减：本报告期期间基金总赎回份额	-
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	229,987,000.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 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

1、本报告期内，2018 年 3 月，基金管理人副总经理邓航先生离任；2018 年 5 月，基金管理人副总经理姜光明先生离任。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2、本报告期内，基金托管人专门托管部门无重大人事变动。

## 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，无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请江苏苏亚金诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告年度本基金应支付审计费人民币 50,000 元。

## 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

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，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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	
天风证券	2	1,173,033,132.74	45.19%	834,375.35	45.19%	-
长江证券	2	765,618,284.33	29.50%	544,580.72	29.50%	-
国泰君安证券	2	558,184,084.65	21.50%	397,037.61	21.50%	-
国金证券	2	95,912,614.85	3.70%	68,222.83	3.70%	-
平安证券	2	2,982,334.04	0.11%	2,121.23	0.11%	本报告期新增
华泰证券	2	-	-	-	-	本报告期新增

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字

[2007]48 号) 有关规定, 基金管理人等多家证券经营机构进行了综合评估。

1、专用交易单元的选择标准:

- (1) 财务状况良好, 经营行为规范;
- (2) 研究实力较强, 具有专门的研究机构和专职研究人员, 能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向和个股分析的研究报告等信息服务;
- (3) 内部管理规范、严谨, 具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。

2、专用交易单元的选择程序:

- (1) 公司对交易单元所属券商进行综合评价, 投资决策委员会根据综合评价的结果作出租用与否的决策;
- (2) 公司研究部定期组织对交易单元所属券商的综合服务进行评价, 由投资决策委员会对交易单元的交易量进行分配和调整。

**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
天风证券	5,021,500.00	23.31%	6,096,600,000.00	37.01%	-	-
长江证券	16,125,350.45	74.85%	4,580,200,000.00	27.81%	-	-
国泰君安证券	395,589.00	1.84%	5,244,000,000.00	31.84%	-	-
国金证券	-	-	485,000,000.00	2.94%	-	-
平安证券	-	-	65,000,000.00	0.39%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

**§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**

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	2018.01.01-2018.12.31	99,989,000.00	0.00	0.00	99,989,000.00	43.48%
	2	2018.01.01-2018.12.31	119,998,000.00	0.00	0.00	119,998,000.00	52.18%

产品特有风险

本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。

注：申购份额含红利再投、转换入份额。赎回份额含转换出份额。

**12.2 影响投资者决策的其他重要信息**

无。

华泰保兴基金管理有限公司

2019 年 3 月 26 日