
华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2019 年 08 月 29 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 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 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰紫金红利低波指数发起
基金主代码	005279
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 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	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	93,636,200.48 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	中证红利低波动指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱鸣
	联系电话	021-68984388
	电子邮箱	mingzhu@htsc.com
客户服务电话	4008895597	95559
传真	021-28972120	021-62701216

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	2019 年 01 月 01 日-2019 年 06 月 30 日
本期已实现收益	4,384,471.13
本期利润	14,372,808.97

加权平均基金份额本期利润	0.1352
本期加权平均净值利润率	14.58%
本期基金份额净值增长率	13.45%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年 06 月 30 日
期末可供分配利润	-7,761,109.08
期末可供分配基金份额利润	-0.0829
期末基金资产净值	88,648,223.05
期末基金份额净值	0.9467
3.1.3 累计期末指标	2019 年 06 月 30 日
基金份额累计净值增长率	-5.33%

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。

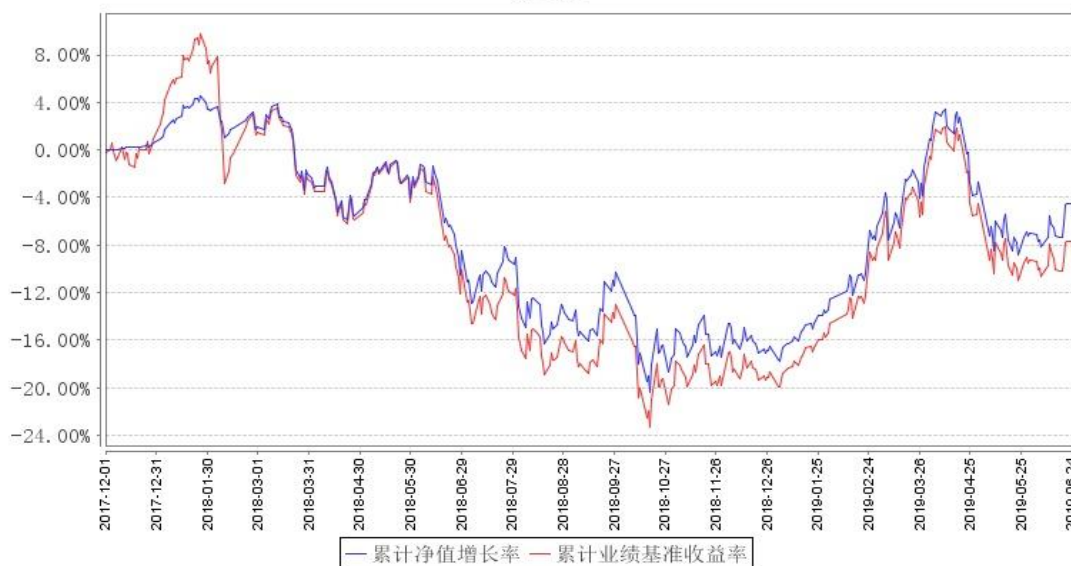
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.83%	0.80%	0.34%	0.85%	1.49%	-0.05%
过去三个月	-3.90%	1.22%	-6.10%	1.27%	2.20%	-0.05%
过去六个月	13.45%	1.18%	12.03%	1.24%	1.42%	-0.06%
过去一年	3.42%	1.24%	1.23%	1.30%	2.19%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-5.33%	1.10%	-8.96%	1.20%	3.63%	-0.10%

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

华泰紫金红利低波指数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：1、本基金业绩比较基准收益率=中证红利低波动指数收益率；

2、本基金合同于 2017 年 12 月 1 日生效，截止本报告期末基金成立已满一年；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。

§ 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 2019 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、华泰紫金季季享定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰紫金智惠定期开放债券型证券投资基金、华泰紫金丰泰纯债债券型发起式证券投资基金八只证券投资基金。

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	2017-12-01	-	13	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	2017-12-12	-	8	毛甜女士，武汉大学金融工程硕士。2010 年至 2012 年曾任国信证券经济研究所金融工程部助理分析师；2012 年至 2017 年任职光大富尊投资有限公司，历任量化研究员、量化投资经理。2017 年 7 月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司，2017 年 12 月起担任华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金基金经理。2018 年 3 月起担任华泰

					紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------------

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

本报告期内, 本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定, 确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动和环节得到公平对待, 各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易, 本报告期内未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初随着国内央行全面降准，海外美联储“转鸽”，中美贸易摩擦也在多轮谈判磋商后取得重大进展，市场风险偏好显著提升，北上资金大幅流入，各主要股指大幅上涨；4月初大盘冲高回落，兑现调整预期，回归基本面验证，随后在基本面数据不及预期以及中美贸易战再度升温的影响下继续震荡回调。截至本报告期末，上证综指上涨 19.45%，深证成份指数上涨 26.78%，沪深 300 指数上涨 27.07%，中证 800 指数上涨 25.04%。

在操作上，本基金为保证对业绩基准的紧密跟踪，本着勤勉尽责的态度，我们严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，以控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

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 13.45%，同期业绩比较基准收益率为 12.03%。

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 年下半年，当前国内宏观经济承压，下半年或继续探底，一方面国内有望加大政策刺激力度对冲经济下行风险，另一方面贸易战仍是不可忽视的长期影响因素，因此下半年 A 股市场还需谨慎，但也存在诸多结构性机会。本基金将继续坚持指数化投资策略，紧密跟踪目标指数。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

1、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形；

2、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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

2019 年上半年，基金托管人在华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2019 年上半年度，华泰证券（上海）资产管理有限公司在华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2019 年上半年度，由华泰证券（上海）资产管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		5,095,322.06	3,405,466.69
结算备付金		19,734.32	83,690.48
存出保证金		16,007.01	34,937.29
交易性金融资产		83,968,631.50	96,394,338.67
其中：股票投资		83,968,631.50	94,390,838.67
基金投资		-	-
债券投资		-	2,003,500.00
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		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		2,324.03	47,015.48
应收股利		-	-
应收申购款		70,302.63	116,331.61
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		89,172,321.55	100,081,780.22
负债和所有者权益		本期末	上年度末
		2019年6月30日	2018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		209,288.56	94,448.38
应付赎回款		143,693.49	24,100.72
应付管理人报酬		57,882.31	67,697.53
应付托管费		7,235.30	8,462.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		6,657.49	75,491.93
应交税费		-	10,311.22
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		99,341.35	175,000.00
负债合计		524,098.50	455,511.96
所有者权益:			
实收基金		93,636,200.48	119,383,040.27
未分配利润		-4,987,977.43	-19,756,772.01
所有者权益合计		88,648,223.05	99,626,268.26
负债和所有者权益总计		89,172,321.55	100,081,780.22

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 93,636,200.48 份，基金份额净值 0.9467 元。

6.2 利润表

会计主体：华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		14,958,478.80	-9,020,852.59
1. 利息收入		54,103.83	517,319.76

其中：存款利息收入		36,091.50	174,067.27
债券利息收入		18,012.33	24,957.76
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	318,294.73
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,913,561.87	-1,594,247.63
其中：股票投资收益		3,128,854.95	-3,425,646.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-500.00	-100.00
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		1,785,206.92	1,831,498.70
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		9,988,337.84	-7,983,905.93
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		2,475.26	39,981.21
减：二、费用		585,669.83	1,316,873.60
1. 管理人报酬		390,919.36	528,794.49
2. 托管费		48,864.96	66,099.29
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		45,122.51	603,144.85
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		100,763.00	118,834.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,372,808.97	-10,337,726.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,372,808.97	-10,337,726.19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	119,383,040.27	-19,756,772.01	99,626,268.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,372,808.97	14,372,808.97
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）	-25,746,839.79	395,985.61	-25,350,854.18
其中：1. 基金申购款	10,948,402.72	-732,676.93	10,215,725.79
2. 基金赎回款	-36,695,242.51	1,128,662.54	-35,566,579.97
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）	93,636,200.48	-4,987,977.43	88,648,223.05
项目	上年度可比期间 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）	178,337,999.37	1,074,719.33	179,412,718.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-10,337,726.19	-10,337,726.19
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）	-58,552,518.81	-869,233.38	-59,421,752.19
其中：1. 基金申购款	42,108,051.05	672,914.95	42,780,966.00
2. 基金赎回款	-100,660,569.86	-1,542,148.33	-102,202,718.19
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）	119,785,480.56	-10,132,240.24	109,653,240.32

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：

朱前

席晓峰

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 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。

6.4.2 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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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
交通银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限责任公司	基金管理人的股东、基金销售机构

6.4.4 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。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华泰证券	37,526,191.96	100.00	722,536,066.73	100.00

6.4.4.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 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 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
华泰证券	-	-	8,973,700.00	100.00

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.4.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 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 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
华泰证券	-	-	808,100,000.00	100.00

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.4.1.4 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。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	11,257.99	100.00	6,657.49	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	216,761.90	100.00	83,478.51	100.00

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 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	390,919.36
其中：支付销售机构的客户维护费	240,214.55	337,918.80

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

6.4.4.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	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	48,864.96	66,099.29

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

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2017 年 12 月 1 日）持有的基金份额	10,000,450.00	10,000,450.00
期初持有的基金份额	10,000,450.00	10,000,450.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,450.00	10,000,450.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.68%	8.35%

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。

6.4.4.4.2 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。

6.4.4.5 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		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日		2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

交通银行股份有限公司	5,095,322.06	34,973.31	3,707,764.76	155,430.53
------------	--------------	-----------	--------------	------------

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.5 期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.6 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 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 83,968,631.50 元，无属于第二层次或第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 92,802,735.27 元，第二层次 3,591,603.40 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 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有公允价值归属于第三层次的金融工具。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2018 年 12 月 31 日：无)。

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	83,968,631.50	94.16
	其中：股票	83,968,631.50	94.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,115,056.38	5.74
8	其他各项资产	88,633.67	0.10
9	合计	89,172,321.55	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	25,886,134.09	29.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,059,747.07	9.09
E	建筑业	889,870.00	1.00
F	批发和零售业	1,145,473.64	1.29

G	交通运输、仓储和邮政业	15,631,221.83	17.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	15,684,996.61	17.69
K	房地产业	15,136,692.26	17.08
L	租赁和商务服务业	-	-
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	1,534,496.00	1.73
S	综合	-	-
	合计	83,968,631.50	94.72

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资类股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.1 期末指数投资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	000338	潍柴动力	225,800	2,775,082.00	3.13
2	601166	兴业银行	144,025	2,634,217.25	2.97
3	600383	金地集团	218,079	2,601,682.47	2.93
4	600376	首开股份	287,000	2,562,910.00	2.89
5	600900	长江电力	142,700	2,554,330.00	2.88
6	601939	建设银行	333,700	2,482,728.00	2.80
7	600325	华发股份	312,300	2,439,063.00	2.75
8	600104	上汽集团	93,099	2,374,024.50	2.68
9	600036	招商银行	64,832	2,332,655.36	2.63
10	600741	华域汽车	103,800	2,242,080.00	2.53

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

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有积极投资类股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	600036	招商银行	831,404.00	0.83
2	601166	兴业银行	654,271.00	0.66
3	601318	中国平安	607,880.00	0.61
4	002191	劲嘉股份	522,086.00	0.52
5	000100	TCL 集团	402,931.00	0.40
6	600104	上汽集团	376,849.00	0.38
7	600887	伊利股份	332,130.00	0.33
8	000656	金科股份	266,950.00	0.27
9	601598	中国外运	202,645.00	0.20
10	601939	建设银行	183,870.00	0.18
11	603198	迎驾贡酒	145,191.00	0.15
12	600383	金地集团	136,508.00	0.14
13	600612	老凤祥	135,988.00	0.14
14	600828	茂业商业	135,003.00	0.14
15	002267	陕天然气	129,600.00	0.13
16	600048	保利地产	125,406.00	0.13
17	600377	宁沪高速	119,532.00	0.12
18	000541	佛山照明	119,338.00	0.12
19	601098	中南传媒	114,046.00	0.11
20	000601	韶能股份	105,360.00	0.11

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。

7.4.2 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	000656	金科股份	1,163,597.00	1.17
2	601988	中国银行	1,119,374.00	1.12
3	002191	劲嘉股份	1,066,443.00	1.07
4	600104	上汽集团	1,035,606.00	1.04
5	601398	工商银行	1,014,489.00	1.02
6	601166	兴业银行	838,514.00	0.84
7	600376	首开股份	825,232.00	0.83

8	600383	金地集团	822,220.00	0.83
9	600325	华发股份	792,514.00	0.80
10	000100	TCL 集团	789,694.00	0.79
11	000338	潍柴动力	752,968.87	0.76
12	600036	招商银行	686,058.00	0.69
13	601939	建设银行	679,005.00	0.68
14	600741	华域汽车	658,812.00	0.66
15	600828	茂业商业	637,885.53	0.64
16	601598	中国外运	636,053.00	0.64
17	000429	粤高速 A	630,625.00	0.63
18	000631	顺发恒业	626,563.80	0.63
19	601318	中国平安	616,158.56	0.62
20	000541	佛山照明	610,460.00	0.61

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,991,896.00
卖出股票收入（成交）总额	30,534,295.96

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	16,007.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,324.03
5	应收申购款	70,302.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	88,633.67

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限的股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
3,451	27,133.06	10,052,435.80	10.74	83,583,764.68	89.26

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持 有本基金	134,070.00	0.14

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份额 比例(%)	发起份额总数	发起份额占基 金总份额比例 (%)	发起份额承诺 持有期限
基金管理人固有资金	10,000,450.00	10.68	10,000,000.00	10.68	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	10,000,450.00	10.68	10,000,000.00	10.68	3 年
----	---------------	-------	---------------	-------	-----

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 12 月 1 日）基金份额总额	613,789,315.59
本报告期期初基金份额总额	119,383,040.27
本报告期基金总申购份额	10,948,402.72
减：本报告期基金总赎回份额	36,695,242.51
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	93,636,200.48

§ 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

报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

2019 年 1 月 31 日起，甘华先生不再担任副总经理；2019 年 5 月 6 日，席晓峰先生职务由合规总监、督察长、首席风险官调整为副总经理、刘玉生先生职务由副总经理调整为合规总监、督察长、首席风险官。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本告期为基金进行审计的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况；本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	37,526,191.96	100.00%	11,257.99	100.00%	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金本报告期未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于 2019 年 2 月 2 日在本公司官网及《中国证券报》等报刊发布了《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》，决定自 2019 年 1 月 31 日起，甘华先生因工作调整原因，不再担任公司副总经理职务。

2、根据本基金管理人于 2019 年 5 月 6 日在《证券时报》等报刊以及本公司官网刊登的《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》，自 2019 年 5 月 6 日起：刘玉生先生新任公司督察长、首席风险官、合规总监；席晓峰先生不再担任本公司督察长、首席风险官、合规总监，转任本公司副总经理。

华泰证券(上海)资产管理有限公司

2019 年 08 月 29 日