

华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金

2019 年第 4 季度报告

2019 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年一月二十日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2020 年 1 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华泰紫金红利低波指数发起
基金主代码	005279
交易代码	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
报告期末基金份额总额	88,726,584.87 份
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。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2019 年 10 月 1 日-2019 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	5,328,657.39
2.本期利润	9,276,700.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.1006
4.期末基金资产净值	92,039,241.45
5.期末基金份额净值	1.0373

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

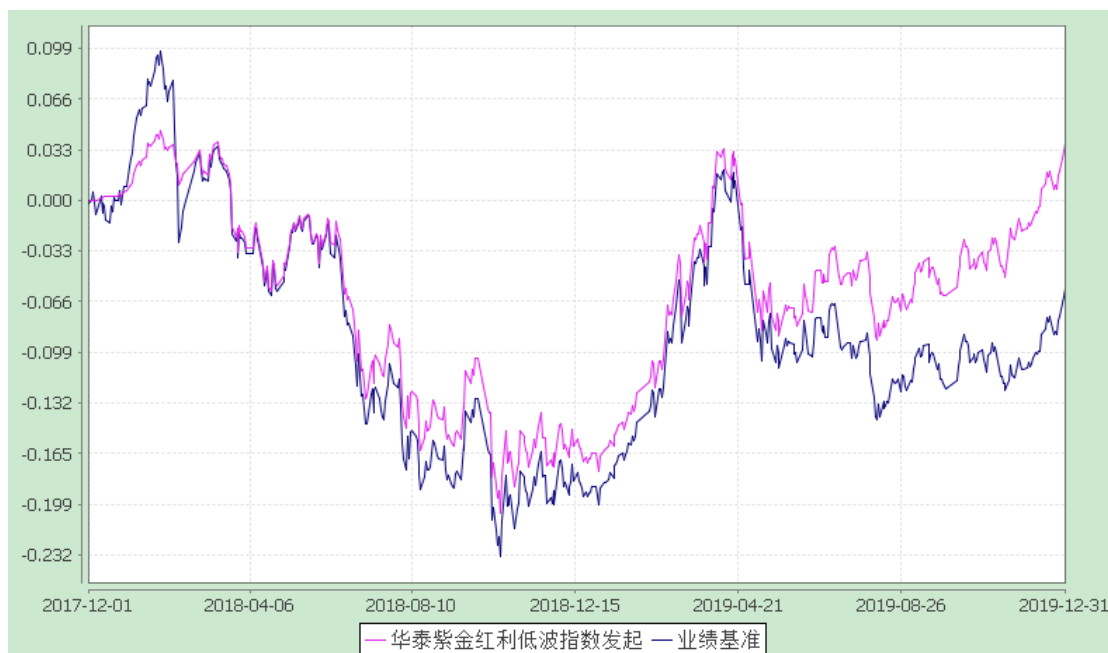
阶段	净值增长率①	净值增长率标	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④
----	--------	--------	--------	--------	-----	-----

		准差②	收益率 ③	收益率 标准差 ④		
过去三个月	10.62%	0.66%	7.54%	0.65%	3.08%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 12 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日)



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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经 理期限		证券从业 年限	说明
		任职日 期	离任日 期		
熊志勇	基金经理、基金量化部负责人	2017-12-01	2019-11-06	14	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	基金经理	2017-12-12	-	9	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。
张璐	基金经理	2019-08-02	-	5	上海交通大学硕士研究生。曾任上海东方证券资产管理有限公司量化投资部研究员，2017 年 4 月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司，任基金量化部资深研究员。2019 年 8 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、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.上述基金经理的任职日期及离任日期均以基金公告为准;首任基金经理的任职日期为基金合同的生效日期。

2. 证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《华泰紫金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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度大盘总体呈震荡整理走势，板块及个股的行情表现出相对明显的估值切换特征，在经过 10 月、11 月的震荡回调之后，12 月初受中央经济工作会议定调、经济数据超预期、中美第一阶段经贸协议文本达成一致等因素影响，市场走出了一波反弹行情。截至本报告期末，上证综指上涨 4.99%，深证成份指数上涨 10.42%，沪深 300 指数上涨 7.39%，中证 800 指数上涨 7.21%。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。

4.5 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 10.62%，同期业绩比较基准收益率为 7.54%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	87,008,653.27	93.23
	其中：股票	87,008,653.27	93.23
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	5,896,201.68	6.32
7	其他各项资产	425,199.52	0.46
8	合计	93,330,054.47	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

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	513,499.07	0.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,622,826.00	2.85

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	142,188.40	0.15
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.01
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	3,285,091.51	3.57

5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	7,544,294.00	8.20
C	制造业	25,314,434.12	27.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,358,298.00	1.48
F	批发和零售业	1,451,885.00	1.58
G	交通运输、仓储和邮政业	13,542,023.46	14.71
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	19,708,594.56	21.41
K	房地产业	13,146,760.62	14.28
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	1,657,272.00	1.80
S	综合	-	-
	合计	83,723,561.76	90.97

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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

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	601636	旗滨集团	517,200.00	2,839,428.00	3.09
2	600028	中国石化	531,300.00	2,714,943.00	2.95
3	002233	塔牌集团	204,000.00	2,570,400.00	2.79
4	601939	建设银行	354,200.00	2,560,866.00	2.78
5	601166	兴业银行	128,725.00	2,548,755.00	2.77
6	600873	梅花生物	569,300.00	2,533,385.00	2.75
7	000429	粤高速 A	303,200.00	2,504,432.00	2.72
8	600019	宝钢股份	416,100.00	2,388,414.00	2.59
9	600376	首开股份	272,000.00	2,167,840.00	2.36
10	600036	招商银行	55,932.00	2,101,924.56	2.28

5.3.2 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

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	600900	长江电力	142,700.00	2,622,826.00	2.85
2	688118	普元信息	4,028.00	142,188.40	0.15
3	688138	清溢光电	10,066.00	139,816.74	0.15
4	688218	江苏北人	5,790.00	135,949.20	0.15
5	688389	普门科技	6,931.00	93,984.36	0.10

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 声明本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内受到公开谴责、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。

5.11.2 声明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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	13,297.95
2	应收证券清算款	364,168.17
3	应收股利	-
4	应收利息	2,881.92
5	应收申购款	44,851.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	425,199.52

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有存在流通受限情况的股票。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
----	------	------	----------------	--------------	----------

1	688118	普元信息	142,188.40	0.15	科创板限售
2	688138	清溢光电	139,816.74	0.15	科创板限售
3	688218	江苏北人	135,949.20	0.15	科创板限售
4	688389	普门科技	93,984.36	0.10	科创板限售

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	96,499,746.41
本报告期基金总申购份额	21,777,372.45
减：本报告期基金总赎回份额	29,550,533.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	88,726,584.87

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,450.00
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,450.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	11.27

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内管理人运用固有资金投资本基金份额未发生变动。

§ 8 报告期末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	10,000,4 50.00	11.27%	10,000,0 00.00	11.27%	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	10,000,4 50.00	11.27%	10,000,0 00.00	11.27%	3 年

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

本基金本报告期无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据本基金管理人 2019 年 11 月 6 日在本公司官网及指定报刊上刊登的《华泰证券（上海）资产管理有限公司关于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变更的公告》，决定自 2019 年 11 月 6 日起熊志勇先生不再担任本基金基金经理，由毛甜女士、张璐先生共同管理本基金。具体内容见相关公告。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件；
- 2、《华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、报告期内披露的各项公告；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会规定的其他备查文件。

10.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人、基金托管人的办公场所。

10.3 查阅方式

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

华泰证券（上海）资产管理有限公司

二〇二〇年一月二十日