

华泰紫金信息科技主题 6 个月定期开放混合型发起式证券 投资基金

2021 年第 2 季度报告

2021 年 6 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

报告送出日期：二〇二一年七月二十一日

§ 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 2021 年 7 月 16 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 2021 年 4 月 21 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华泰紫金信息科技主题 6 个月定开混合发起
基金主代码	011694
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 4 月 21 日
报告期末基金份额总额	399,891,530.86 份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值，为投资者实现超越业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>（一）封闭期投资策略</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面，积极把握市场发展趋势，并结合经济周期不同阶段各类资产市场表现的变化情况，对股票、</p>

	<p>债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整。</p> <p>2、股票投资策略;3、债券投资策略;4、资产支持证券投资策略;5、股指期货投资策略;6、国债期货投资策略。</p> <p>(二) 开放期投资策略</p> <p>开放期内, 为了保证组合具有较高的流动性, 方便投资人安排投资, 本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下, 主要投资于具有较高流动性的投资品种, 通过合理配置组合期限结构等方式, 积极防范流动性风险, 在满足组合流动性需求的同时, 尽量减小基金净值的波动。</p>	
业绩比较基准	<p>中证沪港深互联互通 TMT 指数收益率×20%+中国战略新兴产业成份指数收益率×60%+中证全债指数收益率×20%</p>	
风险收益特征	<p>本基金为混合型证券投资基金, 其预期风险收益水平高于债券型基金与货币市场基金, 低于股票型基金。</p> <p>本基金将投资港股通标的股票, 将面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p>	
基金管理人	<p>华泰证券(上海)资产管理有限公司</p>	
基金托管人	<p>交通银行股份有限公司</p>	
下属分级基金的基金简称	<p>华泰紫金信息科技主题 6 个月定开混合发起 A</p>	<p>华泰紫金信息科技主题 6 个月定开混合发起 C</p>
下属分级基金的交易代码	<p>011694</p>	<p>011695</p>
报告期末下属分级基金	<p>276,257,551.76 份</p>	<p>123,633,979.10 份</p>

的份额总额		
-------	--	--

§ 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 (2021 年 4 月 21 日 (基金合同生效日) -2021 年 6 月 30 日)	
	华泰紫金信息科技主题 6 个月定开混合发起 A	华泰紫金信息科技主题 6 个月定开混合发起 C
1.本期已实现收益	-14,956.40	-197,309.87
2.本期利润	10,128,628.20	4,336,489.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0367	0.0351
4.期末基金资产净值	286,386,179.96	127,970,468.35
5.期末基金份额净值	1.0367	1.0351

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、本基金合同生效日为 2021 年 4 月 21 日，至本报告期末未满一季度，因此主要会计数据和财务指标只列示基金合同生效日至 2021 年 6 月 30 日数据。

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

1、华泰紫金信息科技主题 6 个月定开混合发起 A:

阶段	净值增长率①	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	①—③	②—④

				④		
自基金合同生效起至今	3.67%	0.52%	10.74%	1.05%	-7.07%	-0.53%

2、华泰紫金信息科技主题 6 个月定开混合发起 C:

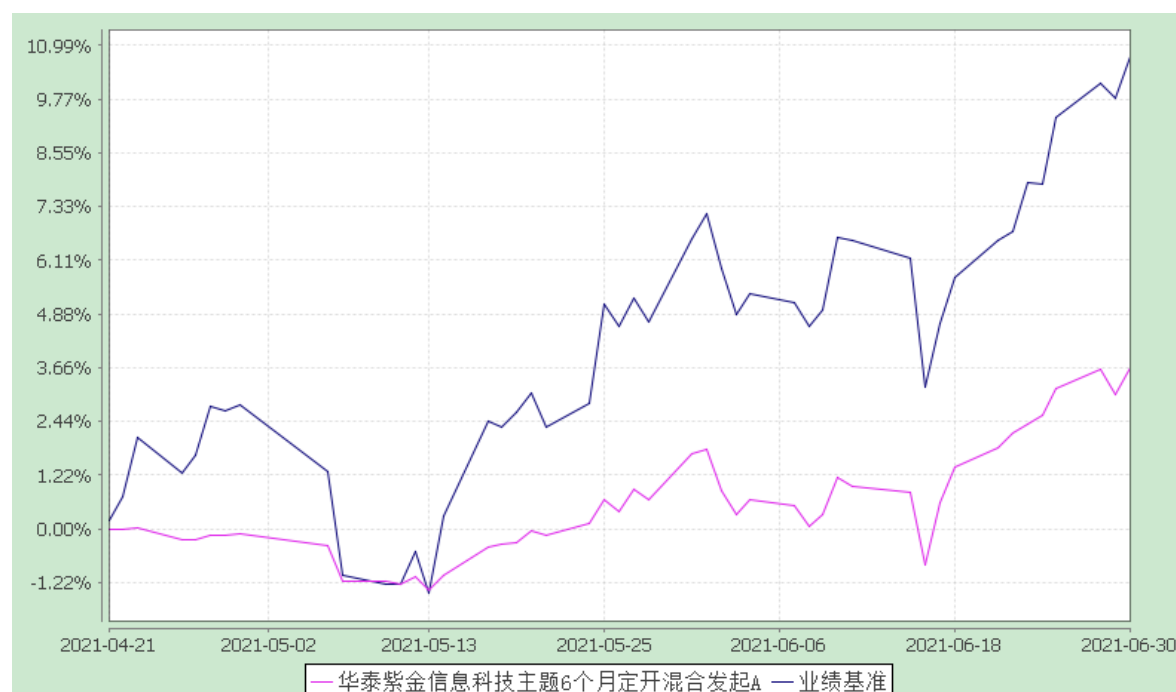
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自基金合同生效起至今	3.51%	0.52%	10.74%	1.05%	-7.23%	-0.53%

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

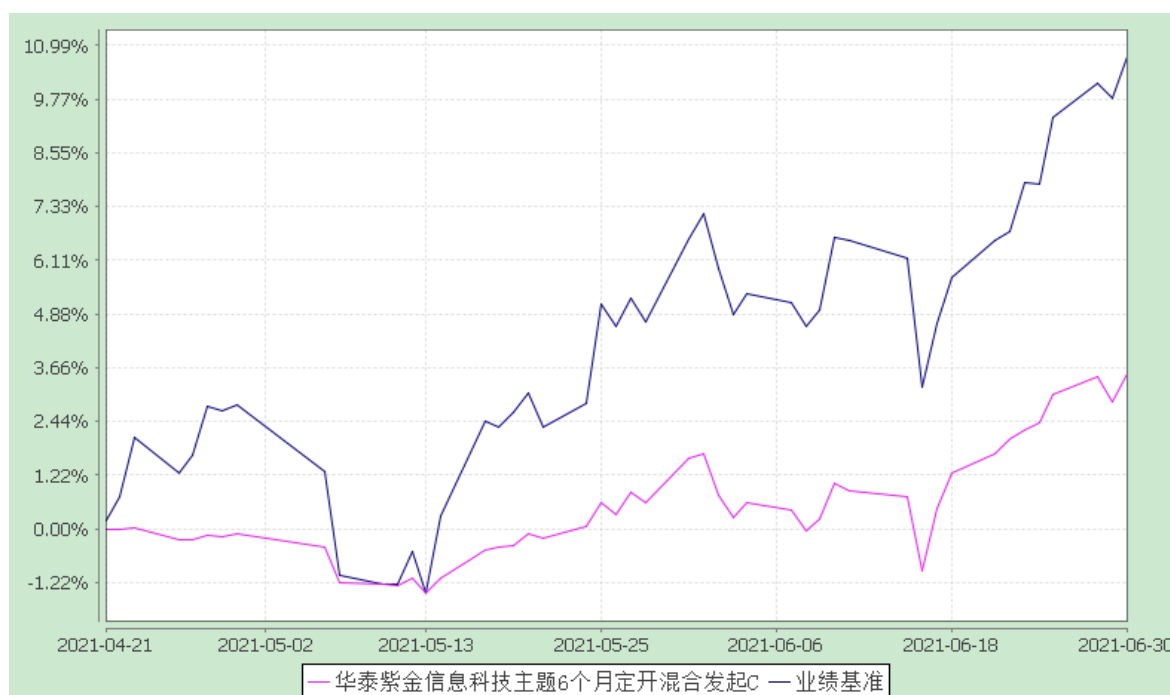
华泰紫金信息科技主题 6 个月定期开放混合型发起式证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021 年 4 月 21 日至 2021 年 6 月 30 日)

1. 华泰紫金信息科技主题 6 个月定开混合发起 A:



2. 华泰紫金信息科技主题 6 个月定开混合发起 C:



注：1、本基金运作业绩比较基准收益率=中证沪港深互联互通 TMT 指数收益率*20%+中国战略新兴产业成份指数收益率*60%+中证全债指数收益率*20%。

2、本基金合同于 2021 年 4 月 21 日生效，截止报告期末本基金运作未满一年；自基金成立日起 6 个月内为建仓期，截止报告期末本基金尚处于建仓期。

§ 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		
魏昊	本基金的基金经理,公募权益部总经理	2021-04-21	-	20	魏昊先生拥有上海外国语大学学士学位以及中欧国际工商管理学院工商管理硕士（MBA）学位，曾在英国伦敦商学院进行交换学习。2001年至 2004 年，魏昊先生曾先后在海通证券研究所从事行业和公司研究工作、在 KGI 凯基证券从事 A 股和港股行业和公司研究。2005年至 2012

				<p>年，魏昊先生曾在中国国际金融有限公司担任投资经理并曾管理全国社保基金和企业年金。2014 年 1-11 月，曾在华勤投资管理有限公司管理公司担任投资总监督管理公司二级市场股票投资及研究团队。魏昊先生于 2016 年 6 月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司，担任投资经理，同时管理 A 股和 QDII 海外股票集合资产管理计划，2018 年 7 月起担任权益投资部负责人，2021 年 5 月起担任公募权益部总经理。</p>
--	--	--	--	--

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生效日。

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
魏昊	公募基金	1.00	414,356,648.31	2021 年 4 月 21 日
	私募资产管理计划	3.00	163,763,202.49	2019 年 3 月 26 日
	其他组合	-	-	-
	合计	4.00	578,119,850.80	-

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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《华泰紫金信息科技主题 6 个月定期开放混合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

本基金于 4 月下旬完成证券开户等前期准备工作，开始建仓。经过 2019-2020 年的上涨，A 股虽然总体估值水平处于过去十年的历史均值附近，但结构性特征明显。创新药与医疗服务、新能源、电动车、半导体和新兴消费等高成长板块估值处于历史高位，但金融地产等传统权重板块估值较低，压低了平均水平。2021 年上半年，市场出现了较大波动，“核心资产”经历了急剧的调整。调整的外在诱发因素包含通胀预期和疫情反复等，但我们认为内在因素是市场的结构性特征演绎到了比较极致的水平，部分板块估值达到较高水平，资金出现流出。部分新兴板块如光伏、电动车和医疗服务等在二季度末又上涨至调整前的水平。

本基金以信息科技为主题，着眼于中长期空间进行投资，在个股选择上注重成长性和估值的平衡。在过去两个多月采取了逐步建仓的策略，较好的控制了组合净值波动，截至 6 月 30 日组合股票仓位达到 60% 以上。配置的行业包括半导体、互联网、智能驾驶、智能安防、办公软件等信息科技行业；还有风电、创新医疗器械和服务、光伏材料等新兴成长行业；此外，我们还投资了建材、五金和高端白酒等传统行业的

公司，它们虽然身处传统行业，但通过不断获取市场份额获得较大成长空间。近期强势上涨的部分板块如动力电池产业链、光伏产业链和医美等，我们看好它们未来巨大的成长空间，但短期并未重仓买入，原因在于控制建仓期波动风险，我们将对其保持紧密的跟踪和研究，寻找合适的时机和价格进行投资。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为 3.67%，同期业绩比较基准收益率为 10.74%；本基金 C 类份额净值增长率为 3.51%，同期业绩比较基准收益率为 10.74%。

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	266,215,070.54	64.13
	其中：股票	266,215,070.54	64.13
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	82,700,000.00	19.92
	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	66,160,408.56	15.94
7	其他各项资产	66,891.26	0.02
8	合计	415,142,370.36	100.00

注：1、本基金本报告期末通过港股通交易机制持有的港股期末公允价值为 54,913,901.75 元人民币，占期末基金资产净值比例 13.25%。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末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	194,992,478.39	47.06
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	8,208,184.00	1.98
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	8,100,506.40	1.95
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	-	-
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	211,301,168.79	50.99
----	----------------	-------

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	12,690,085.36	3.06
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	14,647,686.70	3.54
G 工业	-	-
H 信息技术	12,949,494.62	3.13
I 电信服务	14,626,635.07	3.53
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	54,913,901.75	13.25

注：以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard, GICS)。

5.3 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 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	600703	三安光电	894,716.00	28,675,647.80	6.92
2	002791	坚朗五金	99,900.00	19,385,595.00	4.68
3	002415	海康威视	285,700.00	18,427,650.00	4.45
4	000858	五粮液	53,500.00	15,937,115.00	3.85
5	00700	腾讯控股	30,100.00	14,626,635.07	3.53
6	600519	贵州茅台	6,500.00	13,368,550.00	3.23
7	002920	德赛西威	120,400.00	13,253,632.00	3.20
8	01810	小米集团—W	576,400.00	12,949,494.62	3.13
9	03690	美团—W	47,600.00	12,690,085.36	3.06
10	01521	方达控股	1,842,000.00	12,644,703.72	3.05

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统

挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

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

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	34,794.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	2,265.60
4	应收利息	29,831.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,891.26

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

本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

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

项目	华泰紫金信息科技 主题6个月定开混合 发起A	华泰紫金信息科技 主题6个月定开混合 发起C
基金合同生效日基金份额总额	276,257,551.76	123,633,979.10
基金合同生效日起至报告期期末基	-	-

金总申购份额		
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	276,257,551.76	123,633,979.10

§ 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

项目	华泰紫金信息科技主题 6个月定开混合发起A	华泰紫金信息科技主题 6个月定开混合发起C
报告期期初管理人持有的 本基金份额	-	-
基金合同生效日起至报告 期期末买入/申购总份额	10,006,401.08	-
基金合同生效日起至报告 期期末卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的 本基金份额	10,006,401.08	-
报告期期末持有的本基金 份额占基金总份额比例 (%)	3.62	-

注：期末持有的基金份额占基金总份额比例为期末持有份额占基金同类份额的比例。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
-	认购	2021-04-21	10,006,401.08	10,006,401.08	-
合计			10,006,401.08	10,006,401.08	

注：适用费率为 1000 元/笔。

§ 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	10,006,4 01.08	2.50%	10,000,0 00.00	2.50%	3 年
基金管理人高级管理 人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	299,653. 93	0.07%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,306,0 55.01	2.58%	10,000,0 00.00	2.50%	3 年

注：占基金总份额比例为持有基金份额与各类基金份额合计数的比例。

§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

本基金本报告期内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

无本基金管理人根据监管规定要求于 2021 年 6 月 30 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《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》，自 2021 年 6 月 30 日起，席晓峰先生因个人原因辞职，不再担任公司副总经理职务。

§ 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、《华泰紫金信息科技主题 6 个月定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金信息科技主题 6 个月定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《华泰紫金信息科技主题 6 个月定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明

书》;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、关于申请募集注册华泰紫金信息科技主题 6 个月定期开放混合型发起式证券投资基金之法律意见书;

8、产品资料概要;

9、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

二〇二一年七月二十一日