

# 华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金

## 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年十月二十六日

## § 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 华泰紫金智能量化股票发起   |
| 基金主代码      | 005502   |
| 交易代码       | 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   |
| 报告期末基金份额总额 | 95,283,577.65 份  |
| 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       | 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。 |
| 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。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。  |
| 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   |

### § 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 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日) |
| 1.本期已实现收益      | 3,591,727.30                     |
| 2.本期利润         | -5,403,877.49                    |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0375                          |
| 4.期末基金资产净值     | 137,781,107.79                   |
| 5.期末基金份额净值     | 1.4460                           |

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 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      | -2.38% | 1.22%     | -3.76%     | 0.99%         | 1.38%  | 0.23% |
| 过去六个月      | 3.29%  | 1.05%     | 0.40%      | 0.90%         | 2.89%  | 0.15% |
| 过去一年       | 15.24% | 1.26%     | 7.69%      | 1.02%         | 7.55%  | 0.24% |
| 过去三年       | 64.39% | 1.33%     | 40.58%     | 1.21%         | 23.81% | 0.12% |
| 自基金合同生效起至今 | 44.60% | 1.25%     | 15.19%     | 1.20%         | 29.41% | 0.05% |

#### 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

华泰紫金智能量化股票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  
(2018 年 2 月 1 日至 2021 年 9 月 30 日)



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

2、本基金合同于 2018 年 2 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 |        |   |
| 毛甜 | 本基金的基金经理 | 2018-03-10  | -    | 11     | 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 月起陆续担任华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金、华泰紫金中证细分食品饮料产业主题指数型发起式证券投资基金等基金的基金经理。 |

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

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 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 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

三季度市场走势分化，7月、8月份受全面降准影响叠加中报高景气板块的催化，科技股、周期股大涨，市场风格成长相对价值占优，消费、医药等板块情绪则受政策面影响因素压制，9月份限产冲击及信用风险担忧令市场风险偏好维持低位，市场风格出现切换，前期强势板块回调，公用事业、食品饮料、农业等防御避险板块表现出相对优势。截至本报告期末，上证综指下跌0.64%，深证成份指数下跌5.62%，沪深300指数下跌6.85%，中证800指数下跌4.36%。在操作上，本基金利用量化模型精选个股，辅以量化行业轮动及事件驱动策略，严格遵守基金合同，在有公用事业、食品饮料、农业等防御避险板块表现出相对优势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。

#### 4.5 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-2.38%，同期业绩比较基准收益率为-3.76%。

#### 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   | 130,141,475.03 | 93.74        |
|    | 其中：股票  | 130,141,475.03 | 93.74        |
| 2  | 固定收益投资 | 6,436,407.60   | 4.64         |
|    | 其中：债券  | 6,436,407.60   | 4.64         |
|    | 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      | 2,010,355.95   | 1.45   |
| 7 | 其他各项资产            | 249,390.54     | 0.18   |
| 8 | 合计                | 138,837,629.12 | 100.00 |

注：1、本基金本报告期末未持有港股通股票。

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         | 994,428.52    | 0.72         |
| B  | 采矿业              | 3,023,214.00  | 2.19         |
| C  | 制造业              | 73,174,585.35 | 53.11        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,120,720.00  | 2.26         |
| E  | 建筑业              | 2,382,169.39  | 1.73         |
| F  | 批发和零售业           | 370,832.12    | 0.27         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 3,372,457.20  | 2.45         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 71,520.12     | 0.05         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,636,988.67  | 2.64         |
| J  | 金融业              | 30,198,579.98 | 21.92        |
| K  | 房地产业             | 2,515,573.00  | 1.83         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 1,984,204.00  | 1.44         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 3,180,038.08  | 2.31         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 38,613.78     | 0.03         |



|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -              | -     |
| P | 教育            | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | 1,689,453.60   | 1.23  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 388,097.22     | 0.28  |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 130,141,475.03 | 94.46 |

## 5.2.2 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 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  | 600519 | 贵州茅台 | 2,800.00   | 5,124,000.00 | 3.72         |
| 2  | 000858 | 五粮液  | 18,835.00  | 4,132,210.65 | 3.00         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 71,800.00  | 3,622,310.00 | 2.63         |
| 4  | 601838 | 成都银行 | 212,700.00 | 2,522,622.00 | 1.83         |
| 5  | 002142 | 宁波银行 | 70,275.00  | 2,470,166.25 | 1.79         |
| 6  | 601012 | 隆基股份 | 27,218.00  | 2,244,940.64 | 1.63         |
| 7  | 000333 | 美的集团 | 31,700.00  | 2,206,320.00 | 1.60         |
| 8  | 300059 | 东方财富 | 63,840.00  | 2,194,180.80 | 1.59         |
| 9  | 603259 | 药明康德 | 13,200.00  | 2,016,960.00 | 1.46         |
| 10 | 000001 | 平安银行 | 93,700.00  | 1,680,041.00 | 1.22         |

### 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

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券 | 6,397,960.90 | 4.64         |
| 2  | 央行票据 | -            | -            |
| 3  | 金融债券 | -            | -            |

|    |           |              |      |
|----|-----------|--------------|------|
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -    |
| 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） | 38,446.70    | 0.03 |
| 8  | 同业存单      | -            | -    |
| 9  | 其他        | -            | -    |
| 10 | 合计        | 6,436,407.60 | 4.67 |

#### 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

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量(张)     | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 019628 | 20 国债 02 | 39,970.00 | 3,995,800.90 | 2.90         |
| 2  | 019654 | 21 国债 06 | 20,000.00 | 2,001,800.00 | 1.45         |
| 3  | 019645 | 20 国债 15 | 4,000.00  | 400,360.00   | 0.29         |
| 4  | 110059 | 浦发转债     | 370.00    | 38,446.70    | 0.03         |

#### 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

| 代码                | 名称 | 持仓量  | 合约市值(元) | 公允价值变动(元) | 风险说明      |
|-------------------|----|------|---------|-----------|-----------|
| -                 | -  | 0.00 | 0.00    | -         | -         |
| 公允价值变动总额合计(元)     |    |      |         |           | -         |
| 股指期货投资本期收益(元)     |    |      |         |           | 2,440.00  |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) |    |      |         |           | -4,320.00 |

注：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

本基金的股指期货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,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对现货和期货市场运行趋势的研究,合理确定股指期货投资工具的比例,在充分评估股指期货风险和收益的基础上,谨慎地进行投资,力争获得稳定的正向超额收益。

### 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,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

#### 5.11.3 其他各项资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 71,020.27 |
| 2  | 应收证券清算款 | 90,782.37 |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 87,290.58 |
| 5  | 应收申购款   | 297.32    |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |

|   |    |            |
|---|----|------------|
| 8 | 其他 | -          |
| 9 | 合计 | 249,390.54 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值(元)   | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|--------------|
| 1  | 110059 | 浦发转债 | 38,446.70 | 0.03         |

#### 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

|               |                |
|---------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额  | 168,869,879.26 |
| 本报告期基金总申购份额   | 216,376.81     |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 73,802,678.42  |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -              |
| 本报告期期末基金份额总额  | 95,283,577.65  |

## § 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         | 10,000,900.09 |
| 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         | 10,000,900.09 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 10.50         |

## 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<br>额总数        | 持有份额<br>占基金总<br>份额比例 | 发起份<br>额总数        | 发起份额占<br>基金总份<br>额比例 | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|-----------------|-------------------|----------------------|-------------------|----------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金       | 10,000,9<br>00.09 | 10.50%               | 10,000,0<br>00.00 | 10.49%               | 3 年            |
| 基金管理人高级管理<br>人员 | -                 | -                    | -                 | -                    | -              |
| 基金经理等人员         | -                 | -                    | -                 | -                    | -              |
| 基金管理人股东         | -                 | -                    | -                 | -                    | -              |
| 其他              | -                 | -                    | -                 | -                    | -              |
| 合计              | 10,000,9<br>00.09 | 10.50%               | 10,000,0<br>00.00 | 10.49%               | 3 年            |

注：持有份额总数部分包含利息结转的份额。

### §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

| 投资者<br>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<br>比例达到或者<br>超过 20%的时<br>间区间 | 期初<br>份额              | 申购份<br>额 | 赎回<br>份额              | 持有份额              | 份额占比   |
| 机构  | 1              | 2021-07-01 至<br>2021-09-30          | 64,70<br>3,332.<br>25 | 0.00     | 0.00                  | 64,703,332.<br>25 | 67.91% |
|   | 2              | 2021-07-01 至<br>2021-09-14          | 58,93<br>4,789.<br>32 | 0.00     | 58,93<br>4,789.<br>32 | 0.00              | 0.00%  |
| 产品特有风险  |                |                                     |                       |          |                       |                   |        |
| 1、本基金单一机构投资者所持有的基金份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响；<br>2、大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；<br>3、因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出 |                |                                     |                       |          |                       |                   |        |

现较大波动；

4、单一投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

5、发起式基金在成立三年后继续存续的，单一机构投资者赎回后，若本基金连续60个工作日基金份额持有人低于200人或基金资产净值低于5000万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；

6、大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

7、大额赎回导致基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人根据监管规定要求于 2021 年 7 月 5 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《关于调整华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金管理费率并修改基金合同等事项的公告》，自 2021 年 7 月 5 日起，将管理费率降低至 1.2%/年，并相应修改《基金合同》和其他法律文件。

2、本基金管理人根据监管规定要求于 2021 年 8 月 31 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 8 月 31 日起，王锦海先生因个人原因辞职，不再担任公司总经理职务。

3、本基金管理人根据监管规定要求于 2021 年 9 月 17 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 9 月 17 日起，聂挺进先生新任本基金管理人总经理。

## § 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、《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《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》；
- 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智能量化股票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  
二〇二一年十月二十六日