

2019-06-30

基金管理人：华泰证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2019-07-17

重要提示

基金管理人承诺严格遵守法律法规... 基金托管人承诺严格遵守法律法规... 基金管理人承诺严格遵守法律法规...

基金基本情况

Table with columns: 项目 (Item), 华泰紫金智惠定期债券 (Hua Tai Jin Zhi Hui Ding Qi Bao Zhuan), 数量 (Quantity)

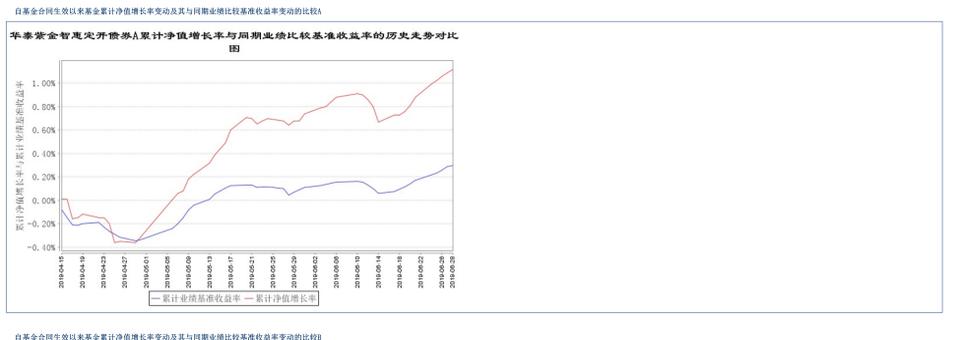
主要财务指标

Table with columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators), 本基金(元) (This Fund in Yuan), 华泰紫金智惠定期债券(元) (Hua Tai Jin Zhi Hui Ding Qi Bao Zhuan in Yuan), 华泰紫金智惠定期债券C(元) (Hua Tai Jin Zhi Hui Ding Qi Bao Zhuan C in Yuan)

基金净值表现

Table with columns: 阶段 (Period), 净值增长率① (Net Value Growth Rate 1), 净值增长率标准差② (Net Value Growth Rate Standard Deviation 2), 业绩比较基准收益率③ (Performance Benchmark Yield Rate 3), 业绩比较基准收益率标准差④ (Performance Benchmark Yield Rate Standard Deviation 4), ①-③ (1-3), ②-④ (2-4)

华泰紫金智惠定期债券A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



华泰紫金智惠定期债券B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



其他指标

Table with columns: 其他指标 (Other Indicators), 报告期 (Reporting Period), 报告日期 (Reporting Date)

基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理日期 (Date of Appointment as Fund Manager), 证券从业年限 (Years of Securities Industry Experience), 说明 (Remarks)

管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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... 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约定。

公平交易说明

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指导意见》... 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指导意见》...

报告期内基金的投资策略和运作分析

1. 宏观经济分析: 2019年上半年, 全球宏观经济继续放缓... 2. 市场情绪: 一季度债券市场先跌后涨... 3. 资产配置: 二季度债券市场总体保持平稳...

报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值收益率为1.14%, 同期业绩比较基准收益率为3.00%... 本报告期本基金净值收益率为1.14%, 同期业绩比较基准收益率为3.00%...

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

1. 本基金报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二十人的情形... 2. 本基金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。

投资组合报告

Table with columns: 序号 (Serial Number), 项目 (Item), 金额(元) (Amount in Yuan), 占基金总资产的比例(%) (Percentage of Total Assets)

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号 (Serial Number), 行业类别 (Industry Category), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value)

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

Table with columns: 序号 (Serial Number), 股票代码 (Stock Code), 股票名称 (Stock Name), 数量(股) (Quantity in Shares), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value)

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债券投资明细

Table with columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量(张) (Quantity in Tens of Thousands), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value)

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明细

Table with columns: 序号 (Serial Number), 证券代码 (Securities Code), 证券名称 (Securities Name), 数量(份) (Quantity in Shares), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value)

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

Table with columns: 序号 (Serial Number), 贵金属代码 (Precious Metals Code), 贵金属名称 (Precious Metals Name), 数量(份) (Quantity in Shares), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value)

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

Table with columns: 序号 (Serial Number), 权证代码 (Warrant Code), 权证名称 (Warrant Name), 数量(份) (Quantity in Shares), 公允价值(元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例(%) (Percentage of Net Asset Value)

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量(买/卖) (Position (Buy/Sell)), 合约月份(C) (Contract Month), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in Yuan), 风险指标说明 (Risk Indicator Description)

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量(买/卖) (Position (Buy/Sell)), 合约月份(C) (Contract Month), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in Yuan), 风险指标说明 (Risk Indicator Description)

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量(买/卖) (Position (Buy/Sell)), 合约月份(C) (Contract Month), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in Yuan), 风险指标说明 (Risk Indicator Description)

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。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

Table with columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量(买/卖) (Position (Buy/Sell)), 合约月份(C) (Contract Month), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in Yuan), 风险指标说明 (Risk Indicator Description)

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。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况: 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。

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

本基金本报告期末未持有股票。

其他资产构成

Table with columns: 序号 (Serial Number), 存出保证金 (Outstanding Margin), 应收证券清算款 (Receivable Securities Settlement), 应收股利 (Receivable Dividend), 其他应收款 (Other Receivables), 其他 (Other), 合计 (Total)

报告期末持有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。

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。

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项存在尾差。

开放式基金份额变动

Table with columns: 项目 (Item), 华泰紫金智惠定期债券 (Hua Tai Jin Zhi Hui Ding Qi Bao Zhuan), 华泰紫金智惠定期债券A (Hua Tai Jin Zhi Hui Ding Qi Bao Zhuan A), 华泰紫金智惠定期债券B (Hua Tai Jin Zhi Hui Ding Qi Bao Zhuan B), 华泰紫金智惠定期债券C (Hua Tai Jin Zhi Hui Ding Qi Bao Zhuan C)

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with columns: 基金管理人持有本基金份额变动情况 (Fund Manager's Shareholding Change), 华泰紫金智惠定期债券 (Hua Tai Jin Zhi Hui Ding Qi Bao Zhuan), 华泰紫金智惠定期债券A (Hua Tai Jin Zhi Hui Ding Qi Bao Zhuan A), 华泰紫金智惠定期债券B (Hua Tai Jin Zhi Hui Ding Qi Bao Zhuan B), 华泰紫金智惠定期债券C (Hua Tai Jin Zhi Hui Ding Qi Bao Zhuan C)

基金管理人运用固有资金投资本基金明细

Table with columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Method), 交易日期 (Transaction Date), 交易数量(份) (Transaction Quantity), 交易金额(元) (Transaction Amount), 适用费率 (Applicable Rate)

报告期末按次次基金发起资金持有基金份额情况

Table with columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Shares Held), 持有份额占基金份额比例 (Percentage of Total Shares Held), 发起份额数 (Initiated Shares), 发起份额占基金份额比例 (Percentage of Total Shares Held), 发起份额承诺持有期限 (Initiated Shares Commitment Holding Period)

报告期内前十名持有人持有基金份额超过20%的情况

Table with columns: 投资者类别 (Investor Category), 序号 (Serial Number), 持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间 (Time Interval of Holding Share Proportion Reaching or Exceeding 20%), 期初份额 (Beginning Shares), 申购份额 (Subscription Shares), 赎回份额 (Redemption Shares), 持有份额 (Holding Shares), 份额占比 (Share Proportion)

1. 本基金单一机构投资者持有的基金份额占比较大, 单一机构投资者的大额申购, 可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响... 2. 本基金本报告期末未持有股指期货。

影响投资决策的其他重要信息

- 1. 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及变更的公告》... 2. 根据本基金管理人于2019年5月10日刊登的《华泰证券(上海)资产管理有限公司关于华泰紫金智惠定期开放债券型证券投资基金的公告》...

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. 《华泰紫金智惠定期开放债券型证券投资基金合同》; 3. 《华泰紫金智惠定期开放债券型证券投资基金托管协议》; 4. 《华泰紫金智惠定期开放债券型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牌照、营业执照; 7. 中国证监会规定的法律法规。

存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人、基金托管人办公场所。

查询方式

部分查询文件可通过本基金管理人、基金托管人、客服电话(400885557)、公司网址: https://htac.btcac.com.cn/。