华泰紫金智胜势型证券投资基金2019年第2季度报告

2019-07-15

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

华泰证券(上海)资产管理有限公司的董事会、董事及其高级管理人员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，并对报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

华泰证券(上海)资产管理有限公司的董事会、董事及其高级管理人员承诺以诚实信用、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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2019年01月02日至2019年06月30日。

基金基本情况

项目	概况
基金名称	华泰紫金智胜势型证券投资基金
基金简称	华泰紫金智胜势
基金主代码	005407
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018-02-14
报告期末基金份额总额	2,504,459,717.11
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争获得长期稳定的绝对收益。
投资策略	基金主要通过股票投资策略、股指期货策略、国债期货策略、股票期权策略、资产管理计划投资策略、融券投资策略等策略进行多策略灵活配置。
业绩比较基准	中债国债总指数收益率
风险收益特征	基金为证券投资基金，属中等偏高风险和较高收益的品种，长期来看，预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。
基金管理人	华泰证券(上海)资产管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属两级基金的基金简称	华泰紫金智胜势A	华泰紫金智胜势C
下属两级基金的交易代码	005407	005408
报告期末下属两级基金的份额总额	1,945,989,555.72	558,469,161.39

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	主要业绩	华泰紫金智胜势A(人民币)	华泰紫金智胜势C(人民币)
		2019-04-01 - 2019-06-30	2019-04-01 - 2019-06-30
本期已实现收益		22,195,496.92	4,119,480.40
本期利润		19,709,671.32	1,617,108.50
加权平均基金份额本期利润		0.0112	0.0125
期末基金资产净值		2,189,143,941.90	576,909,326.72
期末基金份额净值		1.1248	1.0328

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的相关费用（例如：申购费或赎回费等等）。计入费用后实际基金业绩将会低于上述业绩指标。

2、本期已实现收益指本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）扣除本期费用后的余额。本期末数为本期末最后一个交易日数据。

基金净值表现

本期分类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	1.21 %	0.02 %	0.11 %	0.03 %	1.10 %	-0.01 %