

重要提示

基金管理人承诺基金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2019年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表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预示其未来表现，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。本报告中期财务数据未经审计。本报告自2019年4月11日起至6月30日止。

基金基本情况

项目	数值
基金简称	华泰紫金智能量化股票发起
场内简称	
基金主代码	805502
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2018-02-01
报告期末基金份额总额	115,688,718.27
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，力争获取超越基准比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	管理人先根据宏观分析和市场判断确定大类资产的配置，然后充分运用量化模型，先筛选出行业数据进行二次加工、计算，建立各个行业的分析逻辑，再经过模型拟合，建立起因子分析框架，最后根据数据生成因子，通过因子拟合趋势，进行回测和验证，从而挖掘出不同行业的敏感因子，提取合成不同行业的量化指标，结合管理人线下的研究进行行业配置和个股选择，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，是证券投资基金中的高风险预期风险和高风险收益的产品。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

主要财务指标

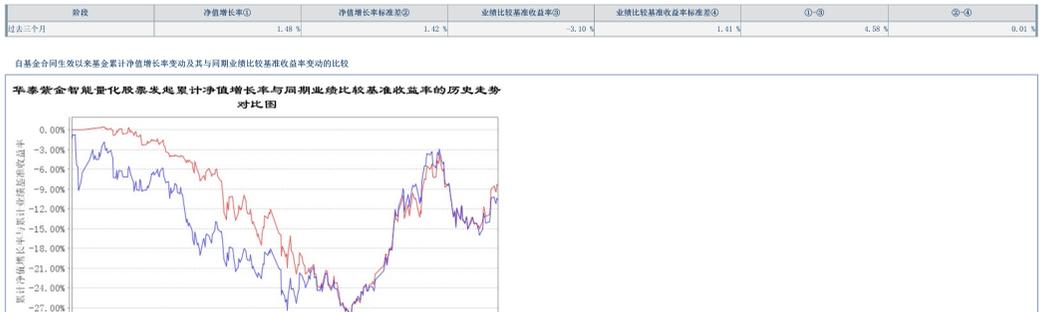
主要财务指标	报告期(2019-04-01至2019-06-30)	单位:人民币元
本期已实现收益	5,292,669.94	
本期利润	1,568,918.73	
加权平均基金份额本期利润	0.0134	
期末基金资产净值	106,005,191.42	
期末基金份额净值	0.9163	

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。

基金净值表现

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	1.48%	1.42%	-3.10%	1.41%	4.58%	0.01%

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发起式基金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



注: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。

其他指标

其他指标	报告期(2019-04-01至2019-06-30)	单位:人民币元
其他指标	报告期(2019-06-30)	

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		
张志勇	本基金的基金经理、基金量化部负责人	2018-02-01	-	13	张志勇先生,英国文学文学博士,曾任华泰证券(上海)资产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经理,上海矿泽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,2018年11月27日至2018年11月27日任国投瑞银和沪深300指数分级证券投资基金基金经理,2017年12月起担任华泰紫金中证红利波动指数发起式证券投资基金基金经理,2018年2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。
毛蔚	本基金的基金经理	2018-03-10	-	8	毛蔚女士,武汉大学金融工程硕士,2010年至2012年曾任国信证券研究所金融工程助理分析师;2012年至2017年任光大证券股份有限公司,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波动指数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。

注:1、上述基金经理的任职日期及离任日期均以公司公告为准;首任基金经理的任职日期为基金合同的生效日期。
2、证券从业年限的计算标准为证券行业的工作经历年限。

管理人对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、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,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约定。

公平交易专项说明

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制度指导意见》建立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投资组合,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、流程和系统手段保证公平交易原则的实现,通过建立多层级的公司股票池和债券库,完善各类资产管理业务组织结构,规范各业务之间的关系,在保证投资组合具有相对独立性的同时,确保其在获得投资信息、投资建议和决策等方面享有公平的机会,通过对异常交易的监控、分析和评估,及时纠正和反馈异常交易行为,确保公平交易制度的有效执行。
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、法规和合同约定执行投资交易,报告期内未发现违反法律法规公平交易的行为。

异常交易行为的专项说明
报告期内未发现本基金存在异常交易行为。
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%。

报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度初大盘冲高回落,宏观调整预期,回归基本面验证,随后在基本面不及预期以及中美贸易摩擦升级的影响下继续震荡回调,截至本报告期末,上证综指下跌3.62%,深证成指下跌7.33%,沪深300指数下跌1.21%,中证800指数下跌3.60%。在操作上,本基金利用量化模型选股,辅以量化风控择时策略,严格控制仓位,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。

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1.48%,同期业绩比较基准收益率为-3.10%。

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量不满二百人的情形。
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

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	权益类投资	96,440,017.30	90.60
	其中:股票	96,440,017.30	90.60
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	9,971,998.48	9.37
7	其他资产	28,937.34	0.03
8	合计	106,440,953.12	100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	351,480.00	0.33
B	采矿业	5,882,285.00	5.55
C	制造业	34,654,710.52	32.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,573,189.00	3.37
E	建筑业	7,587,678.00	7.13
F	批发和零售业	968,827.25	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	4,604,216.00	4.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,810,670.45	2.37
J	金融业	30,342,216.13	28.62
K	房地产业	5,060,225.00	4.77
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	925,680.00	0.87
S	综合	-	-
	合计	96,440,017.30	90.98

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	800651	格力电器	69,200	3,806,000.00	3.59
2	601318	中国平安	40,600	3,597,566.00	3.39
3	800858	五粮液	30,200	3,562,090.00	3.36
4	800837	海通证券	217,300	3,083,487.00	2.91
5	800030	中信证券	119,300	2,810,533.00	2.68
6	800036	招商银行	78,000	2,806,440.00	2.65
7	800887	伊利股份	83,700	2,796,417.00	2.64
8	601186	中国铁建	280,400	2,789,880.00	2.63
9	800909	上海机场	31,600	2,664,204.00	2.51
10	800001	平安银行	189,400	2,608,932.00	2.46

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	-	-
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

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(%)

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

序号	资产支持证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

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。

申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
本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

其他资产构成
单位:人民币元

序号	名称	金额(元)	单位
1	存出保证金	26,294.91	
2	应收证券清算款	-	
3	应收股利	-	
4	应收利息	2,015.09	
5	应收申购款	593.34	
6	其他应收款	-	
7	待摊费用	-	
8	预付款	-	
9	合计	28,937.34	

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注: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
注:本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的情况。

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之和与合计可能存在尾差。

开放式基金份额变动

项目	数量	单位:份
报告期初基金份额总额	120,987,433.18	
报告期内基金份额总额	676,663.47	
减:报告期内基金份额总额	5,975,378.38	
报告期内基金份额变动(份额减少以“-”填列)	-	
报告期末基金份额总额	115,688,718.27	

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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	10,000,900.09	8.64%	10,000,000.00	8.64%	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金基金经理人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,900.09	8.64%	10,000,000.00	8.64%	3年

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

投资者类别	序号	报告期内持有基金份额变化情况			报告期末持有基金份额情况	
		持有基金份额比例达到或超过20%的区间	期初份额	申购份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-

注: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。

影响投资者决策的其他重要信息

根据本基金管理人于2019年5月6日在《证券时报》等报刊以及本公司网站刊登的《华泰证券(上海)资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,自2019年5月6日起,刘玉生先生新任公司督察长,首席风险官、合规总监;廖晓峰先生不再担任本公司督察长、首席风险官、合规总监,转任本公司副总经理。

备查文件目录

- 中国证监会准予本基金募集注册的文件;
- 《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金合同》;
- 《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金托管协议》;
- 《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》;
- 报告期内披露的各项公告;
- 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 中国证监会规定的其备查文件。

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。

查阅方式

投资者在本基金管理人网站查阅,也可向本基金管理人、客服热线(400888599)、公司网站:https://htsc.htsc.com.cn/。