

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、净值数据和投资组合报告等内容。

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。

本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

基金基本情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数值 (Value). Includes fields like 基金简称, 场内简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征, 基金管理人, 基金托管人.

主要财务指标

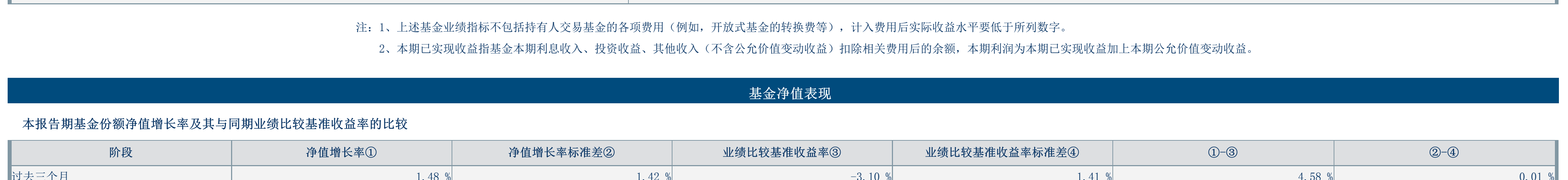
Table with 2 columns: 主要财务指标 (Main Financial Indicators) and 报告期 (2019-04-01 to 2019-06-30). Includes 本期已实现收益, 本期利润, 加权平均基金份额本期利润, 期末基金资产净值, 期末基金份额净值.

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。

基金净值表现

Table with 7 columns: 阶段 (Period), 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. Includes 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较, 过去三个月.

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11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

Table with 2 columns: 其他指标 (Other Indicators) and 报告期 (2019-04-01 to 2019-06-30). Includes 其他指标.

基金经理（或基金经理小组）简介

Table with 5 columns: 姓名 (Name), 职务 (Position), 任本基金的基金经理期限 (Tenure), 证券从业年限 (Securities Industry Experience), 说明 (Remarks). Lists 魏志勇 and 毛蔚.

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。

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。

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，兑现调整预期，回归基本面验证。随后在基本面数据不及预期以及中美贸易摩擦再度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%。

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-2.10%。

报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

1. 本基金本报告期末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. 本基金本报告期末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

Table with 4 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). Lists 权益类投资, 固定收益投资, 贵金属投资, 金融衍生品投资, 买入返售金融资产, 银行存款和结算备付金合计, 其他资产, 合计.

报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 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 Assets). Lists 农林牧渔, 采矿业, 制造业, 电力、热力、燃气及水生产和供应业, 建筑业, 批发和零售业, 交通运输、仓储和邮政业, 信息传输、软件和信息技术服务业, 金融业, 房地产业, 医药和商务服务业, 科学研究和技术服务业, 水利、环境和公共设施服务业, 居民服务、修理和其他服务业, 教育, 卫生和社会工作, 文化、体育和娱乐业, 综合, 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十名股票投资明细

Table with 5 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 Assets). Lists 格力电器, 中国平安, 五粮液, 海通证券, 中信证券, 招商银行, 伊利股份, 中国铁建, 上海机场, 平安银行.

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券品种 (Bond Type), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets). Lists 国债债券, 央行票据, 金融债券, 企业债券, 公司债券, 中期票据, 可转债(可交换债), 同业存单, 其他, 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

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 债券代码 (Bond Code), 债券名称 (Bond Name), 数量 (张) (Quantity in Tens of Thousand), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets). Lists 国债债券, 央行票据, 金融债券, 企业债券, 公司债券, 中期票据, 可转债(可交换债), 同业存单, 其他, 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十名资产支持证券投资明细

Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 资产名称 (Asset Name), 数量 (份) (Quantity in Units), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets). Lists 资产支持证券.

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 4 columns: 序号 (Serial Number), 贵金属代码 (Precious Metal Code), 贵金属名称 (Precious Metal Name), 数量 (份) (Quantity in Units), 公允价值 (元) (Fair Value in Yuan), 占基金资产净值比例 (%) (Percentage of Net Assets). Lists 贵金属.

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

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

Table with 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值(元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement). Lists 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

Table with 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值(元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement). Lists 国债期货.

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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交易情况说明

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 5 columns: 代码 (Code), 名称 (Name), 持仓量 (买/卖) (Position), 合约市值(元) (Contract Value in Yuan), 公允价值变动(元) (Fair Value Change in Yuan), 风险说明 (Risk Statement). Lists 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
Table with 4 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额 (元) (Amount in Yuan), 单位 (Unit). Lists 存出保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 应收利息, 应收申购款, 其他应收款, 待摊费用, 其他, 合计.

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

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 数量 (Quantity). Lists 报告期初基金份额总额, 报告期间基金总申购份额, 减：报告期间基金总赎回份额, 报告期间基金净申购份额(申购减少以“-”填列), 报告期末基金份额总额.

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

Table with 2 columns: 项目 (Item) and 基金份额 (Share Amount). Lists 报告期末基金管理人持有的基金份额, 报告期间买入/申购总份额, 报告期间卖出/赎回总份额, 报告期末基金管理人持有的基金份额, 报告期末持有的本基金基金份额占基金总份额比例(%).

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

Table with 6 columns: 序号 (Serial Number), 交易方式 (Transaction Method), 交易日期 (Transaction Date), 交易份额 (份) (Share Amount), 交易金额 (元) (Transaction Amount in Yuan), 适用费率 (Applicable Rate).

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

Table with 6 columns: 项目 (Item), 持有份额总数 (Total Share Amount), 持有份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Share Amount), 发起份额总数 (Total Issued Share Amount), 发起份额占基金总份额比例 (Percentage of Total Issued Share Amount), 发起份额承诺持有期限 (Commitment Holding Period).

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

Table with 6 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), 期初份额 (Initial Share Amount), 申购份额 (Purchase Share Amount), 赎回份额 (Redemption Share Amount), 持有份额 (Share Amount), 报告期末持有基金份额占报告期末持有基金份额比例 (Percentage of Total Share Amount at the End of the Report).

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

- 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. 报告期内披露的各项公告；
6. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
7. 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://htac.htsc.com.cn/。