

华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金  
2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：华泰保兴基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年八月二十九日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
7.6 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.....	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	49
7.8 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贵金属投资明细.....	50
7.9 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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	52
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	52
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>57</b>

---

11.1 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 .....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	华泰保兴吉年利
基金主代码	006642
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 12 月 25 日
基金管理人	华泰保兴基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	299,738,110.75 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过对股票、固定收益证券和现金等大类资产适度配置，灵活运用多种投资策略，把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。封闭期投资策略主要包括大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略；开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减少基金净值的波动。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*70%+中债总指数（全价）收益率*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华泰保兴基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	尤小刚
	联系电话	021-80299000
	电子邮箱	fund_xxpl@ehuatai.com
客户服务电话	400-632-9090	95566
传真	021-60963566	010-66594942
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号 4306 室	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号金茂大厦 4306 室	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	杨平	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.chuataifund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰保兴基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号金茂大厦 4306 室

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	28,065,003.56
本期利润	31,038,044.84
加权平均基金份额本期利润	0.1204
本期加权平均净值利润率	11.29%
本期基金份额净值增长率	13.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	3,201,562.75
期末可供分配基金份额利润	0.0107
期末基金资产净值	304,458,521.85
期末基金份额净值	1.0157
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	12.51%

注：1、本基金合同生效日为 2018 年 12 月 25 日，截止报告期末基金合同生效未满一年。

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、期末可供分配利润是指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、所述基金业绩指标不包括持有人认购、申购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	1.30%	1.34%	3.92%	0.80%	-2.62%	0.54%
过去三个月	-4.29%	1.68%	-0.85%	1.06%	-3.44%	0.62%
过去六个月	13.56%	1.68%	18.50%	1.08%	-4.94%	0.60%
自基金合同生效起至今	12.51%	1.65%	17.95%	1.06%	-5.44%	0.59%

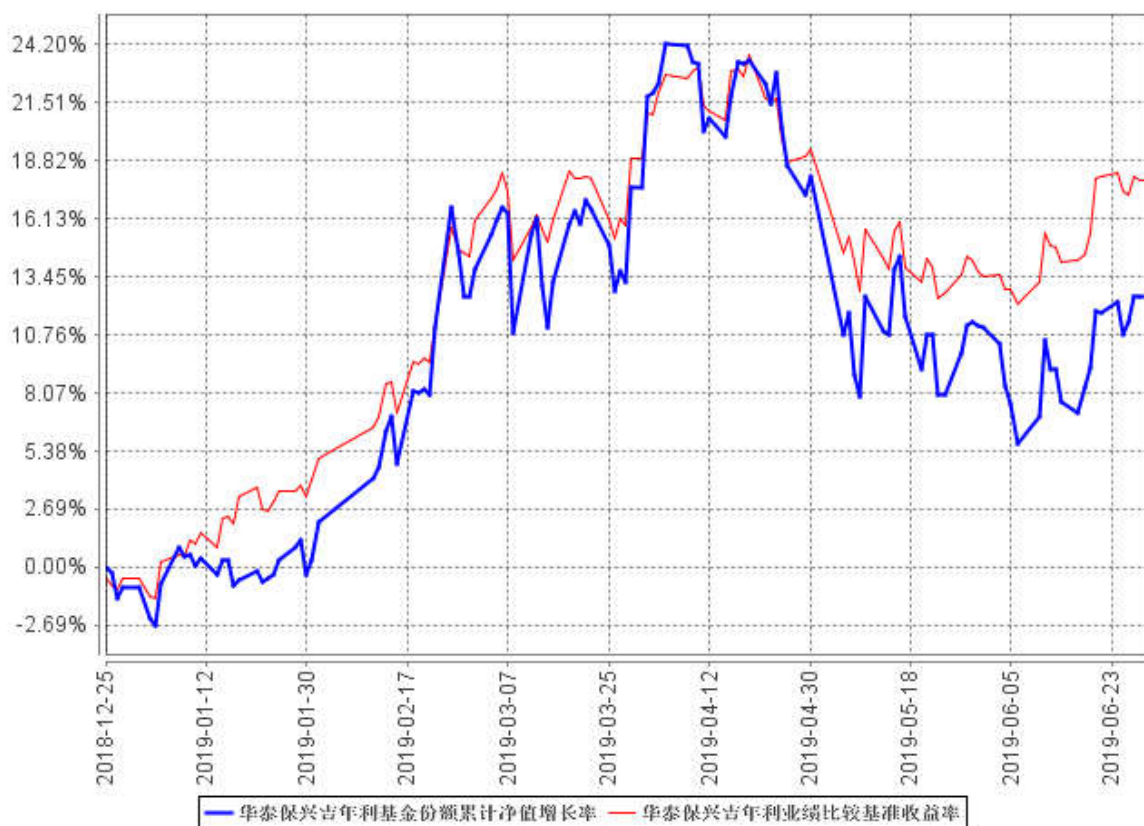
注：1、本基金合同生效日为 2018 年 12 月 25 日，截止报告期末基金合同生效未满一年。



2、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*70%+中债总指数（全价）收益率\*30%。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

华泰保兴吉年利基金份额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：1、本基金基金合同于 2018 年 12 月 25 日生效，截止报告期末基金合同生效未满一年。

2、截至报告期末，本基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰保兴基金管理有限公司，经中国证监会证监许可[2016]1309 号文核准，于 2016 年 7 月 26 日成立，注册资本为人民币 1.8 亿元。公司股东分别为华泰保险集团股份有限公司（下称“华泰保险集团”）、上海飞恒资产管理中心（有限合伙）（下称“飞恒资产”）、上海旷正资产管理中心（有限合伙）（下称“旷正资产”）、上海泰颐资产管理中心（有限合伙）（下称“泰颐资产”）、上海哲昌资产管理中心（有限合伙）（下称“哲昌资产”）、上海志庄资产管理中心（有限合伙）（下称“志庄资产”），其中，华泰保险集团持股比例为 80%，飞恒资产、旷正资产、泰颐资产、哲昌资产、志庄资产均为公司高级管理人员及核心业务骨干股权激励持股平台，合计持股比例为 20%。

截至 2019 年 6 月 30 日，公司公募基金产品资产管理规模为 142.20 亿元。公司共管理十四只公募基金产品，具体包括华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金、华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金、华泰保兴货币市场基金、华泰保兴尊合债券型证券投资基金、华泰保兴策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、华泰保兴尊信定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、华泰保兴成长优选混合型证券投资基金、华泰保兴尊利债券型证券投资基金、华泰保兴尊颐定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰保兴研究智选灵活配置混合型证券投资基金、华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰保兴安盈三个月定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰保兴健康消费混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尚烁徽	基金经理	2018 年 12 月 25 日	-	9 年	上海交通大学硕士，CFA。历任华泰资产管理有限公司权益组合部研究员、投资经理、高级投资经理。在华泰资产管理有限公司任职期间，曾管理华泰人寿保险股份有限公司投连险产品、保险机构相对收益型委托账户、绝对收益型委托账户、组合类保险

					资产管理产品和企业年金计划等。2016 年 8 月加入华泰保兴基金管理有限公司。
--	--	--	--	--	--

## 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》及其他相关法律法规、规范性文件要求和本基金基金合同约定，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，基金运作无违法违规、未履行基金合同或其他损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司公平交易制度的执行情况主要包括：公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；建立统一的研究报告发布和信息共享平台，使各投资组合得到公平的投资研究服务；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行投资授权制度及授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度，以“时间优先、价格优先”为基本原则，结合投资交易系统内的公平交易模块，尽最大可能保证公平对待各投资组合；建立各投资组合投资信息严格管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对各投资组合投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

本报告期内，未发现各投资组合因非公平交易等导致的利益输送行为及其他违反公平交易制度的情况，公平交易制度的整体执行情况良好。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待不同的投资组合，公司制定《华泰保兴基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》对涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行了界定，并拟定相应的监控、识别、分析与防控措施；公司禁止同一交易日内同一投资组合内部、不同投资组合之间的反向交易以及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为。

公司对各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1 日、3 日、5 日）内的同向交易、反向交易的溢价金额与溢价率进行了 T 检验，未发现违反公平交易制度的异常交易行为。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年管理人对经济预期较差，配置了包括建筑在内的逆周期品种，同时缺配消费，从市场实际情况看，消费因其弱周期性及业绩确定性成为上半年涨幅最好的行业之一，而基建板块因利润弹性较差且长期空间较差成为涨幅最小的板块之一，因此本基金跑输基准。在半年度末，本基金对持仓进行了调整，布局了下半年及明年景气度有望持续提升的板块，包括农林牧渔、通信、电子、维生素等板块。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0157 元；本报告期基金份额净值增长率为 13.56%，业绩比较基准收益率为 18.50%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为宏观经济下半年仍然呈现较弱的态势。传统节奏上，从社融拐点到经济回升拐点有 3-4 个季度时间，包括 2009 年、2012 年、2015 年均体现出这样的规律。但那几次经济的拐点均伴随房地产上行周期，本届政府对地产的调控态度坚定，本轮全国性房地产上行周期难现，因此宏观经济因需求而产生的向上动力较弱，年底可能会迎来因库存端出清而产生的库存周期反弹的机会。

下半年货币政策空间较大，全球主要发达经济体均进入降息周期，我们认为下半年至明年人民币汇率和利率走势均有望较为缓和，且总体看，有利于权益资产。考虑到流动性的放松，实际利率的下降，我们认为指数下行空间比较有限，而上行则需要看到经济本身找到其下降平衡点的同时能有新的增长点推动经济持续的、良性的转型，总体我们判断下半年 A 股将更多呈现宽幅震荡向上的格局。因此下半年对整体权益资产将维持较高的配置水平。

行业方面，中国经济过去 20 年过多依赖于房地产的发展模式，对金融行业尤其银行的业绩拉动非常明显，但是也因为其不可持续的发展模式，对银行的估值有大幅的压低。从本轮经济调整的态势看，政府严控地产的决心较大，金融行业的估值体系有望迎来拐点。此外，从景气度的角度考虑，农林牧渔、通信、电子、维生素等子行业在未来几个季度也有望呈现持续向上的格局，成为弱势宏观中为数不多的景气行业。长期我们认为中国的医疗服务、消费服务也有非常好的前景，但短期估值较高，如果估值出现了一定的修复，我们也将积极参与这些板块的配置。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理、科学和一致性，保护基金份额持有人的合法权益，成立了估值委员会。估值委员会负责制订、评估和修订公司的估值管理办法，定期评估估值程序和估值技术，对估值技术进行最终决策，指导和监督整个估值流程。估值委员会委员由分管运营的副总经理、研究部、风险管理部、监察稽核部和运营保障部的指定人员担任。估值委员会委员在基金估值研究或运作方面具有丰富经验，熟悉相关法规、估值原则和估值技术，在估值工作中保持判断的专业性和客观性。

研究部负责对特殊投资品种估值进行分析研究，并就可能影响投资品种公允价值的重大事项进行监控和报告，对拟采用的估值方法进行初步判断，提出适用的估值模型和参数。风险管理部负责对特殊投资品种的估值方法和估值模型进行研究，通过实证分析等方法完善估值模型，验证研究部提供的估值模型参数并协助提供数据支持文件。监察稽核部检查、督促相关部门严格遵守法规和公司制度的规定，采用适当程序进行基金估值及调整；检查、督促相关部门及时进行信息披露；根据相关规定及估值委员会的决议对估值相关公告进行合规性审核。运营保障部根据相关法规和公司估值管理办法对基金进行估值；根据指定方法监控并汇报基金持有停牌股票的情况，根据公司估值委员会的决议进行估值并与托管人核对，与会计师事务所沟通；根据相关法规规定及时进行信息披露。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司/中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的固定收益品种/在证券交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金实施利润分配 1 次，分红方案为每 10 份基金份额发放现金红利 1.20 元，权益登记日及除息日：2019 年 4 月 22 日，现金红利发放日：2019 年 4 月 23 日。本基金的利润分配符合法律法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式基金，基金合同生效未满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条第一款的规定。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	81,137,532.04	20,479,738.16
结算备付金		1,671,561.19	-
存出保证金		262,908.14	-
交易性金融资产	6.4.7.2	184,513,244.53	154,397,478.80
其中：股票投资		183,363,505.93	154,397,478.80
基金投资		-	-
债券投资		1,149,738.60	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	40,000,000.00
应收证券清算款		38,802,241.17	2,641,628.22
应收利息	6.4.7.5	9,709.34	14,813.30
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		306,397,196.41	217,533,658.48
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	9,326,677.12
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		170,488.16	23,985.44
应付托管费		24,355.46	3,426.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,660,878.83	118,642.02

应交税费		8.58	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	82,943.53	1,241.94
负债合计		1,938,674.56	9,473,973.00
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	299,738,110.75	210,008,450.04
未分配利润	6.4.7.10	4,720,411.10	-1,948,764.56
所有者权益合计		304,458,521.85	208,059,685.48
负债和所有者权益总计		306,397,196.41	217,533,658.48

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0157 元，基金份额总额 299,738,110.75 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		35,433,974.94
1.利息收入		164,220.30
其中：存款利息收入	6.4.7.11	118,665.08
债券利息收入		2,009.93
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		43,545.29
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		32,296,713.36
其中：股票投资收益	6.4.7.12	29,482,221.84
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	936,874.81
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	1,877,616.71
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,973,041.28
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-
<b>减：二、费用</b>		4,395,930.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	949,896.28



2. 托管费	6.4.10.2.2	135,699.39
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	3,217,497.57
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		5.60
7. 其他费用	6.4.7.20	92,831.26
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>31,038,044.84</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>31,038,044.84</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	210,008,450.04	-1,948,764.56	208,059,685.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,038,044.84	31,038,044.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	89,729,660.71	11,469,393.29	101,199,054.00
其中：1.基金申购款	89,729,660.71	11,469,393.29	101,199,054.00
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-35,838,262.47	-35,838,262.47
五、期末所有者权益（基金净值）	299,738,110.75	4,720,411.10	304,458,521.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>王冠龙</u>	<u>王冠龙</u>	<u>王云凌</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]1718号《关于准予华泰保兴尊悦债券型证券投资基金变更注册的批复》核准,由华泰保兴基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集209,999,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第0785号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于2018年12月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为210,008,450.04份,其中认购资金利息折合基金份额9,450.04份。本基金的基金管理人为华泰保兴基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金为定期开放式基金。封闭期为自基金合同生效日(含)起或每一开放期结束之日次日(含)起3个月的期间,开放期为自每一封闭期结束之日后第一个工作日(含)起一至二十个工作日,具体时间由基金管理人在上一封闭期结束前公告说明。本基金封闭期内不办理申购、赎回或其他业务,也不上市交易。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,000,450.04基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券(含超短期融资券))、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他存款)、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*70%+中债总指数(全价)收益率\*30%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰保兴基金管理有限公司于2019年8月28日批准报出。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类

应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息

支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则

按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益默认以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大

宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的

通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	81,137,532.04
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-



合计	81,137,532.04
----	---------------

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	182,248,450.96	183,363,505.93	1,115,054.97
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,149,738.60	-6,261.40
	银行间市场	-	-
	合计	1,149,738.60	-6,261.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	183,404,450.96	184,513,244.53	1,108,793.57

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	8,424.17
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	752.20
应收债券利息	414.67
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

其他	118.30
合计	9,709.34

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,660,878.83
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,660,878.83

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付信息披露费	49,588.57
应付审计费	33,354.96
合计	82,943.53

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	210,008,450.04	210,008,450.04
本期申购	89,729,660.71	89,729,660.71
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	299,738,110.75	299,738,110.75

注：1.申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

2.本基金自 2018 年 12 月 19 日至 2018 年 12 月 20 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 209,999,000.00 元，折算为 209,999,000.00 份基金份额。根据《华泰保兴吉年利定期开放混合

型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 9,450.04 元在本基金成立后，折算为 9,450.04 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3.根据《华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》、《华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》及《华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告》的规定，本基金的第一个封闭期为 2018 年 12 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 3 月 24 日止，封闭期内不办理申购、赎回业务。本基金于 2019 年 3 月 25 日至 2019 年 3 月 26 日止进入开放期，接受投资人的申购、赎回申请。本基金后续每个封闭期为上一个开放期结束之日次日(含该日)起至 3 个月后对应日的前一日(含该日)，如该对应日不存在对应日期或为非工作日，则顺延至下一个工作日。本基金每个封闭期结束之日后第一个工作日(含该日)起进入下一个开放期。本基金每个开放期的期限原则上为一至二十个工作日。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-84,516.85	-1,864,247.71	-1,948,764.56
本期利润	28,065,003.56	2,973,041.28	31,038,044.84
本期基金份额交易产生的变动数	11,059,338.51	410,054.78	11,469,393.29
其中：基金申购款	11,059,338.51	410,054.78	11,469,393.29
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-35,838,262.47	-	-35,838,262.47
本期末	3,201,562.75	1,518,848.35	4,720,411.10

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	92,726.33
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	19,978.48
其他	5,960.27
合计	118,665.08

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

卖出股票成交总额	1,239,168,714.64
减：卖出股票成本总额	1,209,686,492.80
买卖股票差价收入	29,482,221.84

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	936,874.81
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	936,874.81

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	8,516,520.87
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,578,000.00
减：应收利息总额	1,646.06
买卖债券差价收入	936,874.81

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,877,616.71

基金投资产生的股利收益	-
合计	1,877,616.71

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	2,973,041.28
——股票投资	2,979,302.68
——债券投资	-6,261.40
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	2,973,041.28

#### 6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	3,217,497.57
银行间市场交易费用	-
合计	3,217,497.57

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	32,113.02
信息披露费	49,588.57
银行汇划费用	11,129.67
合计	92,831.26

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华泰保兴基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
华泰保险集团股份有限公司	基金管理人的主要股东
上海飞恒资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
上海旷正资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
上海泰颐资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
上海哲昌资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东
上海志庄资产管理中心（有限合伙）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	949,896.28	-

其中：支付销售机构的客户维护费	0.00	-
-----------------	------	---

注：支付基金管理人华泰保兴基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.70% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	135,699.39	-

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金不收取销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
华泰保险集团股份有限 公司	11,086,373.49	3.6987%	10,000,450.04	4.7619%

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日 至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日 至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	81,137,532.04	92,726.33	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2019年4月22日	-	2019年4月22日	1.2000	34,638,208.47	1,200,054.00	35,838,262.47	
合计	-	-	-	1.2000	34,638,208.47	1,200,054.00	35,838,262.47	

### 6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	未上市	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券	证券	成功	可流通日	流通受限	认购	期末估值	数量	期末	期末估	备



代码	名称	认购日		类型	价格	单价	(单位: 张)	成本总额	值总额	注
113537	文灿转债	2019年6月12日	2019年7月5日	新债未上市	100.00	100.00	2,880	288,000.00	288,000.00	
113027	华钰转债	2019年6月18日	2019年7月10日	新债未上市	100.00	100.00	2,020	202,000.00	202,000.00	
113028	环境转债	2019年6月20日	2019年7月8日	新债未上市	100.00	100.00	850	85,000.00	85,000.00	
123027	蓝晓转债	2019年6月13日	2019年7月4日	新债未上市	100.00	100.00	630	63,000.00	63,000.00	
128069	华森转债	2019年6月26日	2019年7月11日	新债未上市	100.00	100.00	560	56,000.00	56,000.00	

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了分工明确、相互制约的风险管理组织架构体系。公司的风险管理组织架构体系由公司董事会、董事会风险控制委员会、经理层及其合规和风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部、各业务部门及全体员工共同组成。

董事会负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略，对公司的风险控制承担最终责任；董事会下设风险控制委员会，负责对公司经营管理和投资业务进行合规性控制，并对公司内部稽核审计工作进行审核监督。公司经理层负责根据董事会批准的风险控制制度和战略具体组织实施公司风险控制工作并对风险控制的有效性及其执行效果承担直接责任；总经理负责公司全面的风险控制工作，副总经理负责其分管业务范围的风险控制工作；公司经理层下设合规和风险管理委员会，负责协助经理层进行风险管理的咨询和议事，指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作。在业务操作层面，督察长按照中国证监会有关监管规定开展风险管理工作，负责分管并领导监察稽核部、风险管理部独立履行监察稽核及风险管理职责；监察稽核部对公司的风险控制承担独立评估、检查和报告职责；风险管理部对公司的风险控制承担评估、分析、评价职责，具体而言，风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，使得各投资组合的投资范围及投资比例限制合规；参与各投资组合新股申购、债券申购以及银行间

交易等场外交易的风险识别与评估，保证场外交易的事中合规控制，并完成各投资组合的投资风险及绩效分析。公司各业务部门负责执行公司的风险控制政策及决策，定期对本部门的风险进行全面评估，并对本部门风险控制的有效性负责；公司所有员工是本岗位风险控制的直接责任人，负责具体风险管理职责的实施。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去评估各种风险可能产生的损失。从定性的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的额度；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征通过特定的风险量化指标、模型、日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，以及可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围之内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行活期存款存放在本基金的托管人中国银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险较低。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	157,044.0	0.00
AAA 以下	992,694.60	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	1,149,738.60	0.00

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来源于基金份额持有人可于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来源于投资品种所处的交易市场不活跃带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况

下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。本基金所持有的证券在证券交易所上市或在银行间市场进行交易，本基金持有一家公司发行的证券市值不超过本基金资产净值的 10%，本基金与本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不超过该证券的 10%。本报告期末，除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受到限制不能自由转让的情况外，本基金持有的其他证券均能以合理价格适时变现。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	81,137,532.04	-	-	-	-	81,137,532.04

结算备付金	1,671,561.19	-	-	-	-	1,671,561.19
存出保证金	262,908.14	-	-	-	-	262,908.14
交易性金融资产	-	1,149,738.60	-	-	-183,363,505.93	184,513,244.53
应收证券清算款	-	-	-	-	38,802,241.17	38,802,241.17
应收利息	-	-	-	-	9,709.34	9,709.34
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	83,072,001.37	1,149,738.60	-	-	-222,175,456.44	306,397,196.41
负债	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	170,488.16	170,488.16
应付托管费	-	-	-	-	24,355.46	24,355.46
应付交易费用	-	-	-	-	1,660,878.83	1,660,878.83
应交税费	-	-	-	-	8.58	8.58
其他负债	-	-	-	-	82,943.53	82,943.53
负债总计	-	-	-	-	1,938,674.56	1,938,674.56
利率敏感度缺口	83,072,001.37	1,149,738.60	-	-	-220,236,781.88	304,458,521.85
上年度末 2018 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	20,479,738.16	-	-	-	-	20,479,738.16
交易性金融资产	-	-	-	-	-154,397,478.80	154,397,478.80
买入返售金融资产	40,000,000.00	-	-	-	-	40,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	2,641,628.22	2,641,628.22
应收利息	-	-	-	-	14,813.30	14,813.30
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	60,479,738.16	-	-	-	-157,053,920.32	217,533,658.48
负债	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	9,326,677.12	9,326,677.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	23,985.44	23,985.44
应付托管费	-	-	-	-	3,426.48	3,426.48
应付交易费用	-	-	-	-	118,642.02	118,642.02
其他负债	-	-	-	-	1,241.94	1,241.94
负债总计	-	-	-	-	9,473,973.00	9,473,973.00
利率敏感度缺口	60,479,738.16	-	-	-	-147,579,947.32	208,059,685.48

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.3776%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金基金管理人在构建和管理投资组合过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置和组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置及投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。在封闭期内，本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，但在每次开放期前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，本基金投资不受上述比例限制；在开放期内，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	183,363,505.93	60.23	154,397,478.80	74.21
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,149,738.60	0.38	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	184,513,244.53	60.60	154,397,478.80	74.21

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，与本基金组合的贝塔系数紧密相关		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2019 年 6 月 30 日）	上年度末 （2018 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上涨 5%	12,951,881.24	-
	业绩比较基准下跌 5%	-12,951,881.24	-

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 183,762,267.99 元，属于第二层次的余额为 750,976.54 元，无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第一层次 154,397,478.80 元，无第二或第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	183,363,505.93	59.85
	其中：股票	183,363,505.93	59.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,149,738.60	0.38
	其中：债券	1,149,738.60	0.38
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	82,809,093.23	27.03
8	其他各项资产	39,074,858.65	12.75
9	合计	306,397,196.41	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	6,376,178.28	2.09
B	采矿业	191,920.10	0.06
C	制造业	128,876,131.55	42.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	11,398,566.00	3.74
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,192,044.76	3.68
J	金融业	15,682,405.44	5.15
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	6,030,481.20	1.98



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	3,592,672.00	1.18
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	183,363,505.93	60.23

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000063	中兴通讯	252,500	8,213,825.00	2.70
2	601318	中国平安	91,664	8,122,347.04	2.67
3	600036	招商银行	209,177	7,526,188.46	2.47
4	600887	伊利股份	223,000	7,450,430.00	2.45
5	002157	正邦科技	439,200	7,317,072.00	2.40
6	000651	格力电器	125,567	6,906,185.00	2.27
7	300628	亿联网络	64,000	6,852,480.00	2.25
8	601012	隆基股份	286,585	6,622,979.35	2.18
9	000661	长春高新	19,523	6,598,774.00	2.17
10	002415	海康威视	236,100	6,511,638.00	2.14
11	600975	新五丰	578,076	6,376,178.28	2.09
12	002001	新和成	329,860	6,362,999.40	2.09
13	002796	世嘉科技	157,900	6,328,632.00	2.08
14	603939	益丰药房	89,600	6,271,104.00	2.06
15	600031	三一重工	477,636	6,247,478.88	2.05
16	603018	中设集团	484,376	6,030,481.20	1.98
17	600519	贵州茅台	6,027	5,930,568.00	1.95
18	600872	中炬高新	137,700	5,897,691.00	1.94
19	002410	广联达	173,700	5,712,993.00	1.88
20	603737	三棵树	129,628	5,644,003.12	1.85
21	300253	卫宁健康	383,600	5,439,448.00	1.79
22	000401	冀东水泥	293,100	5,161,491.00	1.70
23	601933	永辉超市	502,200	5,127,462.00	1.68
24	002372	伟星新材	288,569	5,021,100.60	1.65
25	002100	天康生物	572,400	4,636,440.00	1.52
26	002567	唐人神	397,600	4,592,280.00	1.51

27	600438	通威股份	323,700	4,551,222.00	1.49
28	000830	鲁西化工	393,000	4,275,840.00	1.40
29	002124	天邦股份	309,900	4,041,096.00	1.33
30	002044	美年健康	288,800	3,592,672.00	1.18
31	300751	迈为股份	27,655	3,505,547.80	1.15
32	600968	海油发展	54,062	191,920.10	0.06
33	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.03
34	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
35	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.01
36	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
37	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
38	603217	元利科技	438	29,451.12	0.01
39	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
40	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000401	冀东水泥	34,065,798.18	16.37
2	000651	格力电器	25,132,568.00	12.08
3	600837	海通证券	23,204,026.00	11.15
4	601318	中国平安	23,173,259.00	11.14
5	601166	兴业银行	22,173,427.10	10.66
6	002567	唐人神	21,862,004.65	10.51
7	600519	贵州茅台	21,421,065.00	10.30
8	600720	祁连山	20,388,543.17	9.80
9	601012	隆基股份	20,048,870.32	9.64
10	600438	通威股份	18,784,095.70	9.03
11	600030	中信证券	17,511,134.80	8.42
12	600643	爱建集团	16,471,214.92	7.92
13	600975	新五丰	16,421,059.82	7.89
14	601933	永辉超市	15,690,760.99	7.54
15	300751	迈为股份	15,589,679.00	7.49
16	600031	三一重工	15,159,735.84	7.29

17	002157	正邦科技	14,918,705.55	7.17
18	300450	先导智能	14,865,212.23	7.14
19	603833	欧派家居	14,814,312.84	7.12
20	000666	经纬纺机	14,536,055.00	6.99
21	601233	桐昆股份	14,511,389.61	6.97
22	000830	鲁西化工	14,505,242.51	6.97
23	000961	中南建设	14,373,899.00	6.91
24	600352	浙江龙盛	14,183,862.50	6.82
25	000002	万科 A	13,943,514.13	6.70
26	600036	招商银行	13,451,838.85	6.47
27	600958	东方证券	13,364,121.00	6.42
28	002100	天康生物	13,229,711.34	6.36
29	600887	伊利股份	12,826,820.00	6.16
30	000661	长春高新	12,447,123.00	5.98
31	601128	常熟银行	12,423,105.69	5.97
32	603737	三棵树	12,265,088.54	5.89
33	600115	东方航空	12,094,665.22	5.81
34	300578	会畅通讯	11,939,306.00	5.74
35	300207	欣旺达	11,385,806.00	5.47
36	002405	四维图新	11,007,126.00	5.29
37	002410	广联达	10,941,506.66	5.26
38	002373	千方科技	10,887,088.00	5.23
39	603799	华友钴业	10,792,195.88	5.19
40	002202	金风科技	10,781,471.55	5.18
41	300118	东方日升	10,702,307.68	5.14
42	000063	中兴通讯	10,653,206.00	5.12
43	000625	长安汽车	10,577,055.02	5.08
44	002001	新和成	10,526,632.45	5.06
45	002129	中环股份	10,480,190.00	5.04
46	002372	伟星新材	10,386,262.82	4.99
47	002078	太阳纸业	10,191,331.00	4.90
48	300001	特锐德	10,131,842.95	4.87
49	600809	山西汾酒	10,012,519.38	4.81
50	600763	通策医疗	9,911,847.00	4.76
51	600872	中炬高新	9,879,506.90	4.75
52	002146	荣盛发展	9,839,626.00	4.73

53	002124	天邦股份	9,497,576.00	4.56
54	603939	益丰药房	9,466,454.20	4.55
55	600996	贵广网络	9,321,682.78	4.48
56	002812	恩捷股份	9,265,249.00	4.45
57	603507	振江股份	9,150,836.03	4.40
58	000977	浪潮信息	9,130,029.00	4.39
59	603883	老百姓	9,115,964.72	4.38
60	002796	世嘉科技	9,064,784.50	4.36
61	002415	海康威视	8,979,937.60	4.32
62	000877	天山股份	8,789,665.00	4.22
63	002727	一心堂	8,768,566.36	4.21
64	300750	宁德时代	8,442,887.00	4.06
65	002044	美年健康	8,349,470.04	4.01
66	600276	恒瑞医药	8,242,313.00	3.96
67	000960	锡业股份	8,171,832.00	3.93
68	601398	工商银行	8,090,460.00	3.89
69	601939	建设银行	7,980,000.00	3.84
70	601877	正泰电器	7,942,094.00	3.82
71	002230	科大讯飞	7,753,208.50	3.73
72	300724	捷佳伟创	7,706,945.50	3.70
73	603713	密尔克卫	7,657,053.00	3.68
74	601211	国泰君安	7,538,902.00	3.62
75	300015	爱尔眼科	7,528,461.85	3.62
76	601155	新城控股	7,450,826.00	3.58
77	002626	金达威	7,384,503.00	3.55
78	600559	老白干酒	7,363,692.83	3.54
79	300037	新宙邦	7,357,230.00	3.54
80	002714	牧原股份	7,340,294.00	3.53
81	601225	陕西煤业	7,188,783.00	3.46
82	600258	首旅酒店	7,169,572.00	3.45
83	601336	新华保险	7,119,348.00	3.42
84	600985	淮北矿业	7,101,778.70	3.41
85	300628	亿联网络	6,804,256.00	3.27
86	600325	华发股份	6,770,835.00	3.25
87	002821	凯莱英	6,608,644.22	3.18
88	000858	五粮液	6,596,320.00	3.17

89	600570	恒生电子	6,554,611.00	3.15
90	603018	中设集团	6,426,999.76	3.09
91	600188	兖州煤业	6,398,229.86	3.08
92	002468	申通快递	6,288,961.00	3.02
93	601688	华泰证券	6,220,236.00	2.99
94	300659	中孚信息	6,083,130.00	2.92
95	603160	汇顶科技	6,079,442.60	2.92
96	600529	山东药玻	6,060,376.66	2.91
97	300529	健帆生物	6,027,794.00	2.90
98	300253	卫宁健康	5,928,981.82	2.85
99	603218	日月股份	5,694,778.00	2.74
100	600029	南方航空	5,459,816.00	2.62
101	600048	保利地产	5,294,998.10	2.54
102	002557	洽洽食品	5,175,423.54	2.49
103	603181	皇马科技	5,119,232.00	2.46
104	600009	上海机场	4,991,903.20	2.40
105	600875	东方电气	4,931,405.00	2.37
106	601611	中国核建	4,921,952.21	2.37
107	002713	东易日盛	4,921,910.00	2.37
108	603323	苏农银行	4,883,384.18	2.35
109	002182	云海金属	4,860,504.00	2.34
110	300474	景嘉微	4,843,601.00	2.33
111	600208	新湖中宝	4,669,450.00	2.24
112	000725	京东方 A	4,405,918.82	2.12
113	300294	博雅生物	4,383,101.50	2.11

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000401	冀东水泥	28,796,351.40	13.84
2	600837	海通证券	25,093,177.00	12.06
3	601166	兴业银行	21,964,196.13	10.56
4	000002	万科 A	21,130,212.90	10.16
5	600030	中信证券	19,713,280.19	9.47
6	002567	唐人神	19,146,698.59	9.20
7	600720	祁连山	18,909,789.80	9.09

8	000651	格力电器	18,728,104.46	9.00
9	600643	爱建集团	17,790,122.95	8.55
10	600519	贵州茅台	16,849,657.00	8.10
11	601233	桐昆股份	16,443,495.85	7.90
12	000961	中南建设	16,307,275.29	7.84
13	601318	中国平安	16,042,128.25	7.71
14	601012	隆基股份	15,913,305.26	7.65
15	300450	先导智能	15,669,468.03	7.53
16	600352	浙江龙盛	15,130,403.46	7.27
17	000666	经纬纺机	14,362,409.17	6.90
18	603833	欧派家居	13,806,073.20	6.64
19	600438	通威股份	13,754,052.27	6.61
20	601186	中国铁建	13,498,915.00	6.49
21	600958	东方证券	13,367,572.02	6.42
22	603018	中设集团	13,091,001.28	6.29
23	300578	会畅通讯	12,980,239.68	6.24
24	002405	四维图新	12,723,939.76	6.12
25	300118	东方日升	12,692,955.37	6.10
26	300751	迈为股份	12,610,721.84	6.06
27	601225	陕西煤业	12,155,799.00	5.84
28	000625	长安汽车	12,073,824.08	5.80
29	601128	常熟银行	11,939,121.29	5.74
30	603357	设计总院	11,643,008.75	5.60
31	600975	新五丰	11,638,847.90	5.59
32	601668	中国建筑	11,621,008.45	5.59
33	002366	台海核电	11,527,479.03	5.54
34	300595	欧普康视	11,470,125.12	5.51
35	601933	永辉超市	11,157,893.45	5.36
36	600115	东方航空	10,959,722.45	5.27
37	300294	博雅生物	10,818,918.00	5.20
38	600809	山西汾酒	10,755,088.95	5.17
39	603799	华友钴业	10,697,795.47	5.14
40	600763	通策医疗	10,671,207.71	5.13
41	002373	千方科技	10,667,990.85	5.13
42	600048	保利地产	10,572,443.00	5.08
43	002202	金风科技	10,442,509.24	5.02
44	002129	中环股份	10,232,282.68	4.92
45	300207	欣旺达	10,065,579.00	4.84

46	601611	中国核建	10,046,500.00	4.83
47	002078	太阳纸业	9,917,850.18	4.77
48	002146	荣盛发展	9,851,949.73	4.74
49	600031	三一重工	9,739,223.09	4.68
50	600996	贵广网络	9,707,320.14	4.67
51	300724	捷佳伟创	9,440,865.00	4.54
52	002812	恩捷股份	9,369,066.00	4.50
53	000977	浪潮信息	9,038,677.05	4.34
54	601211	国泰君安	9,013,280.00	4.33
55	000877	天山股份	8,994,675.00	4.32
56	300001	特锐德	8,920,064.20	4.29
57	002727	一心堂	8,804,459.12	4.23
58	002157	正邦科技	8,768,399.00	4.21
59	600161	天坛生物	8,742,714.85	4.20
60	600276	恒瑞医药	8,631,531.82	4.15
61	601398	工商银行	8,408,000.00	4.04
62	601939	建设银行	8,403,000.00	4.04
63	002044	美年健康	8,298,194.84	3.99
64	000960	锡业股份	8,208,711.16	3.95
65	603507	振江股份	8,206,031.76	3.94
66	603883	老百姓	8,130,898.00	3.91
67	603713	密尔克卫	8,113,073.00	3.90
68	300015	爱尔眼科	8,079,018.97	3.88
69	300750	宁德时代	8,052,093.77	3.87
70	600570	恒生电子	8,015,848.66	3.85
71	601877	正泰电器	8,001,116.12	3.85
72	600258	首旅酒店	7,953,041.91	3.82
73	002230	科大讯飞	7,845,150.28	3.77
74	601688	华泰证券	7,758,758.19	3.73
75	601155	新城控股	7,700,811.00	3.70
76	600559	老白干酒	7,472,710.34	3.59
77	300037	新宙邦	7,363,661.00	3.54
78	000661	长春高新	7,321,363.10	3.52
79	600325	华发股份	7,306,500.26	3.51
80	002468	申通快递	7,257,466.22	3.49
81	002714	牧原股份	7,125,633.16	3.42
82	002925	盈趣科技	6,921,456.67	3.33
83	600529	山东药玻	6,809,662.08	3.27

84	603737	三棵树	6,707,577.70	3.22
85	600872	中炬高新	6,691,877.00	3.22
86	300659	中孚信息	6,614,233.00	3.18
87	002821	凯莱英	6,595,237.17	3.17
88	600985	淮北矿业	6,550,930.55	3.15
89	601336	新华保险	6,505,054.00	3.13
90	002626	金达威	6,432,030.80	3.09
91	000830	鲁西化工	6,292,306.20	3.02
92	600188	兖州煤业	6,290,659.54	3.02
93	000858	五粮液	6,232,528.76	3.00
94	603218	日月股份	6,182,215.60	2.97
95	600036	招商银行	6,178,645.52	2.97
96	002007	华兰生物	6,111,205.40	2.94
97	600029	南方航空	5,991,334.86	2.88
98	300529	健帆生物	5,990,111.00	2.88
99	002100	天康生物	5,975,202.60	2.87
100	002410	广联达	5,871,063.00	2.82
101	002372	伟星新材	5,825,927.92	2.80
102	600887	伊利股份	5,702,294.00	2.74
103	000725	京东方 A	5,594,263.00	2.69
104	603678	火炬电子	5,372,183.00	2.58
105	600208	新潮中宝	5,301,065.00	2.55
106	603160	汇顶科技	5,295,544.00	2.55
107	000403	振兴生化	5,132,276.95	2.47
108	002713	东易日盛	5,110,491.90	2.46
109	603181	皇马科技	5,102,458.33	2.45
110	600875	东方电气	4,978,495.17	2.39
111	600009	上海机场	4,962,494.35	2.39
112	300474	景嘉微	4,959,531.00	2.38
113	002557	洽洽食品	4,946,871.00	2.38
114	300451	创业慧康	4,849,357.00	2.33
115	000063	中兴通讯	4,800,425.00	2.31
116	002182	云海金属	4,683,031.38	2.25
117	603986	兆易创新	4,668,436.42	2.24
118	603323	苏农银行	4,548,069.68	2.19
119	601088	中国神华	4,530,113.00	2.18
120	603939	益丰药房	4,503,930.90	2.16
121	002001	新和成	4,344,173.00	2.09



122	002796	世嘉科技	4,243,309.00	2.04
-----	--------	------	--------------	------

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,235,673,217.25
卖出股票收入（成交）总额	1,239,168,714.64

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	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）	1,149,738.60	0.38
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,149,738.60	0.38

### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113537	文灿转债	2,880	288,000.00	0.09
2	113027	华钰转债	2,020	202,000.00	0.07
3	113025	明泰转债	1,070	106,860.90	0.04
4	127013	创维转债	910	88,770.50	0.03
5	113028	环境转债	850	85,000.00	0.03

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本报告期末本基金未持有股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本报告期末本基金未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

#### 7.12.2

本基金投资的前十名股票中，无基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	262,908.14
2	应收证券清算款	38,802,241.17
3	应收股利	-
4	应收利息	9,709.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,074,858.65

#### 7.12.4 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。

#### **7.12.5 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股票。

#### **7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
2	149,869,055.38	299,738,110.75	100.00%	0.00	0.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末本公司的从业人员未持有本基金份额。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：期末本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

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	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金经理等人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金管理人股东	11,086,373.49	3.70	10,000,450.04	3.34	自基金合同生 效之日起不少 于 3 年
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	-
合计	11,086,373.49	3.70	10,000,450.04	3.34	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 12 月 25 日）基金份额总额	210,008,450.04
本报告期期初基金份额总额	210,008,450.04
本报告期期间基金总申购份额	89,729,660.71
减:本报告期期间基金总赎回份额	-
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	299,738,110.75

注：总申购份额含红利再投、转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。  
 (2) 2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	582,076,609.99	23.54%	414,032.06	23.54%	-
东方证券	2	324,804,241.28	13.14%	231,033.79	13.14%	-
国泰君安	2	286,551,807.61	11.59%	203,821.76	11.59%	-

长江证券	2	263,596,219.13	10.66%	187,496.61	10.66%	-
海通证券	2	250,347,864.50	10.12%	178,068.86	10.12%	-
天风证券	2	240,170,910.42	9.71%	170,832.39	9.71%	-
广发证券	2	230,916,974.08	9.34%	164,251.39	9.34%	-
申万证券	2	170,245,861.27	6.89%	121,096.43	6.89%	-
中信建投	2	123,936,154.28	5.01%	88,155.62	5.01%	-
长城证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）有关规定，基金管理人多家证券经营机构进行了综合评估。

1、专用交易单元的选择标准：

- （1）财务状况良好，经营行为规范；
- （2）研究实力较强，具有专门的研究机构和专职研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向和个股分析的研究报告等信息服务；
- （3）内部管理规范、严谨，具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。

2、专用交易单元的选择程序：

- （1）公司对交易单元所属券商进行综合评价，投资决策委员会根据综合评价的结果作出租用与否的决策；
- （2）公司研究部定期组织对交易单元所属券商的综合服务进行评价，由投资决策委员会对交易单元的交易量进行分配和调整。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	2,104,334.49	24.71%	58,000,000.00	23.20%	-	-
东方证券	1,107,231.30	13.00%	-	-	-	-
国泰君安	373,588.50	4.39%	-	-	-	-
长江证券	227,503.10	2.67%	-	-	-	-
海通证券	-	-	40,000,000.00	16.00%	-	-
天风证券	2,233,621.10	26.23%	-	-	-	-
广发证券	1,754,002.38	20.60%	122,000,000.00	48.80%	-	-
申万证券	716,240.00	8.41%	30,000,000.00	12.00%	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰保兴基金管理有限公司旗下基金 2018 年 12 月 31 日资产净值公告	管理人网站	2019 年 1 月 2 日
2	华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务的公告	《证券时报》及管理人网站	2019 年 3 月 23 日
3	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及管理人网站	2019 年 4 月 13 日
4	华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金分红公告	《证券时报》及管理人网站	2019 年 4 月 19 日
5	华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	《证券时报》及管理人网站	2019 年 4 月 20 日
6	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及管理人网站	2019 年 6 月 21 日
7	华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	《证券时报》及管理人网站	2019 年 6 月 25 日
8	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金所持停牌股票估值调整的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及管理人网站	2019 年 6 月 27 日



## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190101-20190630	200,008,000.00	88,643,737.26	0.00	288,651,737.26	96.30%
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

注：报告期内，申购份额含转换入份额、红利再投资份额和基金成立认购份额，赎回份额含转换出份额。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金募集的文件
- 2、《华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、《华泰保兴吉年利定期开放混合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、报告期内本基金在指定媒介披露的各项公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

### 12.3 查阅方式

- 1、营业时间内至基金管理人及基金托管人住所免费查阅
- 2、登录基金管理人网站 [www.huataifund.com](http://www.huataifund.com) 查阅
- 3、拨打基金管理人客服热线电话 400-632-9090 查询

华泰保兴基金管理有限公司

2019 年 8 月 29 日