华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金

2020 年中期报告

2020 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：二〇二〇年八月二十九日

§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。本中期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 2020 年 8 月 25 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 2020 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2

1.2 目录 3

§2 基金简介 6

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

§3 主要财务指标和基金净值表现 8

3.1 主要会计数据和财务指标 8

3.2 基金净值表现 8

§4 管理人报告 11

4.1 基金管理人及基金经理情况 11

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12

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 13

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15

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 15

§5 托管人报告 16

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16

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 16

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 16

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 17

6.1 资产负债表 17

6.2 利润表 18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表 19

6.4 报表附注.....20
§7 投资组合报告.....43
7.1 期末基金资产组合情况.....43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....43
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.....44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....51
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.....52
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.....52
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.....52
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.....52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....52
7.12 投资组合报告附注.....52
§8 基金份额持有人信息.....54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....54
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.....54
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....54
§9 开放式基金份额变动.....56
§10 重大事件揭示.....57
10.1 基金份额持有人大会决议.....57
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.....57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....57
10.4 基金投资策略的改变.....57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....57
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.....57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....57
10.8 其他重大事件.....59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....62

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 62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 62
§12 备查文件目录 63
12.1 备查文件目录 63
12.2 存放地点 63
12.3 查阅方式 63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金	
基金简称	华泰保兴吉年丰	
基金主代码	004374	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 3 月 24 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	323,830,050.31 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰保兴吉年丰 A	华泰保兴吉年丰 C
下属分级基金的交易代码	004374	004375
报告期末下属分级基金的份额总额	168,947,964.49 份	154,882,085.82 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极主动的分散化投资策略，把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，力争在严格控制风险的前提下满足投资人实现资产增值的投资需求。	
投资策略	本基金根据资本市场实际情况对大类资产比例进行动态调整，力求有效地回避证券市场的系统性风险。同时，以专业的研究分析为根本，挖掘市场中有潜力的投资标的和被低估的投资品种，获得基金的长期稳定增值。	
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。	
	华泰保兴吉年丰 A	华泰保兴吉年丰 C
下属分级基金的风险收益特征	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。	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	许俊
	联系电话	021-80299000	010-66594319
	电子邮箱	fund_xxpl@ehuatai.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-632-9090	95566
传真		021-60756968	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世	北京市西城区复兴门内大街 1

	纪大道 88 号 3810 室	号
办公地址	上海市浦东新区博成路 1101 号华泰金融大厦 9 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200126	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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ehuataifund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人办公地址（上海市浦东新区博成路 1101 号华泰金融大厦 9 层）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	上海市浦东新区博成路 1101 号华泰金融大厦 9 层

§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

基金级别	华泰保兴吉年丰 A	华泰保兴吉年丰 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	64,022,881.69	53,121,096.55
本期利润	90,498,331.97	74,778,043.04
加权平均基金份额本期利润	0.4513	0.4778
本期加权平均净值利润率	27.76%	29.56%
本期基金份额净值增长率	35.77%	35.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	93,963,146.38	84,040,024.59
期末可供分配基金份额利润	0.5562	0.5426
期末基金资产净值	327,080,762.53	297,377,945.96
期末基金份额净值	1.9360	1.9200
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	110.44%	108.73%

注：1、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。

2、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。

3、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

华泰保兴吉年丰 A

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	18.24%	1.26%	5.01%	0.62%	13.23%	0.64%
过去三个月	30.71%	1.38%	8.41%	0.63%	22.30%	0.75%
过去六个月	35.77%	2.09%	1.73%	1.05%	34.04%	1.04%
过去一年	108.60%	1.73%	7.29%	0.84%	101.31%	0.89%
过去三年	119.96%	1.64%	12.77%	0.87%	107.19%	0.77%

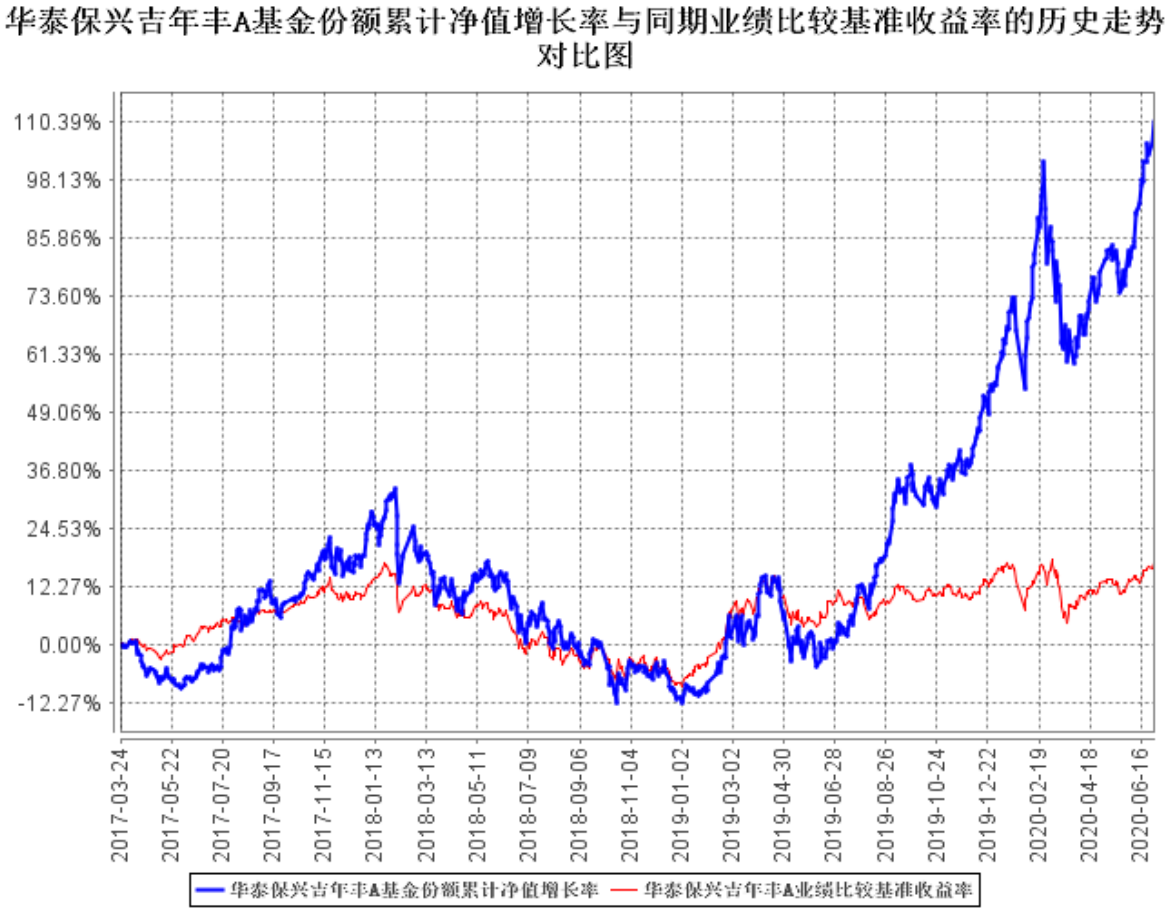
自基金合同生效起至今	110.44%	1.58%	17.16%	0.84%	93.28%	0.74%

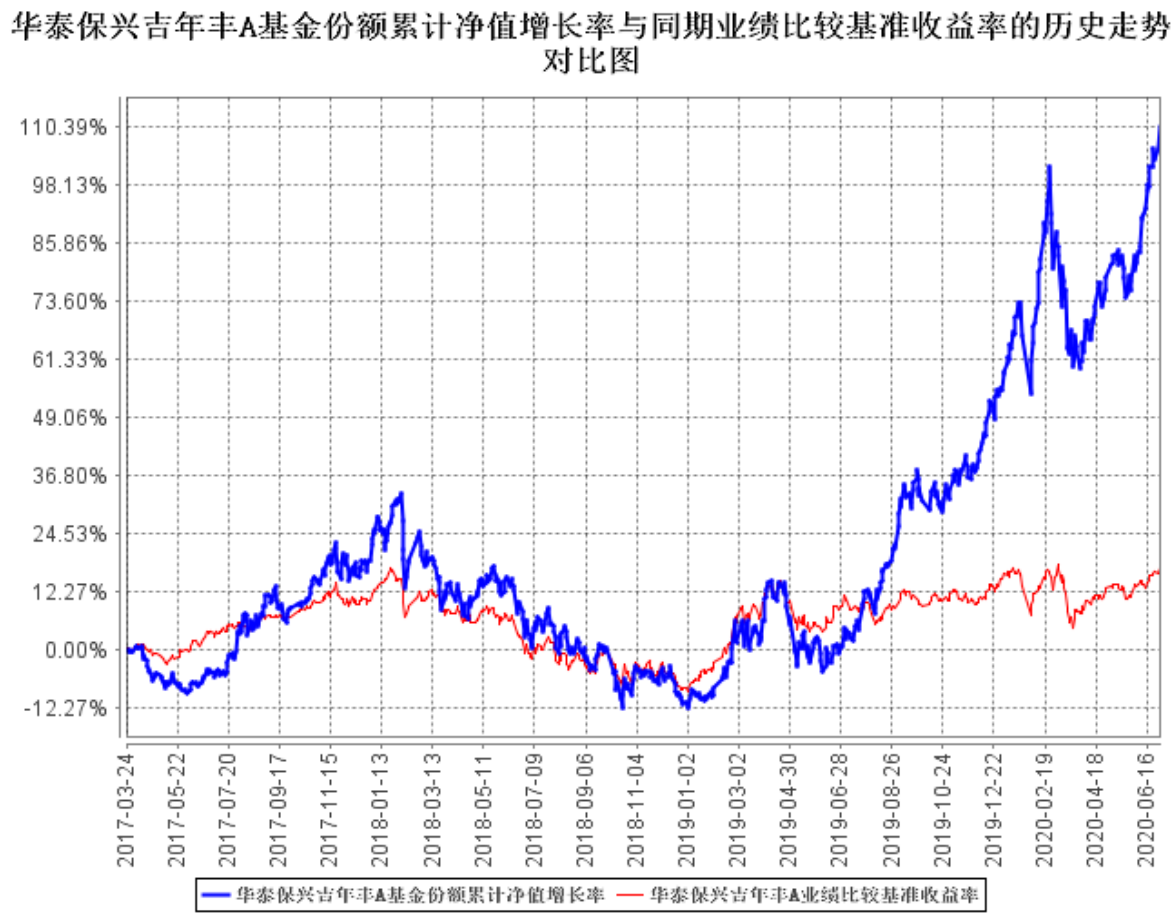
华泰保兴吉年丰 C

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	18.21%	1.26%	5.01%	0.62%	13.20%	0.64%
过去三个月	30.65%	1.38%	8.41%	0.63%	22.24%	0.75%
过去六个月	35.64%	2.09%	1.73%	1.05%	33.91%	1.04%
过去一年	108.13%	1.73%	7.29%	0.84%	100.84%	0.89%
过去三年	118.29%	1.64%	12.77%	0.87%	105.52%	0.77%
自基金合同生效起至今	108.73%	1.58%	17.16%	0.84%	91.57%	0.74%

注：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





注：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

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，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”）。根据公司股东会决议并经中国证监会证监许可[2019]3003 号文核准，公司进行增资扩股。公司新增注册资本人民币 6,000 万元由华泰保险集团认购并已完成实缴。本次增资完成后，公司注册资本由人民币 18,000 万元增加至人民币 24,000 万元。其中，华泰保险集团持股比例为 85%，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 15%。公司根据相关法律法规及规范性文件的规定，就本次增加注册资本及股权变更事宜修改了公司章程相应条款。公司本次增加注册资本及股权变更、章程修改涉及的工商变更登记手续已于 2020 年 6 月 2 日在上海市市场监督管理局办理完毕，并已按有关规定向中国证监会及其上海监管局进行了备案。

截至 2020 年 6 月 30 日，公司公募证券投资基金管理规模为人民币 185.45 亿元，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、华泰保兴多策略三个月定期开放股票型发起式证券投资基金、华泰保兴安悦债券型证券投资基金、华泰保兴尊享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰保兴科荣混合型证券投资基金等 18 只产品。

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	2017 年 3 月 24 日	-	10 年	上海交通大学硕士。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，现任基金投资部总经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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，结合投资交易系统中的公平交易模块，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《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

2020 年上半年，新型冠状肺炎疫情对全球宏观经济和产业格局产生深远影响，中国在对抗疫情方面取得了较好的效果。上半年，我们布局了内需相关性较高的行业，减持了外需相关的行业。同时，我们发现部分行业的长期趋势得到加强，新经济中包括新能源车、云计算等进入加速期，传统经济也不乏亮点，装配式建筑、防水材料等竞争格局也持续向好，集中度持续提升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰保兴吉年丰 A 基金份额净值为 1.9360 元，本报告期基金份额净值增长率为 35.77%；截至本报告期末华泰保兴吉年丰 C 基金份额净值为 1.9200 元，本报告期基金份额净值增长率为 35.64%；同期业绩比较基准收益率为 1.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年国内宏观经济的弱复苏被新型冠状肺炎疫情打断节奏，且在外需有较大压力的背景下，整体宏观经济的增速和 A 股整体利润增速都会受到很大的冲击。

本次新型冠状肺炎疫情冲击放一年维度会对全球经济造成极大的冲击，但在更长维度我们认为机遇与危险并存。从宏观上说，中国经济如果能够利用本次危机走出传统的通过刺激地产销售来救经济的方式，将对长期经济发展格局产生深远的影响。从中观上看，部分制造业将有望通过此次冲击，证明并巩固自身在全球产业链中的竞争优势。此外，新老基建将同时对经济产生正向

的作用。我们认为新基建的总量机会更大，而老基建中部分行业竞争格局改善，行业集中度有望进一步提升，也存在一定的投资机会。公共卫生服务和部分格局较好的内需消费在疫情后，也有望重新进入较好的发展通道。外需的冲击仍需评估，但不改包括新能源（光伏与车）等成长空间、市场渗透率仍有较大提升空间的行业的长期发展态势，今年年内这些行业可能会出现较好的买点。此外，宏观稳定弱复苏环境下，传统周期中也具备了一定的投资价值。

年中随着宏观经济企稳得到进一步确认，货币政策边际放松力度将非常有限。市场风格将从之前的成长独舞向成长价值共舞切换。随着居民配置资金等增量资金的入市，下半年市场将保持较高的活跃度，权益资产有望取得较好的回报。风险主要体现在海外以及国内地产方面。

投资策略方面，我们仍将遵从中观维度的基于相对行业景气度的投资框架，结合自下而上的选股，选择行业相对景气度向上或者稳定的长期赛道中战略与管理能力优秀的公司。

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。

截止报告期末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

根据相关法律法规、本基金的基金合同等规定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未实施利润分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同的规定实施利润分配。

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，截至报告期末基金合同生效已满三年，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或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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”）在华泰保兴吉年丰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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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：华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金

报告截止日： 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	34,643,269.43	30,580,400.12
结算备付金		4,951,792.01	3,336,102.32
存出保证金		358,537.80	206,876.76
交易性金融资产	6.4.7.2	589,384,861.10	421,722,576.05
其中：股票投资		589,193,911.10	421,244,576.05
基金投资		-	-
债券投资		190,950.00	478,000.00
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	-	-
应收证券清算款		19,869,390.28	13,289,330.69
应收利息	6.4.7.5	8,008.01	11,260.92
应收股利		-	-
应收申购款		1,790,593.60	1,041,255.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		651,006,452.23	470,187,802.37
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2020 年 6 月 30 日**	**上年度末 2019 年 12 月 31 日**
负 债：			
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		16,758,296.02	16,991,981.39
应付赎回款		2,461,198.40	1,860,466.62
应付管理人报酬		387,540.20	235,429.01
应付托管费		121,106.34	73,571.59
应付销售服务费		45,022.94	29,848.63
应付交易费用	6.4.7.7	6,688,021.74	5,603,287.23

应交税费		0.34	6.53
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	86,557.76	170,330.44
负债合计		26,547,743.74	24,964,921.44
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	323,830,050.31	313,238,347.67
未分配利润	6.4.7.10	300,628,658.18	131,984,533.26
所有者权益合计		624,458,708.49	445,222,880.93
负债和所有者权益总计		651,006,452.23	470,187,802.37

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，华泰保兴吉年丰 A 基金份额净值 1.9360 元，基金份额总额 168,947,964.49 份；华泰保兴吉年丰 C 基金份额净值 1.9200 元，基金份额总额 154,882,085.82 份。华泰保兴吉年丰份额总额合计为 323,830,050.31 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		176,285,798.99	42,238,205.08
1.利息收入		169,869.65	131,518.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	168,044.17	103,709.97
债券利息收入		1,825.48	1,910.74
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	25,897.79
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		127,286,270.86	33,778,632.41
其中：股票投资收益	6.4.7.12	122,680,302.26	31,434,464.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	544,287.34	1,044,968.20
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
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	4,061,681.26	1,299,199.89
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	48,132,396.77	8,285,662.68

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	697,261.71	42,391.49
减：二、费用		11,009,423.98	5,104,965.21
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	2,300,518.22	976,616.00
2．托管费	6.4.10.2.2	718,911.98	305,192.43
3．销售服务费	6.4.10.2.3	252,085.70	128,777.16
4．交易费用	6.4.7.19	7,646,599.74	3,613,781.66
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		6.61	5.28
7．其他费用	6.4.7.20	91,301.73	80,592.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		165,276,375.01	37,133,239.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		165,276,375.01	37,133,239.87

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	313,238,347.67	131,984,533.26	445,222,880.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	165,276,375.01	165,276,375.01
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）	10,591,702.64	3,367,749.91	13,959,452.55
其中：1.基金申购款	203,061,736.86	126,115,947.18	329,177,684.04
2.基金赎回款	-192,470,034.22	-122,748,197.27	-315,218,231.49
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）			
五、期末所有者权益（基金净值）	323,830,050.31	300,628,658.18	624,458,708.49
项目	**上年度可比期间 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）	365,623,038.26	-66,517,357.33	299,105,680.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	37,133,239.87	37,133,239.87
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）	-134,382,321.72	12,038,190.63	-122,344,131.09
其中：1.基金申购款	9,742,822.83	-593,292.81	9,149,530.02
2.基金赎回款	-144,125,144.55	12,631,483.44	-131,493,661.11
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	231,240,716.54	-17,345,926.83	213,894,789.71

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：

王冠龙	王冠龙	王云凌
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

华泰保兴吉年丰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[2017]116 号《关于准予华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金注册的批复》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《华泰保兴吉年丰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 115,848,123.50 元，业经苏亚金诚会计师事务所（特殊普通合伙）苏亚审验[2017]22 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 115,857,615.14 份基金份额,其中认购资金利息折合 9,491.64 份基金份额。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。

根据《华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金基金合同》和《华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，赎回时收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分设不同的基金代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,200.00 A 类基金份额，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《华泰保兴吉年丰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 2020 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<年度报告和中期报告>》、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》、《华泰保兴吉年丰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 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	34,643,269.43
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	34,643,269.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		507,986,262.56	589,193,911.10	81,207,648.54
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	190,000.00	190,950.00	950.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	190,000.00	190,950.00	950.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		508,176,262.56	589,384,861.10	81,208,598.54

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 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,638.71
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	2,228.30
应收债券利息	25.82
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	953.88
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	161.30
合计	8,008.01

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 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	6,688,021.74
银行间市场应付交易费用	-
合计	6,688,021.74

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,022.40
应付证券出借违约金	-
应付信息披露费	59,672.34
应付审计费	24,863.02
合计	86,557.76

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰保兴吉年丰 A	
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	176,833,482.87	176,833,482.87
本期申购	115,110,106.40	115,110,106.40
本期赎回(以"-"号填列)	-122,995,624.78	-122,995,624.78
- 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	168,947,964.49	168,947,964.49

金额单位：人民币元

华泰保兴吉年丰 C		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	136,404,864.80	136,404,864.80
本期申购	87,951,630.46	87,951,630.46
本期赎回(以"-"号填列)	-69,474,409.44	-69,474,409.44
- 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	154,882,085.82	154,882,085.82

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰保兴吉年丰 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	38,559,312.63	36,748,128.80	75,307,441.43
本期利润	64,022,881.69	26,475,450.28	90,498,331.97
本期基金份额交易产生的变动数	-8,619,047.94	946,072.58	-7,672,975.36
其中：基金申购款	46,955,864.88	26,260,865.79	73,216,730.67
基金赎回款	-55,574,912.82	-25,314,793.21	-80,889,706.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	93,963,146.38	64,169,651.66	158,132,798.04

单位：人民币元

华泰保兴吉年丰 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,463,841.98	28,213,249.85	56,677,091.83
本期利润	53,121,096.55	21,656,946.49	74,778,043.04
本期基金份额交易产生的变动数	2,455,086.06	8,585,639.21	11,040,725.27
其中：基金申购款	31,584,342.52	21,314,873.99	52,899,216.51
基金赎回款	-29,129,256.46	-12,729,234.78	-41,858,491.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	84,040,024.59	58,455,835.55	142,495,860.14

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	125,198.74
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	34,511.15
其他	8,334.28
合计	168,044.17

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,928,913,836.20
减：卖出股票成本总额	2,806,233,533.94
买卖股票差价收入	122,680,302.26

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 2020年1月1日至2020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	544,287.34
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	544,287.34

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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,786,499.47
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,240,300.00
减：应收利息总额	1,912.13
买卖债券差价收入	544,287.34

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,061,681.26
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,061,681.26

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	48,132,396.77

——股票投资	48,131,446.77
——债券投资	950.00
——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	48,132,396.77

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	634,049.75
基金转换费收入	63,211.96
合计	697,261.71

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

2.本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	7,646,599.74
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	7,646,599.74

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费用	6,766.37
合计	91,301.73

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
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
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
华泰财产保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构
华泰人寿保险股份有限公司	基金管理人主要股东控制的机构

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：本基金本报告期内及上年度可比期间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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,300,518.22	976,616.00
其中：支付销售机构的客户维护费	223,260.05	38,883.60

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.80%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	718,911.98	305,192.43

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰保兴吉年丰 A	华泰保兴吉年丰 C	合计
华泰保兴基金管理有限	-	214,083.14	214,083.14

公司			
中国银行股份有限公司	-	550.51	550.51
合计	-	214,633.65	214,633.65
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰保兴吉年丰 A	华泰保兴吉年丰 C	合计
华泰保兴基金管理有限公司	-	117,272.02	117,272.02
中国银行股份有限公司	-	225.93	225.93
合计	-	117,497.95	117,497.95

注：本基金设有 A 类基金份额和 C 类基金份额。A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.20%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

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：本基金本报告期内及上年度可比期间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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	华泰保兴吉年丰 A	华泰保兴吉年丰 C
基金合同生效日（ 2017 年 3 月 24 日 ）持有的基金份额	10,000,200.00	-
报告期初持有的基金份额	10,870,738.81	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份	-	-

额		
报告期末持有的基金份额	10,870,738.81	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.36%	-

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	华泰保兴吉年丰 A	华泰保兴吉年丰 C
基金合同生效日（ 2017 年 3 月 24 日 ）持有的基金份额	10,000,200.00	-
报告期初持有的基金份额	10,870,738.81	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,870,738.81	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.7%	-

注：1. 期间申购/买入总份额含转换入、红利再投、强制调增份额，期间赎回/卖出总份额含转换出、强制调减份额。

2. 基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

6.4.10.5.2 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

华泰保兴吉年丰 A				
关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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
华泰财产保险有限公司	3,500,177.51	1.0809%	10,256,177.51	3.2742%
华泰人寿保险股份有限公司	55,337,839.50	17.0885%	50,696,363.11	16.1846%

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。

6.4.10.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	34,643,269.43	125,198.74	14,762,950.99	75,466.17

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2020 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
688100	威胜信息	2020 年 1 月 9 日	2020 年 7 月 21 日	新股流通受限	13.78	25.92	11,602	159,875.56	300,723.84	-
688568	中科星图	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688159	有方科技	2020 年 1 月 16 日	2020 年 7 月 23 日	新股流通受限	20.35	52.73	3,341	67,989.35	176,170.93	-
688555	泽达易盛	2020 年 6 月 12 日	2020 年 12 月 23 日	新股流通受限	19.49	56.80	3,004	58,547.96	170,627.20	-
688377	迪威尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688027	国盾量子	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 9 日	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688528	秦川物联	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 1 日	新股未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
300847	中船汉光	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 9 日	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
601816	京沪高铁	2020 年 1 月 8 日	2020 年 7 月 16 日	新股流通受限	4.88	6.17	906,536	4,423,895.68	5,593,327.12	-
688178	万德斯	2020 年 1 月 6 日	2020 年 7 月 14 日	新股流通受限	25.20	39.90	3,704	93,340.80	147,789.60	-

注：1.根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上

市之日起 6 个月。

2.基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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

注：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

注：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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手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并对证券交割方式进行限制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。

于 2020 年 06 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.0306%（2019 年 12 月 31 日：0.1074%）。

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自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而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%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的 15%。本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不超过该上市公司可流通股票的 15%。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，其上限一般不超过本基金持有的债券投资的公允价值。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由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得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。 本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流 通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。

此外，本基金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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿 透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易 的流动性风险和交易对手风险。

此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	34,643,269.43	-	-	-	-	34,643,269.43
结算备付金	4,951,792.01	-	-	-	-	4,951,792.01
存出保证金	358,537.80	-	-	-	-	358,537.80

交易性金融资产	-	-	190,950.00	-	589,193,911.10	589,384,861.10
应收证券清算款	-	-	-	-	19,869,390.28	19,869,390.28
应收利息	-	-	-	-	8,008.01	8,008.01
应收申购款	1,346.42	-	-	-	1,789,247.18	1,790,593.60
资产总计	39,954,945.66	-	190,950.00	-	610,860,556.57	651,006,452.23
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	16,758,296.02	16,758,296.02
应付赎回款	-	-	-	-	2,461,198.40	2,461,198.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	387,540.20	387,540.20
应付托管费	-	-	-	-	121,106.34	121,106.34
应付销售服务费	-	-	-	-	45,022.94	45,022.94
应付交易费用	-	-	-	-	6,688,021.74	6,688,021.74
应交税费	-	-	-	-	0.34	0.34
其他负债	-	-	-	-	86,557.76	86,557.76
负债总计	-	-	-	-	26,547,743.74	26,547,743.74
利率敏感度缺口	39,954,945.66	-	190,950.00	-	584,312,812.83	624,458,708.49
上年度末 2019 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	30,580,400.12	-	-	-	-	30,580,400.12
结算备付金	3,336,102.32	-	-	-	-	3,336,102.32
存出保证金	206,876.76	-	-	-	-	206,876.76
交易性金融资产	-	478,000.00	-	-	421,244,576.05	421,722,576.05
应收证券清算款	-	-	-	-	13,289,330.69	13,289,330.69
应收利息	-	-	-	-	11,260.92	11,260.92
应收申购款	998.81	-	-	-	1,040,256.70	1,041,255.51
资产总计	34,124,378.01	478,000.00	-	-	435,585,424.36	470,187,802.37
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	16,991,981.39	16,991,981.39
应付赎回款	-	-	-	-	1,860,466.62	1,860,466.62
应付管理人报酬	-	-	-	-	235,429.01	235,429.01
应付托管费	-	-	-	-	73,571.59	73,571.59
应付销售服务费	-	-	-	-	29,848.63	29,848.63
应付交易费用	-	-	-	-	5,603,287.23	5,603,287.23
应交税费	-	-	-	-	6.53	6.53
其他负债	-	-	-	-	170,330.44	170,330.44
负债总计	-	-	-	-	24,964,921.44	24,964,921.44
利率敏感度缺口	34,124,378.01	478,000.00	-	-	410,620,502.92	445,222,880.93

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

于 2020 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资占基金资产净值的比例为 0.0306%（2019 年 12 月 31 日：0.1074%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019 年 12 月 31 日：同）。

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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，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，做出资产配置及组合构建的决定；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、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。本基金投资组合中股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%。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(ValueatRisk)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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	589,193,911.10	94.35	421,244,576.05	94.61
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	190,950.00	0.03	478,000.00	0.11

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	589,384,861.10	94.38	421,722,576.05	94.72

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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（ 2020 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2019 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准上升 5%	46,731,915.06	32,505,722.54
	业绩比较基准下降 5%	-46,731,915.06	-32,505,722.54

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 2020 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 582,263,655.40 元，属于第二层次的余额为 7,121,205.70 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 387,652,900.73 元，第二层次 34,069,675.32 元，无第三层次)。

(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 2020 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(2019 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)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	589,193,911.10	90.51
	其中：股票	589,193,911.10	90.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	190,950.00	0.03
	其中：债券	190,950.00	0.03
	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	39,595,061.44	6.08
8	其他各项资产	22,026,529.69	3.38
9	合计	651,006,452.23	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	473,609,539.33	75.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	55,056.40	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	36,531,647.12	5.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	53,174,392.33	8.52
J	金融业	-	-
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	25,662,720.00	4.11
N	水利、环境和公共设施管理业	147,789.60	0.02

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	-	-
S	综合	-	-
	合计	589,193,911.10	94.35

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	002541	鸿路钢构	1,344,500	39,313,180.00	6.30
2	603338	浙江鼎力	502,704	38,089,882.08	6.10
3	603538	美诺华	700,880	35,730,862.40	5.72
4	000725	京东方 A	7,187,700	33,566,559.00	5.38
5	600521	华海药业	948,310	32,176,158.30	5.15
6	300737	科顺股份	1,630,400	32,167,792.00	5.15
7	603658	安图生物	195,238	31,714,460.72	5.08
8	002080	中材科技	2,000,900	31,013,950.00	4.97
9	300750	宁德时代	177,800	31,001,208.00	4.96
10	603890	春秋电子	1,724,506	30,989,372.82	4.96
11	002352	顺丰控股	565,600	30,938,320.00	4.95
12	600984	建设机械	1,205,460	29,895,408.00	4.79
13	603881	数据港	245,500	26,531,185.00	4.25
14	688111	金山办公	76,942	26,281,848.36	4.21
15	600884	杉杉股份	2,185,140	25,762,800.60	4.13
16	300759	康龙化成	260,800	25,662,720.00	4.11
17	002594	比亚迪	336,829	24,184,322.20	3.87
18	002947	恒铭达	282,606	18,086,784.00	2.90
19	300769	德方纳米	129,100	12,571,758.00	2.01
20	688388	嘉元科技	217,205	12,239,501.75	1.96
21	000877	天山股份	791,979	11,958,882.90	1.92
22	601816	京沪高铁	906,536	5,593,327.12	0.90
23	688266	泽璟制药	12,600	1,050,966.00	0.17
24	688399	硕世生物	2,290	636,620.00	0.10
25	688037	芯源微	3,028	384,858.80	0.06
26	688100	威胜信息	11,602	300,723.84	0.05
27	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.03

28	688159	有方科技	3,341	176,170.93	0.03
29	688555	泽达易盛	3,004	170,627.20	0.03
30	688178	万德斯	3,704	147,789.60	0.02
31	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.02
32	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.02
33	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.02
34	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.02
35	002989	中天精装	980	55,056.40	0.01
36	300837	浙矿股份	737	33,187.11	0.01
37	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
38	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
39	300838	浙江力诺	909	22,243.23	0.00
40	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
41	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
42	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
43	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
44	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
45	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
46	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
47	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

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	603881	数据港	72,855,401.18	16.36
2	603658	安图生物	72,097,642.70	16.19
3	600183	生益科技	65,312,845.60	14.67
4	002080	中材科技	61,232,481.45	13.75
5	300750	宁德时代	60,974,655.86	13.70
6	600031	三一重工	60,299,039.66	13.54
7	688111	金山办公	49,567,561.00	11.13
8	300433	蓝思科技	48,145,154.99	10.81
9	300737	科顺股份	45,722,814.00	10.27
10	603538	美诺华	44,874,936.93	10.08
11	000977	浪潮信息	42,378,248.60	9.52

12	002439	启明星辰	42,232,981.10	9.49
13	600754	锦江酒店	42,136,755.44	9.46
14	300054	鼎龙股份	39,867,476.75	8.95
15	600521	华海药业	37,767,232.10	8.48
16	300715	凯伦股份	37,187,300.54	8.35
17	000725	京东方 A	37,039,974.00	8.32
18	002541	鸿路钢构	36,732,242.97	8.25
19	600114	东睦股份	36,676,621.67	8.24
20	300427	红相股份	36,507,829.06	8.20
21	000656	金科股份	35,201,418.85	7.91
22	600801	华新水泥	34,996,644.90	7.86
23	603338	浙江鼎力	34,962,394.20	7.85
24	600703	三安光电	34,057,122.08	7.65
25	688166	博瑞医药	33,733,414.78	7.58
26	603890	春秋电子	33,702,886.63	7.57
27	300709	精研科技	33,686,597.00	7.57
28	000997	新大陆	33,418,239.80	7.51
29	002413	雷科防务	33,208,136.69	7.46
30	002460	赣锋锂业	32,417,021.50	7.28
31	600845	宝信软件	32,362,731.44	7.27
32	600118	中国卫星	31,559,162.70	7.09
33	603456	九洲药业	31,364,170.70	7.04
34	603601	再升科技	31,232,609.58	7.02
35	000758	中色股份	30,993,857.31	6.96
36	600802	福建水泥	30,934,580.60	6.95
37	300760	迈瑞医疗	30,825,867.50	6.92
38	300677	英科医疗	30,750,860.00	6.91
39	603019	中科曙光	30,653,581.26	6.88
40	002233	塔牌集团	30,410,054.43	6.83
41	601899	紫金矿业	30,387,317.86	6.83
42	002352	顺丰控股	29,953,222.00	6.73
43	000877	天山股份	29,113,507.09	6.54
44	603259	药明康德	28,911,461.53	6.49
45	603283	赛腾股份	28,784,261.00	6.47
46	601238	广汽集团	28,733,760.10	6.45
47	600984	建设机械	28,681,169.80	6.44

48	002600	领益智造	27,446,447.99	6.16
49	300383	光环新网	26,133,224.09	5.87
50	603129	春风动力	26,074,543.00	5.86
51	000063	中兴通讯	25,667,760.00	5.77
52	600884	杉杉股份	25,418,006.53	5.71
53	300759	康龙化成	25,257,040.39	5.67
54	600160	巨化股份	24,690,367.48	5.55
55	300655	晶瑞股份	24,392,458.81	5.48
56	300738	奥飞数据	24,245,791.40	5.45
57	688358	祥生医疗	24,097,610.00	5.41
58	000401	冀东水泥	23,723,026.56	5.33
59	688388	嘉元科技	23,646,537.61	5.31
60	002594	比亚迪	23,545,924.68	5.29
61	002410	广联达	23,499,387.37	5.28
62	603317	天味食品	23,421,938.38	5.26
63	300294	博雅生物	23,341,416.73	5.24
64	601139	深圳燃气	23,053,291.46	5.18
65	002475	立讯精密	22,955,491.09	5.16
66	002912	中新赛克	21,950,864.14	4.93
67	002332	仙琚制药	20,570,492.76	4.62
68	300059	东方财富	20,568,291.58	4.62
69	000546	金圆股份	20,179,632.00	4.53
70	002212	南洋股份	19,974,904.00	4.49
71	603613	国联股份	19,927,102.60	4.48
72	002129	中环股份	19,902,005.88	4.47
73	300144	宋城演艺	19,744,907.60	4.43
74	603839	安正时尚	19,450,230.40	4.37
75	603826	坤彩科技	18,349,908.70	4.12
76	300782	卓胜微	18,345,970.00	4.12
77	000002	万科 A	17,708,431.31	3.98
78	300639	凯普生物	17,508,781.18	3.93
79	601318	中国平安	17,325,826.27	3.89
80	000998	隆平高科	17,321,466.22	3.89
81	300248	新开普	17,277,718.45	3.88
82	002947	恒铭达	17,200,004.90	3.86
83	300073	当升科技	17,136,920.60	3.85

84	603939	益丰药房	17,131,851.00	3.85
85	603686	龙马环卫	16,639,224.60	3.74
86	000786	北新建材	16,583,937.90	3.72
87	002511	中顺洁柔	16,571,859.78	3.72
88	600486	扬农化工	16,569,140.85	3.72
89	603160	汇顶科技	16,305,398.86	3.66
90	300769	德方纳米	14,890,716.00	3.34
91	300463	迈克生物	14,696,874.80	3.30
92	300408	三环集团	13,852,781.00	3.11
93	002970	锐明技术	13,582,846.37	3.05
94	002422	科伦药业	13,457,453.38	3.02
95	600449	宁夏建材	13,449,802.90	3.02
96	002975	博杰股份	13,310,652.00	2.99
97	688023	安恒信息	12,621,423.16	2.83
98	603387	基蛋生物	11,997,147.20	2.69
99	300595	欧普康视	11,985,158.40	2.69
100	688106	金宏气体	11,539,042.22	2.59
101	600882	妙可蓝多	11,537,394.91	2.59
102	601021	春秋航空	11,512,360.00	2.59

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	300750	宁德时代	64,275,572.39	14.44
2	600754	锦江酒店	63,437,651.17	14.25
3	600183	生益科技	60,977,636.80	13.70
4	600031	三一重工	60,259,377.00	13.53
5	603881	数据港	58,263,833.88	13.09
6	601899	紫金矿业	57,800,724.96	12.98
7	002439	启明星辰	56,775,528.95	12.75
8	600114	东睦股份	53,834,304.92	12.09
9	300433	蓝思科技	48,651,995.69	10.93
10	002233	塔牌集团	47,505,858.37	10.67
11	300715	凯伦股份	47,446,024.72	10.66
12	688166	博瑞医药	47,010,833.26	10.56

13	603658	安图生物	46,634,109.20	10.47
14	000977	浪潮信息	44,561,577.65	10.01
15	300709	精研科技	44,292,023.43	9.95
16	300054	鼎龙股份	42,815,735.11	9.62
17	002212	南洋股份	42,297,998.67	9.50
18	002600	领益智造	39,144,771.00	8.79
19	300677	英科医疗	38,524,354.25	8.65
20	000786	北新建材	38,498,592.05	8.65
21	603601	再升科技	38,242,154.29	8.59
22	002912	中新赛克	37,871,571.19	8.51
23	600845	宝信软件	37,447,311.01	8.41
24	002460	赣锋锂业	34,306,732.35	7.71
25	002080	中材科技	33,297,230.42	7.48
26	000656	金科股份	33,292,174.01	7.48
27	688111	金山办公	32,543,240.44	7.31
28	300427	红相股份	32,346,119.05	7.27
29	600802	福建水泥	31,950,354.02	7.18
30	603456	九洲药业	31,927,091.74	7.17
31	600801	华新水泥	31,377,015.43	7.05
32	300760	迈瑞医疗	31,359,015.46	7.04
33	600118	中国卫星	30,940,141.39	6.95
34	603613	国联股份	30,033,353.00	6.75
35	600486	扬农化工	29,394,483.04	6.60
36	603259	药明康德	28,778,646.76	6.46
37	600703	三安光电	28,500,695.33	6.40
38	300383	光环新网	28,450,517.08	6.39
39	603019	中科曙光	28,427,970.04	6.39
40	300738	奥飞数据	28,355,326.60	6.37
41	000997	新大陆	28,338,484.40	6.37
42	000758	中色股份	28,193,879.20	6.33
43	603283	赛腾股份	28,190,826.04	6.33
44	002413	雷科防务	27,775,889.11	6.24
45	601238	广汽集团	25,883,910.87	5.81
46	688039	当虹科技	25,580,708.66	5.75
47	002970	锐明技术	25,054,212.07	5.63
48	002410	广联达	25,007,493.69	5.62
49	000063	中兴通讯	24,384,331.19	5.48
50	002475	立讯精密	24,307,006.64	5.46

51	688358	祥生医疗	24,148,276.69	5.42
52	603129	春风动力	23,505,702.00	5.28
53	603317	天味食品	23,453,373.07	5.27
54	603799	华友钴业	23,304,361.86	5.23
55	300655	晶瑞股份	23,217,216.85	5.21
56	688388	嘉元科技	23,121,943.03	5.19
57	300294	博雅生物	22,509,338.50	5.06
58	300639	凯普生物	22,464,608.50	5.05
59	603826	坤彩科技	22,109,655.85	4.97
60	300124	汇川技术	22,064,493.00	4.96
61	601139	深圳燃气	21,954,956.67	4.93
62	600160	巨化股份	21,585,746.40	4.85
63	002332	仙琚制药	21,524,614.00	4.83
64	300059	东方财富	21,399,925.12	4.81
65	000401	冀东水泥	21,215,988.00	4.77
66	603839	安正时尚	19,948,627.20	4.48
67	000877	天山股份	19,921,891.37	4.47
68	300115	长盈精密	19,896,876.01	4.47
69	000546	金圆股份	19,285,539.00	4.33
70	300144	宋城演艺	19,037,115.00	4.28
71	603686	龙马环卫	18,864,900.20	4.24
72	300737	科顺股份	18,807,541.00	4.22
73	002129	中环股份	18,733,024.00	4.21
74	300782	卓胜微	17,785,919.00	3.99
75	300618	寒锐钴业	17,444,530.50	3.92
76	688023	安恒信息	17,236,111.62	3.87
77	000002	万科 A	17,188,614.98	3.86
78	601318	中国平安	16,966,797.36	3.81
79	300014	亿纬锂能	16,674,661.00	3.75
80	002511	中顺洁柔	16,487,535.93	3.70
81	600521	华海药业	16,232,374.20	3.65
82	300073	当升科技	16,219,345.00	3.64
83	000998	隆平高科	16,058,456.00	3.61
84	600449	宁夏建材	15,952,159.98	3.58
85	603939	益丰药房	15,830,225.63	3.56
86	603160	汇顶科技	15,358,867.00	3.45
87	603538	美诺华	15,257,525.60	3.43
88	603583	捷昌驱动	15,202,876.15	3.41

89	300450	先导智能	15,007,871.00	3.37
90	300248	新开普	14,946,865.93	3.36
91	300463	迈克生物	14,856,503.00	3.34
92	002001	新和成	14,116,193.06	3.17
93	002422	科伦药业	13,155,318.00	2.95
94	002975	博杰股份	12,859,558.00	2.89
95	300408	三环集团	12,805,638.23	2.88
96	688106	金宏气体	12,412,162.68	2.79
97	300595	欧普康视	12,186,457.00	2.74
98	600882	妙可蓝多	11,077,079.00	2.49
99	603890	春秋电子	10,978,960.46	2.47
100	603387	基蛋生物	10,801,864.00	2.43
101	601021	春秋航空	10,791,014.00	2.42
102	688008	澜起科技	10,681,444.74	2.40
103	300502	新易盛	9,760,408.98	2.19

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	2,926,051,422.22
卖出股票收入（成交）总额	2,928,913,836.20

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）	190,950.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	190,950.00	0.03

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	132022	20 广版 EB	1,900	190,950.00	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：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	358,537.80
2	应收证券清算款	19,869,390.28
3	应收股利	-

4	应收利息	8,008.01
5	应收申购款	1,790,593.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,026,529.69

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

份额级别	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
华泰保兴吉年丰 A	4,962	34,048.36	123,539,623.21	73.12%	45,408,341.28	26.88%
华泰保兴吉年丰 C	4,797	32,287.28	133,638,602.79	86.28%	21,243,483.03	13.72%
合计	9,306	34,797.99	257,178,226.00	79.42%	66,651,824.31	20.58%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华泰保兴吉年丰 A	2,774,293.66	1.64%
	华泰保兴吉年丰 C	697,952.15	0.45%
	合计	3,472,245.81	1.07%

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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华泰保兴吉年丰 A	10~50
	华泰保兴吉年丰 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰保兴吉年丰 A	>100
	华泰保兴吉年丰 C	0
	合计	>100

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	发起份额总数	发起份额占基金总份额	发起份额承诺持有期限

		比例（%）		比例（%）	
基金管理人固有资金	10,870,738.81	3.36	10,000,200.00	3.09	自基金合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,870,738.81	3.36	10,000,200.00	3.09	-

注：本基金发起份额承诺的持有期限已满 3 年。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰保兴吉年丰 A	华泰保兴吉年丰 C
基金合同生效日（2017 年 3 月 24 日）基金份额总额	70,763,045.37	45,094,569.77
本报告期期初基金份额总额	176,833,482.87	136,404,864.80
本报告期基金总申购份额	115,110,106.40	87,951,630.46
减:本报告期基金总赎回份额	122,995,624.78	69,474,409.44
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	168,947,964.49	154,882,085.82

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，基金管理人无重大人事变动。
2. 本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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，无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼。
本报告期内，无涉及本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苏亚金诚会计师事务所（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，本基金管理人及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚等情况。
本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	1,042,527,135.86	17.86%	741,551.37	17.86%	-
东方证券	2	756,522,680.33	12.96%	538,114.93	12.96%	-
广发证券	2	719,173,171.59	12.32%	511,540.07	12.32%	-

国泰君安	2	667,911,383.52	11.44%	475,089.43	11.44%	-
长江证券	2	632,710,299.55	10.84%	450,044.30	10.84%	-
申万证券	2	585,447,781.74	10.03%	416,422.61	10.03%	-
海通证券	2	553,000,442.57	9.47%	393,347.26	9.47%	-
国盛证券	2	449,795,682.53	7.71%	319,938.64	7.71%	-
中金	2	220,589,377.76	3.78%	156,910.09	3.78%	-
东北证券	2	120,130,346.07	2.06%	85,447.59	2.06%	-
天风证券	2	89,450,173.30	1.53%	63,625.60	1.53%	-
长城证券	2	-	-	-	-	本报告期退租
中信建投	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，基金管理人对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	-	-	-	-	-	-
东方证券	2,990,366.04	78.97%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

国泰君安	796,133.43	21.03%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中金	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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关于旗下基金 2019 年第 4 季度报告的提示性公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2020 年 1 月 21 日
2	华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	管理人网站	2020 年 1 月 21 日
3	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金春节假期延长期间交易规则调整的提示性公告	管理人网站	2020 年 1 月 31 日
4	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加上海长量基金销售有限公司为销售机构及开通认/申购、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及管理人网站	2020 年 3 月 7 日
5	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	2020 年 3 月 17 日
6	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及管理人网站	2020 年 3 月 19 日
7	华泰保兴基金管理有限公司关于延迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及管理人网站	2020 年 3 月 28 日

8	华泰保兴基金管理有限公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告	管理人网站	2020 年 3 月 30 日
9	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加上海陆金所基金销售有限公司为销售机构及开通认/申购、定投业务并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及管理人网站	2020 年 4 月 3 日
10	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 1 季度报告的提示性公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2020 年 4 月 22 日
11	华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	管理人网站	2020 年 4 月 22 日
12	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金 2019 年年度报告的提示性公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》	2020 年 4 月 24 日
13	华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金 2019 年年度报告	管理人网站	2020 年 4 月 24 日
14	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加中信证券华南股份有限公司为销售机构及开通认/申购、转换、定投业务并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及管理人网站	2020 年 4 月 30 日
15	华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加大连网金基金销售有限公司为销售机构及开通认/申购、定投、转换业务并参加其费率优惠活动的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及管理人网站	2020 年 5 月 16 日
16	华泰保兴基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及管理人网站	2020 年 6 月 4 日
17	华泰保兴基金管理有限公司关于增加注册资本及股权变更的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》及管理人网站	2020 年 6 月 4 日
18	华泰保兴基金管理有限公司关于直销柜台及公司办公地	《中国证券报》《上海证券报》《证券时	2020 年 6 月 8 日

	址变更的公告	报》《证券日报》及管理人网站	

§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	20200101-20200630	85,621,675.08	13,636,983.50	0.00	99,258,658.58	30.65%
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：申购份额含红利再投、转换入份额。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、《华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金基金合同》

3、《华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金托管协议》

4、《华泰保兴吉年丰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、报告期内本基金在规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

基金管理人办公地址（上海市浦东新区博成路 1101 号华泰金融大厦 9 层）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办公地址及基金托管人住所免费查阅

2、登录基金管理人网站 www.ehuataifund.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

2020 年 8 月 29 日