

**华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金**  
**2022 年中期报告**  
**2022 年 6 月 30 日**

基金管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十一日

## 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 2022 年 8 月 30 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>5 托管人报告</b> .....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
<b>7 投资组合报告</b> .....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
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 本基金投资股指期货的投资政策.....	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 本报告期投资基金情况.....	52
7.13 投资组合报告附注.....	53
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	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.....	55
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动.....</b>	<b>55</b>
<b>10</b>	<b>重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
10.1	基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4	基金投资策略的改变.....	56
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	56
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
10.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	56
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.9	其他重大事件.....	57
<b>11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>59</b>
<b>12</b>	<b>备查文件目录.....</b>	<b>60</b>
12.1	备查文件目录.....	60
12.2	存放地点.....	60
12.3	查阅方式.....	60

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金	
基金简称	华泰紫金智能量化股票发起	
基金主代码	005502	
交易代码	005502	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 2 月 1 日	
基金管理人	华泰证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	29,149,609.73 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰紫金智能量化股票发起 A	华泰紫金智能量化股票发起 C
下属分级基金的交易代码	005502	014629
报告期末下属分级基金的份额总额	29,135,283.12 份	14,326.61 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化选股模型精选股票，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	管理人先根据宏观分析和市场判断确定大类资产的配置，然后充分利用量化模型，先将原始行业数据进行深层次的加工、计算，建立各个行业的分析逻辑，再通过模型构造，建立起因子分析框架，然后挖掘数据形成因子，通过因子拟合趋势，进行回溯和验证，从而挖掘出不同行业的敏感因子，提取合成不同行业的观察指标，结合管理人线下的研究进行行业配置和个券选择，构建合理的投资组合。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*90%+上证国债指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，基金的预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。

### 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		华泰证券（上海）资产管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	白海燕	许俊
	联系电话	4008895597	010-66594319
	电子邮箱	baihaiyan@htsc.com	fcid@bankofchina.com

客户服务电话	4008895597	95566
传真	021-28972120	010-66594942
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区基 隆路6号1222室	北京市复兴门内大街1号
办公地址	中国(上海)自由贸易试验区东 方路18号21楼	北京市复兴门内大街1号
邮政编码	200120	100818
法定代表人	崔春	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	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	htamc.htsc.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、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	华泰证券(上海)资产管理有限公 司	中国(上海)自由贸易试验区东方路 18 号 21 楼

## 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（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）	
	华泰紫金智能量化股票 发起 A	华泰紫金智能量化股票发 起 C
本期已实现收益	-1,424,687.48	-3,751.15
本期利润	-4,095,562.26	-42,373.90
加权平均基金份额本期利润	-0.1392	-0.3148
本期加权平均净值利润率	-10.93%	-23.27%
本期基金份额净值增长率	-9.40%	-4.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	华泰紫金智能量化股票发 起 A	华泰紫金智能量化股票发起 C
期末可供分配利润	9,490,459.62	5,449.82
期末可供分配基金份额利润	0.3257	0.3804
期末基金资产净值	38,625,742.74	19,776.43

期末基金份额净值	1.3257	1.3804
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	华泰紫金智能量化股票发起 A	华泰紫金智能量化股票发起 C
基金份额累计净值增长率	32.57%	-4.81%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用（例如，开放式基金的转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、期末可供分配利润采用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。

### 3.2 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

华泰紫金智能量化股票发起 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	9.63%	0.98%	8.10%	0.94%	1.53%	0.04%
过去三个月	6.53%	1.38%	4.84%	1.33%	1.69%	0.05%
过去六个月	-9.40%	1.40%	-8.73%	1.32%	-0.67%	0.08%
过去一年	-10.50%	1.22%	-10.47%	1.09%	-0.03%	0.13%
过去三年	44.68%	1.28%	20.04%	1.13%	24.64%	0.15%
自基金合同生效起至今	32.57%	1.24%	7.16%	1.19%	25.41%	0.05%

华泰紫金智能量化股票发起 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	9.62%	0.98%	8.10%	0.94%	1.52%	0.04%
过去三个月	6.49%	1.38%	4.84%	1.33%	1.65%	0.05%
自基金合同生效起至今	-4.81%	1.44%	-8.44%	1.32%	3.63%	0.12%

注：本基金自 2022 年 1 月 5 日起增设 C 类份额，C 类份额净值增长率自基金合同生效起至今为自 2022 年 1 月 5 日起算。

#### 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

华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金

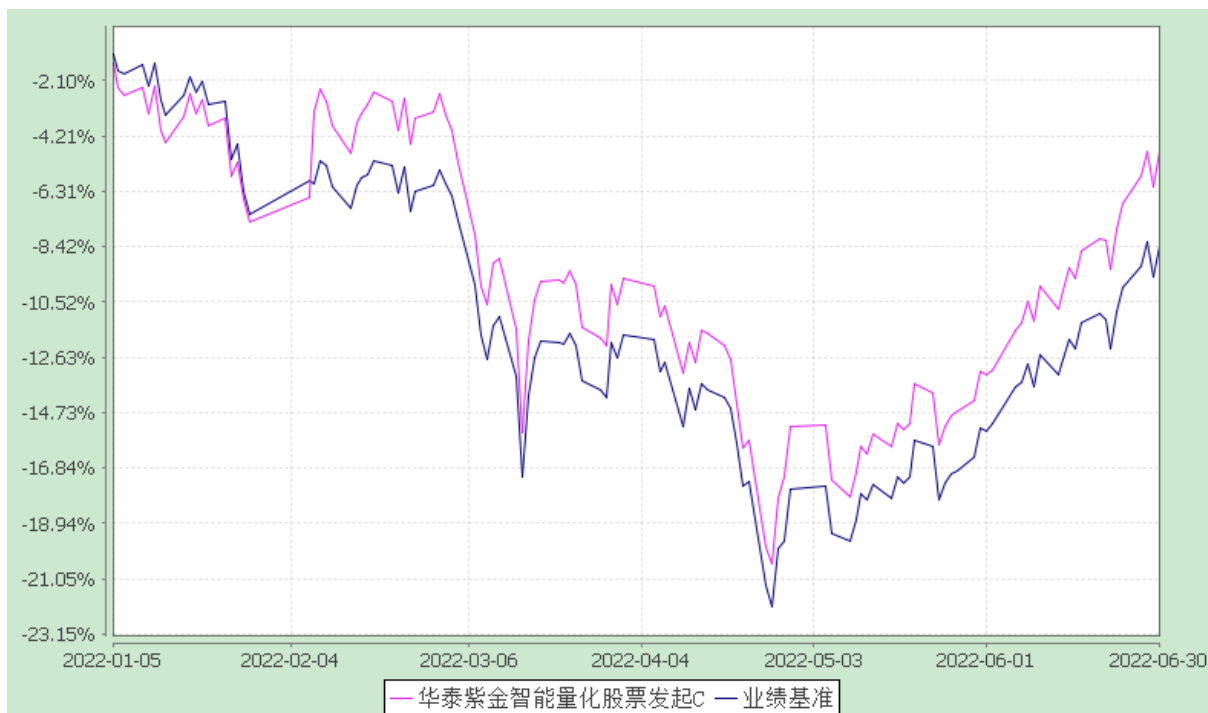
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018 年 2 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日)

华泰紫金智能量化股票发起 A



华泰紫金智能量化股票发起 C



注：1、本基金业绩比较基准收益率=中证 800 指数收益率\*90%+上证国债指数收益率\*10%；  
2、本基金合同于 2018 年 2 月 1 日生效，自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。



3、本基金自 2022 年 1 月 5 日起增设 C 类份额。

## 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

华泰证券（上海）资产管理有限公司是经中国证监会证监许可 [2014] 679 号文批准，由华泰证券股份有限公司设立的全资资产管理子公司。2014 年 10 月成立时，注册资本 3 亿元人民币。2015 年 10 月增加注册资本至 10 亿元人民币。2016 年 7 月增加注册资本至 26 亿元人民币。2016 年 7 月，公司经中国证监会证监许可[2016]1682 号文批准，获得公开募集证券投资基金管理业务资格。公司主要业务为证券资产管理业务、公开募集证券投资基金业务及中国证监会批准的其它业务。

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理华泰紫金智惠债券型证券投资基金、华泰紫金智盈债券型证券投资基金、华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金、华泰紫金季季享定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰紫金丰泰纯债债券型发起式证券投资基金、华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金、华泰紫金丰利中短债债券型发起式证券投资基金、华泰紫金泰盈混合型证券投资基金、华泰紫金月月购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、华泰紫金周周购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、华泰紫金智鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰紫金周周购 12 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、华泰紫金丰安 27 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰紫金丰睿债券型发起式证券投资基金、华泰紫金丰和偏债混合型发起式证券投资基金、华泰紫金月月发 1 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、华泰紫金信息科技主题 6 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰紫金中证细分食品饮料产业主题指数型发起式证券投资基金、华泰紫金周周购 6 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、华泰紫金智享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰紫金中证细分化工产业主题指数型发起式证券投资基金、华泰紫金中证医药 50 指数型发起式证券投资基金、华泰紫金科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、华泰紫金天天金交易型货币市场基金、华泰紫金天天发货币市场基金、华泰紫金货币增利货币市场基金二十七只证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		

毛甜	本基金的基金经理	2018-03-10	-	12	毛甜女士，武汉大学金融工程硕士。2010 年至 2012 年曾任国信证券经济研究所金融工程部助理分析师；2012 年至 2017 年任职光大富尊投资有限公司，历任量化研究员、量化投资经理。2017 年 7 月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司，2017 年 12 月起陆续担任华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金、华泰紫金中证细分食品饮料产业主题指数型发起式证券投资基金等基金的基金经理。
----	----------	------------	---	----	---

注：1、上述基金经理的任职日期及离任日期均以基金公告为准；首任基金经理的任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划的投资经理情况。

#### 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》等有关法律法规、中国证监会和《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 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

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个基金组合。

公司建立了公募基金投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司股票池和债券库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的监控、分析评估、监察稽核

和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动和环节得到公平对待，各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发现任何违反公平交易的行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

### 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

今年年初，经济下行、美联储加息以国内疫情多点散发给市场带来了多重压力，A 股各主要指数大幅下跌，且外资显著流出，市场情绪极度悲观，市场的主要交易逻辑为稳增长及通胀，且整体偏防御，因此，风格方面，价值风格占主导，周期及金融地产表现较好，3、4 月份，市场在地缘政治及上海疫情的冲击下再次深度下跌，估值也回落至底部区域，4 月底随着疫情形势的好转以及国内一系列稳增长政策的发力，市场情绪开始回暖，在流动性宽松的驱动下，A 股开启了一轮强有力的反弹。截止本报告期末，上证综指下跌 6.63%，深证成份指数下跌 13.20%，沪深 300 指数下跌 9.22%，中证 800 指数下跌 9.97%，在操作上，本基金利用量化模型精选个股，辅以量化行业轮动及事件驱动策略，严格遵守基金合同，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金 A 类份额净值增长率为-9.40%，同期业绩比较基准收益率为-8.73%；本基金 C 类份额净值增长率为-4.81%，同期业绩比较基准收益率为-8.44%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，A 股在中美经济及政策周期的错位背景下估值和盈利相对更有支撑，具有比较优势，对下半年市场谨慎乐观，市场主线预计围绕交易海外衰退及国内复苏展开。行业配置方面，重点关注以下几条主线：“稳增长”受益板块，如基建、地产板块及相关产业链；高景气板块：新能源、新能源车产业链；消费复苏受益板块：医药、食品饮料；以及农业、休闲服务等有望底部反转的行业。管理人将依据量化模型，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值小组，公司领导担任估值小组组长，投资研究部门、运营部、交易部、风险管理部指定人员担任委员。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司以及中国证券业协会等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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

- 1、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形；
- 2、本基金已连续 60 个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元的情形，根据基金合同约定，我司已于 5 月份向中国证监会备案，拟于 6 个月内以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议本基金持续运作事项。

## 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”）在华泰紫金智能量化股票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：华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	2,279,260.79	1,779,632.77
结算备付金		12,200.36	102,828.28
存出保证金		1,682.16	95,317.77
交易性金融资产	6.4.7.2	36,517,043.66	41,176,581.70
其中：股票投资		36,498,889.95	40,579,522.00
基金投资		-	-
债券投资		18,153.71	597,059.70
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	27,293.08
应收股利		-	-
应收申购款		99.85	2,892.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	11,872.65
资产总计		38,810,286.82	43,196,419.24

负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<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		-	-
应付清算款		11,150.19	24,827.21
应付赎回款		15,044.96	17,954.97
应付管理人报酬		36,206.59	44,417.38
应付托管费		7,543.04	9,253.64
应付销售服务费		2.78	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.15	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	94,819.94	148,510.35
负债合计		164,767.65	244,963.55
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	29,149,609.73	29,351,920.57
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	9,495,909.44	13,599,535.12
净资产合计		38,645,519.17	42,951,455.69
负债和净资产总计		38,810,286.82	43,196,419.24

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 29,149,609.73 份，其中 A 类基金份额净值 1.3257 元，基金份额总额 29,135,283.12 份；C 类基金份额净值 1.3804 元，基金份额总额 14,326.61 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-3,772,359.78</b>	<b>-7,834,861.21</b>
1.利息收入		5,758.49	106,252.07
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,758.49	36,700.74
债券利息收入		-	69,551.33
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,132,339.21	-7,536,788.25
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,477,550.27	-8,872,188.30
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	7,662.22	1,633.09
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-214,720.78
股利收益	6.4.7.16	337,548.84	1,548,487.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,709,497.53	-1,205,610.82
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	63,718.47	801,285.79
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>365,576.38</b>	<b>3,649,268.36</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	227,008.40	1,754,832.23
2. 托管费	6.4.10.2.2	47,293.38	292,472.01
3. 销售服务费		361.02	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7.税金及附加		0.01	36.36
8. 其他费用	6.4.7.20	90,913.57	1,601,927.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-4,137,936.16</b>	<b>-11,484,129.57</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-4,137,936.16</b>	<b>-11,484,129.57</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-4,137,936.16</b>	<b>-11,484,129.57</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产（基金净值）	29,351,920.57	-	13,599,535.12	42,951,455.69
二、本期期初净资产（基金净值）	29,351,920.57	-	13,599,535.12	42,951,455.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-202,310.84	-	-4,103,625.68	-4,305,936.52
（一）、综合收益总额	-	-	-4,137,936.16	-4,137,936.16
（二）、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）	-202,310.84	-	34,310.48	-168,000.36
其中：1.基金申购款	8,383,443.45	-	3,049,604.14	11,433,047.59
2.基金赎回款	-8,585,754.29	-	-3,015,293.66	-11,601,047.95
（三）、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）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	29,149,609.73	-	9,495,909.44	38,645,519.17

项目	上年度可比期间			
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	58,437,321.58	-	27,423,132.42	85,860,454.00
二、本期期初净资产（基金净值）	58,437,321.58	-	27,423,132.42	85,860,454.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	110,432,557.68	-	53,852,646.17	164,285,203.85
（一）、综合收益总额	-	-	-11,484,129.57	-11,484,129.57
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	110,432,557.68	-	65,336,775.74	175,769,333.42



(净值减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	199,422,929.43	-	112,619,764.29	312,042,693.72
2.基金赎回款	-88,990,371.75	-	-47,282,988.55	-136,273,360.30
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	168,869,879.26	-	81,275,778.59	250,145,657.85

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：

基金管理人负责人：聂挺进，主管会计工作负责人：刘玉生，会计机构负责人：白海燕

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华泰紫金智能量化股票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”)《关于准予华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金注册的批复》(证监许可[2017]1224号)批准，由华泰证券(上海)资产管理有限公司(以下简称“华泰资管”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2018 年 2 月 1 日生效。本基金为契约型开放式发起式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 343,068,498.19 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰资管，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。该资金已由毕马威华振会计师事务所审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金合同》和《华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定，本基金投资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(包括创业板、中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具(含同业存单)、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基

金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率\*90%+上证国债指数收益率\*10%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 的财务状况及 2022 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 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

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)和 2022 年中国证监会发布的修订的《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>》。

##### (a) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及 (3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益

的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的商业模式及该资产

的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、

贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金

融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信

用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认

时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终

止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金

融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收

益或其他综合收益。

执行新金融工具准则对 2022 年 1 月 1 日本基金资产负债表各项目的影

响汇总如下：

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结

算备付金、存出保证金、应收清算款、应收利息和应收申购款，对应的账面价值分别为人民币

1,779,632.77 元、102,828.28 元、95,317.77 元、27,293.08 元、11,872.65 元和 2,892.99 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算

备付金、存出保证金、应收清算款和应收申购款，对应的账面价值分别为人民币 1,779,820.89 元、

102,878.91 元、95,364.96 元、27,293.08 元和 2,892.99 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金

融资产为交易性金融资产，对应的账面价值分别为人民币 41,176,581.70 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金

融资产为交易性金融资产，对应的账面价值分别为人民币 41,188,168.41 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、

应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债，对应的账面价值分别为

人民币 24,827.21 元、17,954.97 元、44,417.38 元、9,253.64 元、38,498.15 元和 110,012.20 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应

付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 24,827.21 元、17,954.97 元、44,417.38 元、9,253.64 和 148,510.35 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(ii) 采用“预期信用损失”模型的影响

“预期信用损失”模型适用于本基金持有的以摊余成本计量的金融资产。采用“预期信用损失”模型未对本基金 2022 年年初留存收益产生重大影响。

(b) 修订的《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>》

本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 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 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局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 号文《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 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，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 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	2,279,260.79
等于：本金	2,279,042.10
加：应计利息	218.69
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	2,279,260.79

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	38,137,800.02	-	36,498,889.95	-1,638,910.07
贵金属投资-金交所	-	-	-	-

黄金合约					
债券	交易所市场	17,039.71	3.31	18,153.71	1,110.69
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	17,039.71	3.31	18,153.71	1,110.69
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		38,154,839.73	3.31	36,517,043.66	-1,637,799.38

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

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

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.62
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,557.17
其中：交易所市场	5,557.17
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
合计	94,819.94

### 6.4.7.7 实收基金

华泰紫金智能量化股票发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	29,351,920.57	29,351,920.57
本期申购	4,697,675.43	4,697,675.43
本期赎回（以“-”号填列）	-4,914,312.88	-4,914,312.88
本期末	29,135,283.12	29,135,283.12

华泰紫金智能量化股票发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	3,685,768.02	3,685,768.02
本期赎回（以“-”号填列）	-3,671,441.41	-3,671,441.41
本期末	14,326.61	14,326.61

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 6.4.7.8 未分配利润

华泰紫金智能量化股票发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,313,754.27	2,285,780.85	13,599,535.12
本期利润	-1,424,687.48	-2,670,874.78	-4,095,562.26
本期基金份额交易产生的变动数	-66,404.51	52,891.27	-13,513.24
其中：基金申购款	1,776,827.28	-79,455.12	1,697,372.16
基金赎回款	-1,843,231.79	132,346.39	-1,710,885.40
本期已分配利润	-	-	-



本期末	9,822,662.28	-332,202.66	9,490,459.62
-----	--------------	-------------	--------------

## 华泰紫金智能量化股票发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-3,751.15	-38,622.75	-42,373.90
本期基金份额交易产生的变动数	9,386.39	38,437.33	47,823.72
其中：基金申购款	1,399,487.60	-47,255.62	1,352,231.98
基金赎回款	-1,390,101.21	85,692.95	-1,304,408.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,635.24	-185.42	5,449.82

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	5,015.45
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	253.47
其他	489.57
合计	5,758.49

## 6.4.7.10 股票投资收益

## 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,477,550.27
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,477,550.27

## 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	14,068,600.85
减：卖出股票成本总额	15,514,791.66
减：交易费用	31,359.46
买卖股票差价收入	-1,477,550.27

#### 6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,564.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,097.82
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	7,662.22

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	640,494.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	621,253.72
减：应计利息总额	13,143.03
减：交易费用	0.03
买卖债券差价收入	6,097.82

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	337,548.84
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	337,548.84

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-2,709,497.53
——股票投资	-2,710,802.24
——债券投资	1,304.71
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	-2,709,497.53

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	63,718.47
合计	63,718.47

### 6.4.7.19 持有基金产生的费用

本基金本报告期无持有基金产生的费用。

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行手续费	1,653.42
合计	90,913.57

### 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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

本基金本报告期内存在控制关系或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
华泰证券(上海)资产管理有限公司	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
华泰证券股份有限公司（以下简称“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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，并以一般交易价格为定价基础。

### 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

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	-	-	638,182,943.77	40.16%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	-	-	8,160,898.41	100.00%

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	49,986.96	22.61%	49,986.96	8.03%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用华泰证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从华泰证券获得证券研究综合服务。

## 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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	227,008.40	1,754,832.23
其中：支付销售机构的客户维护费	62,648.34	160,645.75

注：本基金的基金管理费按前一日基金资产净值 1.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.2\% / \text{当年天数}$$

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	47,293.38	292,472.01

注：本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

### 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 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰紫金智能量化 股票发起 A	华泰紫金智能量化股票 发起 C	合计
华泰证券资管	-	351.62	351.62
合计	-	351.62	351.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	华泰紫金智能量化 股票发起A	华泰紫金智能量化股票 发起C	合计
合计	-	-	-

注：支付销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数，本基金销售服务费年费率按 0.20% 计算。

#### 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

本期及上年度可比期间，本基金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

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本期及上年度可比期间，本基金未参与转融通证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本期及上年度可比期间，本基金未参与转融通证券出借业务。

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	华泰紫金智能量化 股票发起A	华泰紫金智能量化 股票发起C	华泰紫金智能量化 股票发起A	华泰紫金智能量化 股票发起C
基金合同生效日 (2018年2月1日) 持有的基金份额	10,000,900.09	-	10,000,900.09	-
期初持有的基金份额	10,000,900.09	-	10,000,900.09	-
期间申购/买入总份 额	-	-	-	-
期间因拆分变动份 额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出 总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份 额	10,000,900.09	-	10,000,900.09	-
期末持有的基金份 额	34.33%	-	5.92%	-

占基金总份额比例				
----------	--	--	--	--

注：期末持有的基金份额占基金总份额比例为期末持有份额占基金同类份额的比例。

#### 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

本期末及上年度末，未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021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	2,279,260.79	5,015.45	5,528,833.26	20,210.73

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期及上年度可比期间，本基金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

##### 6.4.10.8.1 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金未投资基金。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2022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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金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为 0，无抵押债券。



#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金未参与转融通证券出借业务。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票基金，其预期收益和风险均高于债券型基金、混合型基金及货币市场基金。本基金通过量化选股模型精选股票，在有效控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

公司建立健全与自身发展战略相适应的全面风险管理体系。公司全面风险管理体系包括可操作的管理制度、健全的组织架构、可靠的信息技术系统、量化的风险指标体系、专业的人才队伍、有效的风险应对机制以及良好的风险管理文化。

公司风险管理组织架构包括五个主要部分：董事会及合规与风险控制委员会，监事，公司管理层及合规与风险管理委员会，风险管理部及各类专业风险管理部门、各其他职能部门以及业务部门。

公司董事会是风险管理的最高决策机构，承担公司全面风险管理体系的最终责任。董事会下设合规与风险控制委员会，主要负责审议公司风险管理制度、风险偏好、风险容忍度和风险评估报告。公司监事承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和管理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。公司管理层对全面风险管理承担主要责任，负责制度及完善公司风险管理制度，建立健全公司全面风险管理的经营管理架构，制定风险偏好、风险容忍度并定期评估公司整体风险。公司管理层下设合规与风险管理委员会，负责批准适合各项业务发展的风险管理政策，提升公司风险管理的有效性，研究制定重大事件、重大决策和重要业务流程的风险评估报告以及重大风险的解决方案，审议公司定期和临时风险报告，指导风险管理相关部门工作等。公司设首席风险官，负责分管领导全面风险管理工作，公司保障首席风险官能够充分行使履行职责所必要的知情权，同时保障首席风险官的独立性。公司指定风险管理部与合规稽核部履行全面风险管理职责，包括牵头建立完善公司全面风险管理体系，牵头管理公司的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险和法律风险，监测、计量、评估、报告公司整体风险水平和风险资本运用及牵头应对和处置公

司层面重大风险事件。

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估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而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特征通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在商业信誉良好的股份制银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。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，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 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 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
AAA	18,153.71	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	597,059.70
合计	18,153.71	597,059.70

注：1、持有发行期限在一年以上的债券按其债项评级作为长期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为短期信用评级进行列示；

2、未评级部分为国债，本期末持有的债券均为可转债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持大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，因此除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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资产的公允价值。

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，并同时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，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，有效保障基金持有人利益。

#### 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 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综合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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的证券不得超过该证券的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。

综合上述各项流动性指标的监测结果以及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内的流动性情况良好。

#### 6.4.13.4.2 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。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。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。

##### 6.4.13.4.2.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,279,260.79	-	-	-	2,279,260.79
结算备付金	12,200.36	-	-	-	12,200.36
存出保证金	1,682.16	-	-	-	1,682.16
交易性金融资产	-	15,773.81	2,379.90	36,498,889.95	36,517,043.66
应收申购款	-	-	-	99.85	99.85
应收清算款	-	-	-	-	-
资产总计	2,293,143.31	15,773.81	2,379.90	36,498,989.80	38,810,286.82
负债					
应付赎回款	-	-	-	15,044.96	15,044.96
应付管理人报酬	-	-	-	36,206.59	36,206.59
应付托管费	-	-	-	7,543.04	7,543.04
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	2.78	2.78

应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.15	0.15
应付清算款	-	-	-	11,150.19	11,150.19
其他负债	-	-	-	94,819.94	94,819.94
负债总计	-	-	-	164,767.65	164,767.65
利率敏感度缺口	2,293,143.31	15,773.81	2,379.90	36,334,222.15	38,645,519.17
<b>上年度末</b>					
<b>2021 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	1,779,632.77	-	-	-	1,779,632.77
结算备付金	102,828.28	-	-	-	102,828.28
存出保证金	95,317.77	-	-	-	95,317.77
交易性金融资产	597,059.70	-	-	40,579,522.00	41,176,581.70
应收利息	-	-	-	11,872.65	11,872.65
应收申购款	-	-	-	2,892.99	2,892.99
应收证券清算款	-	-	-	27,293.08	27,293.08
资产总计	2,574,838.52	-	-	40,621,580.72	43,196,419.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	17,954.97	17,954.97
应付管理人报酬	-	-	-	44,417.38	44,417.38
应付托管费	-	-	-	9,253.64	9,253.64
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	38,498.15	38,498.15
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	24,827.21	24,827.21
其他负债	-	-	-	110,012.20	110,012.20
负债总计	-	-	-	244,963.55	244,963.55
利率敏感度缺口	2,574,838.52	-	-	40,376,617.17	42,951,455.69

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.2.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；2.该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；3.该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；4.银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产的利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响。		
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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25BP	219.56	183.65
	市场利率上升 25BP	-216.39	-183.54

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.4 其他价格风险

基金承受的其他市场价格风险，主要是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币汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

##### 6.4.13.4.4.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	36,498,889.9 5	94.45	40,579,522.00	94.48

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	18,153.71	0.05	597,059.70	1.39
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	36,517,043.66	94.49	41,176,581.70	95.87

#### 6.4.13.4.4.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；2.以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	2,740,134.48	3,682,973.68
	业绩比较基准下降5%	-2,740,134.48	-3,682,973.68

注：本基金管理人运用资产-资本定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	36,517,043.66
第二层次	-
第三层次	-
合计	36,517,043.66

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金持有的金融工具公允价值所属层次间未发生重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末：无)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于报告期末，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## 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	36,498,889.95	94.04
	其中：股票	36,498,889.95	94.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,153.71	0.05



	其中：债券	18,153.71	0.05
	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	2,291,461.15	5.90
8	其他各项资产	1,782.01	0.00
9	合计	38,810,286.82	100.00

注：1、本基金报告期末未持有港股通股票。

2、本基金报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 7.2 报告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

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	569,747.80	1.47
B	采矿业	1,321,473.00	3.42
C	制造业	21,751,556.01	56.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,219,751.44	3.16
E	建筑业	769,707.00	1.99
F	批发和零售业	285,244.48	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	892,676.00	2.31
H	住宿和餐饮业	89,917.44	0.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	859,505.52	2.22
J	金融业	6,205,996.68	16.06
K	房地产业	1,042,118.00	2.70
L	租赁和商务服务业	462,981.00	1.20
M	科学研究和技术服务业	491,896.00	1.27
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	348,557.58	0.90
R	文化、体育和娱乐业	187,762.00	0.49
S	综合	-	-
	合计	36,498,889.95	94.45

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 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	600519	贵州茅台	900.00	1,840,500.00	4.76
2	300750	宁德时代	2,000.00	1,068,000.00	2.76
3	600048	保利发展	48,100.00	839,826.00	2.17
4	000425	徐工机械	142,400.00	767,536.00	1.99
5	600036	招商银行	18,000.00	759,600.00	1.97
6	601012	隆基绿能	10,125.00	674,628.75	1.75
7	601318	中国平安	12,800.00	597,632.00	1.55
8	000858	五粮液	2,835.00	572,471.55	1.48
9	002142	宁波银行	14,492.00	518,958.52	1.34
10	002594	比亚迪	1,500.00	500,235.00	1.29
11	000333	美的集团	7,100.00	428,769.00	1.11
12	300638	广和通	15,810.00	418,806.90	1.08
13	000568	泸州老窖	1,600.00	394,464.00	1.02
14	300059	东方财富	14,928.00	379,171.20	0.98
15	601166	兴业银行	18,600.00	370,140.00	0.96
16	600030	中信证券	15,710.00	340,278.60	0.88
17	600795	国电电力	86,200.00	337,042.00	0.87
18	601888	中国中免	1,400.00	326,102.00	0.84
19	600887	伊利股份	8,200.00	319,390.00	0.83
20	600438	通威股份	5,200.00	311,272.00	0.81
21	600900	长江电力	12,487.00	288,699.44	0.75
22	002466	天齐锂业	2,300.00	287,040.00	0.74
23	002812	恩捷股份	1,100.00	275,495.00	0.71
24	300015	爱尔眼科	6,054.00	271,037.58	0.70
25	601838	成都银行	16,100.00	266,938.00	0.69
26	603259	药明康德	2,500.00	259,975.00	0.67

27	600027	华电国际	64,500.00	253,485.00	0.66
28	601225	陕西煤业	11,900.00	252,042.00	0.65
29	300760	迈瑞医疗	800.00	250,560.00	0.65
30	601398	工商银行	52,500.00	250,425.00	0.65
31	300498	温氏股份	11,600.00	246,964.00	0.64
32	601601	中国太保	10,000.00	235,300.00	0.61
33	600690	海尔智家	8,500.00	233,410.00	0.60
34	002475	立讯精密	6,900.00	233,151.00	0.60
35	002714	牧原股份	4,140.00	228,817.80	0.59
36	000776	广发证券	11,700.00	218,790.00	0.57
37	002129	TCL 中环	3,700.00	217,893.00	0.56
38	600809	山西汾酒	660.00	214,368.00	0.55
39	600309	万华化学	2,200.00	213,378.00	0.55
40	600276	恒瑞医药	5,620.00	208,445.80	0.54
41	002460	赣锋锂业	1,400.00	208,180.00	0.54
42	000001	平安银行	13,600.00	203,728.00	0.53
43	601088	中国神华	6,100.00	203,130.00	0.53
44	601669	中国电建	25,500.00	200,685.00	0.52
45	000725	京东方 A	49,700.00	195,818.00	0.51
46	601899	紫金矿业	20,600.00	192,198.00	0.50
47	600958	东方证券	18,816.00	192,111.36	0.50
48	002415	海康威视	5,300.00	191,860.00	0.50
49	601128	常熟银行	24,800.00	189,472.00	0.49
50	603986	兆易创新	1,300.00	184,873.00	0.48
51	601658	邮储银行	33,500.00	180,565.00	0.47
52	600926	杭州银行	12,000.00	179,760.00	0.47
53	600585	海螺水泥	5,000.00	176,400.00	0.46
54	300124	汇川技术	2,650.00	174,555.50	0.45
55	600884	杉杉股份	5,800.00	172,376.00	0.45
56	601668	中国建筑	31,800.00	169,176.00	0.44
57	601211	国泰君安	10,800.00	164,160.00	0.42
58	603799	华友钴业	1,690.00	161,597.80	0.42
59	002709	天赐材料	2,600.00	161,356.00	0.42
60	300274	阳光电源	1,600.00	157,200.00	0.41
61	002352	顺丰控股	2,800.00	156,268.00	0.40
62	002049	紫光国微	800.00	151,776.00	0.39
63	002271	东方雨虹	2,900.00	149,263.00	0.39
64	600436	片仔癀	400.00	142,692.00	0.37
65	000661	长春高新	600.00	140,052.00	0.36
66	000625	长安汽车	8,010.00	138,733.20	0.36
67	002371	北方华创	500.00	138,560.00	0.36
68	002839	张家港行	26,040.00	137,751.60	0.36
69	300014	亿纬锂能	1,400.00	136,500.00	0.35
70	600188	兖州煤业	3,300.00	130,284.00	0.34

71	603288	海天味业	1,430.00	129,214.80	0.33
72	601919	中远海控	9,290.00	129,131.00	0.33
73	000963	华东医药	2,800.00	126,448.00	0.33
74	601009	南京银行	12,080.00	125,873.60	0.33
75	002230	科大讯飞	3,000.00	123,660.00	0.32
76	002001	新 和 成	5,400.00	123,174.00	0.32
77	300122	智飞生物	1,100.00	122,111.00	0.32
78	603501	韦尔股份	700.00	121,121.00	0.31
79	600104	上汽集团	6,746.00	120,146.26	0.31
80	300896	爱美客	200.00	120,002.00	0.31
81	601800	中国交建	12,800.00	118,784.00	0.31
82	600760	中航沈飞	1,960.00	118,482.00	0.31
83	002241	歌尔股份	3,500.00	117,600.00	0.30
84	000100	TCL 科技	23,900.00	114,481.00	0.30
85	600893	航发动力	2,500.00	113,775.00	0.29
86	600426	华鲁恒升	3,850.00	112,420.00	0.29
87	600745	闻泰科技	1,300.00	110,643.00	0.29
88	601816	京沪高铁	22,000.00	110,440.00	0.29
89	000538	云南白药	1,820.00	109,909.80	0.28
90	002304	洋河股份	600.00	109,890.00	0.28
91	601995	中金公司	2,400.00	106,776.00	0.28
92	002736	国信证券	11,000.00	105,270.00	0.27
93	601615	明阳智能	3,100.00	104,780.00	0.27
94	300347	泰格医药	900.00	103,005.00	0.27
95	600019	宝钢股份	17,100.00	102,942.00	0.27
96	600089	特变电工	3,700.00	101,343.00	0.26
97	600660	福耀玻璃	2,400.00	100,344.00	0.26
98	603323	苏农银行	19,600.00	99,960.00	0.26
99	601628	中国人寿	3,200.00	99,456.00	0.26
100	600111	北方稀土	2,800.00	98,448.00	0.25
101	601377	兴业证券	13,900.00	97,995.00	0.25
102	600406	国电南瑞	3,624.00	97,848.00	0.25
103	002179	中航光电	1,540.00	97,512.80	0.25
104	000063	中兴通讯	3,800.00	97,014.00	0.25
105	601238	广汽集团	6,356.00	96,865.44	0.25
106	002384	东山精密	4,200.00	96,306.00	0.25
107	002027	分众传媒	14,200.00	95,566.00	0.25
108	000977	浪潮信息	3,500.00	92,680.00	0.24
109	300142	沃森生物	1,900.00	91,941.00	0.24
110	600256	广汇能源	8,600.00	90,644.00	0.23
111	600522	中天科技	3,900.00	90,090.00	0.23
112	600741	华域汽车	3,900.00	89,700.00	0.23
113	601633	长城汽车	2,400.00	88,896.00	0.23
114	002648	卫星化学	3,430.00	88,665.50	0.23

115	300450	先导智能	1,400.00	88,452.00	0.23
116	002459	晶澳科技	1,120.00	88,368.00	0.23
117	300316	晶盛机电	1,300.00	87,867.00	0.23
118	600999	招商证券	6,080.00	87,612.80	0.23
119	600010	包钢股份	37,100.00	87,185.00	0.23
120	600570	恒生电子	2,000.00	87,080.00	0.23
121	002821	凯莱英	300.00	86,700.00	0.22
122	601857	中国石油	16,300.00	86,390.00	0.22
123	000338	潍柴动力	6,900.00	86,043.00	0.22
124	688599	天合光能	1,300.00	84,825.00	0.22
125	603659	璞泰来	1,000.00	84,400.00	0.22
126	000002	万科 A	4,100.00	84,050.00	0.22
127	600703	三安光电	3,400.00	83,572.00	0.22
128	300661	圣邦股份	450.00	81,909.00	0.21
129	000733	振华科技	600.00	81,582.00	0.21
130	600346	恒力石化	3,600.00	80,064.00	0.21
131	600383	金地集团	5,800.00	77,952.00	0.20
132	603290	斯达半导	200.00	77,180.00	0.20
133	600905	三峡能源	12,200.00	76,738.00	0.20
134	600028	中国石化	18,800.00	76,704.00	0.20
135	002410	广联达	1,400.00	76,216.00	0.20
136	000786	北新建材	2,200.00	76,164.00	0.20
137	600011	华能国际	10,800.00	76,032.00	0.20
138	600332	白云山	2,400.00	75,816.00	0.20
139	601689	拓普集团	1,100.00	75,273.00	0.19
140	601939	建设银行	12,400.00	75,144.00	0.19
141	600196	复星医药	1,700.00	74,953.00	0.19
142	600018	上港集团	12,800.00	74,624.00	0.19
143	601390	中国中铁	12,100.00	74,294.00	0.19
144	600085	同仁堂	1,400.00	74,032.00	0.19
145	002920	德赛西威	500.00	74,000.00	0.19
146	600060	海信视像	5,900.00	73,750.00	0.19
147	600132	重庆啤酒	501.00	73,446.60	0.19
148	601117	中国化学	7,800.00	73,398.00	0.19
149	601600	中国铝业	15,400.00	73,150.00	0.19
150	600600	青岛啤酒	700.00	72,744.00	0.19
151	300073	当升科技	800.00	72,272.00	0.19
152	601006	大秦铁路	10,900.00	71,831.00	0.19
153	601618	中国中冶	20,500.00	71,750.00	0.19
154	600845	宝信软件	1,300.00	70,980.00	0.18
155	300363	博腾股份	900.00	70,191.00	0.18
156	000768	中航西飞	2,300.00	69,667.00	0.18
157	600176	中国巨石	4,000.00	69,640.00	0.18
158	601898	中煤能源	6,700.00	69,546.00	0.18

159	600233	圆通速递	3,400.00	69,326.00	0.18
160	601985	中国核电	10,100.00	69,286.00	0.18
161	600989	宝丰能源	4,700.00	68,855.00	0.18
162	000876	新希望	4,500.00	68,850.00	0.18
163	600547	山东黄金	3,700.00	68,672.00	0.18
164	688981	中芯国际	1,519.00	68,613.23	0.18
165	600009	上海机场	1,200.00	68,040.00	0.18
166	688202	美迪西	200.00	67,922.00	0.18
167	601138	工业富联	6,800.00	66,912.00	0.17
168	002311	海大集团	1,100.00	66,011.00	0.17
169	688005	容百科技	508.00	65,755.52	0.17
170	688800	瑞可达	517.00	65,302.27	0.17
171	000683	远兴能源	6,200.00	65,162.00	0.17
172	000807	云铝股份	6,500.00	64,220.00	0.17
173	601021	春秋航空	1,100.00	64,185.00	0.17
174	002032	苏泊尔	1,100.00	61,974.00	0.16
175	601186	中国铁建	7,800.00	61,620.00	0.16
176	603019	中科曙光	2,100.00	60,942.00	0.16
177	600050	中国联通	17,500.00	60,550.00	0.16
178	601717	郑煤机	4,200.00	60,522.00	0.16
179	002050	三花智控	2,200.00	60,456.00	0.16
180	600873	梅花生物	5,300.00	59,784.00	0.15
181	600566	济川药业	2,200.00	59,752.00	0.15
182	000166	申万宏源	13,900.00	59,631.00	0.15
183	002493	荣盛石化	3,800.00	58,482.00	0.15
184	002600	领益智造	11,600.00	58,232.00	0.15
185	000932	华菱钢铁	11,400.00	58,026.00	0.15
186	600837	海通证券	5,900.00	57,879.00	0.15
187	002555	三七互娱	2,700.00	57,321.00	0.15
188	002705	新宝股份	2,600.00	57,174.00	0.15
189	603456	九洲药业	1,100.00	56,870.00	0.15
190	300144	宋城演艺	3,700.00	56,795.00	0.15
191	601456	国联证券	4,600.00	56,442.00	0.15
192	601666	平煤股份	4,100.00	55,719.00	0.14
193	300003	乐普医疗	3,000.00	55,710.00	0.14
194	603806	福斯特	840.00	55,036.80	0.14
195	000672	上峰水泥	3,480.00	54,914.40	0.14
196	600486	扬农化工	400.00	53,312.00	0.14
197	000895	双汇发展	1,800.00	52,740.00	0.14
198	300037	新宙邦	1,000.00	52,560.00	0.14
199	000887	中鼎股份	2,844.00	51,874.56	0.13
200	002299	圣农发展	2,700.00	51,786.00	0.13
201	688388	嘉元科技	600.00	50,922.00	0.13
202	601966	玲珑轮胎	2,000.00	50,740.00	0.13

203	600588	用友网络	2,300.00	49,933.00	0.13
204	603882	金域医学	600.00	49,530.00	0.13
205	601928	凤凰传媒	6,900.00	49,335.00	0.13
206	688008	澜起科技	807.00	48,888.06	0.13
207	000708	中信特钢	2,400.00	48,360.00	0.13
208	600150	中国船舶	2,500.00	47,450.00	0.12
209	600489	中金黄金	6,400.00	47,296.00	0.12
210	002268	卫士通	1,100.00	47,201.00	0.12
211	603260	合盛硅业	400.00	47,184.00	0.12
212	300413	芒果超媒	1,400.00	46,704.00	0.12
213	003022	联泓新科	1,400.00	46,522.00	0.12
214	601877	正泰电器	1,300.00	46,514.00	0.12
215	300861	美畅股份	500.00	46,345.00	0.12
216	603606	东方电缆	600.00	45,960.00	0.12
217	688107	安路科技	662.00	45,479.40	0.12
218	000999	华润三九	1,000.00	45,000.00	0.12
219	600141	兴发集团	1,000.00	43,990.00	0.11
220	300759	康龙化成	450.00	42,849.00	0.11
221	688363	华熙生物	300.00	42,654.00	0.11
222	600507	方大特钢	6,100.00	42,639.00	0.11
223	002041	登海种业	2,000.00	42,180.00	0.11
224	002601	龙佰集团	2,100.00	42,105.00	0.11
225	600057	厦门象屿	4,700.00	41,313.00	0.11
226	603267	鸿远电子	300.00	40,299.00	0.10
227	001979	招商蛇口	3,000.00	40,290.00	0.10
228	600328	中盐化工	1,700.00	40,035.00	0.10
229	002202	金风科技	2,700.00	39,960.00	0.10
230	002463	沪电股份	2,700.00	39,852.00	0.10
231	603899	晨光文具	700.00	39,256.00	0.10
232	002120	韵达股份	2,300.00	39,238.00	0.10
233	603444	吉比特	100.00	38,800.00	0.10
234	601111	中国国航	3,300.00	38,313.00	0.10
235	600754	锦江酒店	600.00	37,740.00	0.10
236	600377	宁沪高速	4,400.00	37,708.00	0.10
237	002487	大金重工	900.00	37,557.00	0.10
238	600258	首旅酒店	1,500.00	37,200.00	0.10
239	603939	益丰药房	700.00	36,981.00	0.10
240	603612	索通发展	1,000.00	36,850.00	0.10
241	688677	海泰新光	400.00	36,796.00	0.10
242	600886	国投电力	3,500.00	36,750.00	0.10
243	002518	科士达	1,200.00	36,720.00	0.10
244	603486	科沃斯	300.00	36,567.00	0.09
245	002603	以岭药业	1,500.00	36,450.00	0.09
246	300408	三环集团	1,200.00	36,120.00	0.09

247	601222	林洋能源	4,300.00	35,905.00	0.09
248	600153	建发股份	2,700.00	35,289.00	0.09
249	605111	新洁能	280.00	35,226.80	0.09
250	601098	中南传媒	3,700.00	34,928.00	0.09
251	002727	一心堂	1,500.00	34,395.00	0.09
252	600216	浙江医药	2,500.00	34,125.00	0.09
253	603345	安井食品	200.00	33,574.00	0.09
254	001965	招商公路	4,400.00	33,572.00	0.09
255	002008	大族激光	1,000.00	33,130.00	0.09
256	600482	中国动力	2,100.00	32,991.00	0.09
257	002153	石基信息	2,072.00	32,882.64	0.09
258	300769	德方纳米	80.00	32,694.40	0.08
259	000930	中粮科技	3,600.00	32,544.00	0.08
260	300763	锦浪科技	150.00	31,950.00	0.08
261	300223	北京君正	300.00	31,875.00	0.08
262	603707	健友股份	1,100.00	31,020.00	0.08
263	300911	亿田智能	400.00	30,740.00	0.08
264	603195	公牛集团	200.00	30,582.00	0.08
265	600362	江西铜业	1,700.00	30,311.00	0.08
266	688122	西部超导	328.00	30,241.60	0.08
267	603833	欧派家居	200.00	30,136.00	0.08
268	002841	视源股份	400.00	30,128.00	0.08
269	300428	立中集团	900.00	29,745.00	0.08
270	600584	长电科技	1,100.00	29,700.00	0.08
271	603816	顾家家居	520.00	29,447.60	0.08
272	300699	光威复材	500.00	29,435.00	0.08
273	301099	雅创电子	351.00	29,301.48	0.08
274	600782	新钢股份	5,800.00	29,232.00	0.08
275	601989	中国重工	7,800.00	28,938.00	0.07
276	603225	新凤鸣	2,500.00	28,850.00	0.07
277	300595	欧普康视	500.00	28,595.00	0.07
278	601233	桐昆股份	1,800.00	28,584.00	0.07
279	300482	万孚生物	700.00	28,497.00	0.07
280	600882	妙可蓝多	600.00	28,080.00	0.07
281	002532	天山铝业	4,300.00	28,079.00	0.07
282	300244	迪安诊断	900.00	27,990.00	0.07
283	600872	中炬高新	800.00	27,688.00	0.07
284	301035	润丰股份	328.00	27,043.60	0.07
285	003816	中国广核	9,600.00	26,880.00	0.07
286	000519	中兵红箭	900.00	26,235.00	0.07
287	000933	神火股份	2,000.00	26,160.00	0.07
288	300496	中科创达	200.00	26,096.00	0.07
289	601336	新华保险	800.00	25,752.00	0.07
290	000301	东方盛虹	1,500.00	25,365.00	0.07



291	002028	思源电气	700.00	24,962.00	0.06
292	002240	盛新锂能	400.00	24,144.00	0.06
293	300360	炬华科技	1,800.00	24,012.00	0.06
294	601665	齐鲁银行	4,800.00	23,424.00	0.06
295	000034	神州数码	1,500.00	22,830.00	0.06
296	603317	天味食品	800.00	22,776.00	0.06
297	300207	欣旺达	700.00	22,120.00	0.06
298	300286	安科瑞	800.00	21,720.00	0.06
299	002056	横店东磁	800.00	21,296.00	0.06
300	601089	福元医药	981.00	20,650.05	0.05
301	000739	普洛药业	1,000.00	20,640.00	0.05
302	000878	云南铜业	1,800.00	20,502.00	0.05
303	600803	新奥股份	1,100.00	20,449.00	0.05
304	603363	傲农生物	1,100.00	20,361.00	0.05
305	600348	阳泉煤业	1,300.00	20,098.00	0.05
306	688111	金山办公	99.00	19,514.88	0.05
307	300451	创业慧康	2,700.00	19,440.00	0.05
308	300775	三角防务	400.00	19,260.00	0.05
309	002572	索菲亚	700.00	19,250.00	0.05
310	688036	传音控股	214.00	19,095.22	0.05
311	600633	浙数文化	2,700.00	18,576.00	0.05
312	600025	华能水电	2,600.00	18,174.00	0.05
313	603018	中设集团	1,900.00	18,145.00	0.05
314	000513	丽珠集团	500.00	18,105.00	0.05
315	002831	裕同科技	600.00	17,730.00	0.05
316	601718	际华集团	5,700.00	17,670.00	0.05
317	300418	昆仑万维	1,100.00	17,600.00	0.05
318	600372	中航电子	900.00	17,451.00	0.05
319	000800	一汽解放	1,800.00	16,812.00	0.04
320	600808	马钢股份	4,300.00	16,297.00	0.04
321	605090	九丰能源	800.00	16,216.00	0.04
322	000983	山西焦煤	1,200.00	16,068.00	0.04
323	300358	楚天科技	900.00	16,011.00	0.04
324	002624	完美世界	1,100.00	15,807.00	0.04
325	600282	南钢股份	4,800.00	15,120.00	0.04
326	301073	君亭酒店	216.00	14,977.44	0.04
327	300601	康泰生物	320.00	14,457.60	0.04
328	300627	华测导航	420.00	14,443.80	0.04
329	000937	冀中能源	1,700.00	12,682.00	0.03
330	002867	周大生	800.00	12,424.00	0.03
331	001268	联合精密	245.00	6,791.40	0.02

## 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	601318	中国平安	260,990.00	0.61
2	600926	杭州银行	257,100.00	0.60
3	688169	石头科技	183,142.00	0.43
4	002129	TCL 中环	164,015.00	0.38
5	300498	温氏股份	133,641.00	0.31
6	000739	普洛药业	119,564.00	0.28
7	601601	中国太保	116,000.00	0.27
8	000807	云铝股份	114,725.00	0.27
9	300750	宁德时代	111,554.00	0.26
10	300003	乐普医疗	108,680.00	0.25
11	603290	斯达半导	104,889.00	0.24
12	300896	爱美客	104,600.00	0.24
13	603323	苏农银行	102,480.00	0.24
14	600089	特变电工	102,425.00	0.24
15	300769	德方纳米	100,894.00	0.23
16	300026	红日药业	98,337.00	0.23
17	601166	兴业银行	98,094.00	0.23
18	300015	爱尔眼科	96,916.00	0.23
19	002839	张家港行	96,829.00	0.23
20	000625	长安汽车	95,483.00	0.22

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 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	436,162.00	1.02
2	600036	招商银行	343,608.00	0.80
3	000858	五粮液	284,426.00	0.66
4	002142	宁波银行	260,445.00	0.61
5	300760	迈瑞医疗	223,351.00	0.52
6	601166	兴业银行	222,505.00	0.52
7	600048	保利发展	185,157.00	0.43
8	000166	申万宏源	185,069.00	0.43

9	688187	时代电气	185,039.45	0.43
10	603259	药明康德	169,545.00	0.39
11	300059	东方财富	167,079.00	0.39
12	601919	中远海控	164,415.00	0.38
13	000596	古井贡酒	164,149.00	0.38
14	600030	中信证券	152,072.00	0.35
15	002475	立讯精密	145,675.00	0.34
16	688793	倍轻松	133,729.31	0.31
17	300274	阳光电源	128,616.00	0.30
18	600887	伊利股份	126,070.00	0.29
19	600111	北方稀土	120,104.00	0.28
20	002594	比亚迪	119,924.00	0.28

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	14,144,961.85
卖出股票的收入（成交）总额	14,068,600.85

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（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）	18,153.71	0.05
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	18,153.71	0.05

#### 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	113049	长汽转债	120.00	15,773.81	0.04
2	127056	中特转债	20.00	2,379.90	0.01

#### 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

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.12 本报告期投资基金情况

##### 7.12.1 投资政策及风险说明

本基金未投资基金。

##### 7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金未投资基金。

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行、宁波银行、兴业银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期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。

#### 7.13.2 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.13.3 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	1,682.16
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	99.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,782.01

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113049	长汽转债	15,773.81	0.04

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## 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
华泰紫金智能量化股票发起 A	555	52,496.01	17,114,443.79	58.74%	12,020,839.33	41.26%
华泰紫金智能量化股票发起 C	2	7,163.31	-	0.00%	14,326.61	100.00%
合计	557	52,333.23	17,114,443.79	58.71%	12,035,165.94	41.29%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	华泰紫金智能量化股票发起 A	0.00	0.00%
	华泰紫金智能量化股票发起 C	699.79	4.88%
	合计	699.79	0.00%

注：分级基金从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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

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	华泰紫金智能量化股票发起 A	0

持有本开放式基金	华泰紫金智能量化股票发起 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰紫金智能量化股票发起 A	0
	华泰紫金智能量化股票发起 C	0
	合计	0

#### 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	10,000,900.0 9	34.31%	10,000,000.0 0	34.31%	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	10,000,900.0 9	34.31%	10,000,000.0 0	34.31%	3 年

注：持有份额总数部分包含利息结转的份额。

#### 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰紫金智能量化股票发起 A	华泰紫金智能量化股票发起 C
基金合同生效日（2018 年 2 月 1 日）基金份额总额	343,068,498.19	-
本报告期期初基金份额总额	29,351,920.57	-
本报告期基金总申购份额	4,697,675.43	3,685,768.02
减：本报告期基金总赎回份额	4,914,312.88	3,671,441.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	29,135,283.12	14,326.61

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

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

报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

1、本基金管理人根据监管规定要求于 2022 年 3 月 26 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2022 年 3 月 25 日起，刘玉生先生因职务调整，不再担任公司首席信息官职务。

2、本基金管理人根据监管规定要求于 2022 年 3 月 26 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2022 年 3 月 25 日起，张艳女士新任本基金管理人首席信息官。

3、本基金管理人根据监管规定要求于 2022 年 4 月 30 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2022 年 4 月 28 日起，潘熙先生新任本基金管理人副总经理。

4、本基金管理人根据监管规定要求于 2022 年 5 月 10 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2022 年 5 月 9 日起，刘玉生先生因职务调整，不再担任本基金管理人合规总监、督察长。刘博文先生新任本基金管理人合规总监、督察长。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

### 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，无涉及基金管理人基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期未发生变更。

### 10.7 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，本基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚；本报告期内，基



金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

## 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.8.1 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	
华泰证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	28,003,323.09	100.00%	14,878.08	100.00%	-

注：1、我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。

2、本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

### 10.8.2 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		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
华泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	45,384.26	100.00%	-	-	-	-

## 10.9 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	关于华泰证券（上海）资产管理有限公司所管理的产品执行新金融工具相关会计准则的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券日报等	2022-01-01
2	华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金产品资料概要（更新）	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券日报等	2022-01-05
3	华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基	基金管理人网站、中国证	2022-01-05

	金恢复（大额）申购（转换转入、赎回、转换转出、定期定额投资）公告	监会基金电子披露网站、 证券日报等	
4	华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金托管协议	基金管理人网站、中国证 监会基金电子披露网站、 证券日报等	2022-01-05
5	华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站、中国证 监会基金电子披露网站、 证券日报等	2022-01-05
6	华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金合同	基金管理人网站、中国证 监会基金电子披露网站、 证券日报等	2022-01-05
7	关于华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资 基金增加基金份额类别并修改基金合同和 托管协议的公告	基金管理人网站、中国证 监会基金电子披露网站、 证券日报等	2022-01-05
8	华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基 金 2021 年第 4 季度报告	基金管理人网站、中国证 监会基金电子披露网站、 证券日报等	2022-01-21
9	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于运用 自有资金投资旗下权益类公募基金的公告	基金管理人网站、中国证 监会基金电子披露网站、 证券日报等	2022-02-28
10	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下 部分基金参与科创板股票投资及相关风险提 示的公告	基金管理人网站、中国证 监会基金电子披露网站、 证券日报等	2022-03-16
11	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级 管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证 监会基金电子披露网站、 证券日报等	2022-03-26
12	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级 管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证 监会基金电子披露网站、 证券日报等	2022-03-26
13	华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基 金 2021 年年度报告	基金管理人网站、中国证 监会基金电子披露网站、 证券日报等	2022-03-31
14	华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基 金 2022 年第 1 季度报告	基金管理人网站、中国证 监会基金电子披露网站、 证券日报等	2022-04-22
15	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下 基金持有的长期停牌股票估值调整的公告	基金管理人网站、中国证 监会基金电子披露网站、 证券日报等	2022-04-27
16	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级 管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证 监会基金电子披露网站、 证券日报等	2022-04-30
17	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级 管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证 监会基金电子披露网站、 证券日报等	2022-05-10

18	华泰证券(上海)资产管理有限公司关于终止与北京植信基金销售有限公司销售合作关系的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券日报等	2022-05-12
----	--	-----------------------------	------------

## 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	2022-1-1 至 2022-6-30	10,000,900.09	0.00	0.00	10,000,900.09	34.31%
产品特有风险							
1、本基金单一机构投资者所持有的基金份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响； 2、大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平； 3、因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动； 4、单一投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响； 5、发起式基金在成立三年后继续存续的，若本基金连续60个工作日基金份额持有人低于200人或基金资产净值低于5000万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险； 6、大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险； 7、大额赎回导致基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人根据监管规定要求于 2022 年 3 月 26 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《华泰证券(上海)资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2022 年 3 月 25 日起，刘玉生先生因职务调整，不再担任公司首席信息官职务。

2、本基金管理人根据监管规定要求于 2022 年 3 月 26 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《华泰证券(上海)资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2022 年 3 月 25 日起，张艳女士新任本基金管理人首席信息官。

3、本基金管理人根据监管规定要求于 2022 年 4 月 30 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《华泰证券(上海)资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2022 年 4 月 28 日起，

潘熙先生新任本基金管理人副总经理。

4、本基金管理人根据监管规定要求于 2022 年 5 月 10 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，自 2022 年 5 月 9 日起，刘玉生先生因职务调整，不再担任本基金管理人合规总监、督察长。刘博文先生新任本基金管理人合规总监、督察长。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人、基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

部分备查文件可通过本基金管理人公司网站查询，也可咨询本基金管理人。客服电话（4008895597）；公司网址：<https://htamc.htsc.com.cn/>。

华泰证券（上海）资产管理有限公司

二〇二二年八月三十一日