# 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摘要

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

**【重要提示】**

1、本基金根据 2017 年 7 月 14 日中国证券监督管理委员会《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)准予注册,进行募集。本基金合同已于 2018 年 2 月 1 日正式生效。

2、基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值、收益和市场前景作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

3、投资有风险,投资者认购(或申购)基金份额时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,全面认识本基金产品的风险收益特征,应充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行负担。

4、本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

5、本基金为股票型基金,是证券投资基金中的高预期风险和高预期收益的产品。基金的预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。

6、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)。

本基金投资中小企业私募债,中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易,一般情况下,交易不活跃,潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时,受市场流动性所限,本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债,由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

7、基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 80%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

8、本基金份额发售面值为人民币 1.00 元。在市场波动因素影响下,本基金净值可能低于初始面值,本基金投资者有可能出现亏损。

9、本基金单一投资者持有基金份额数不得超过基金份额总数的 50%,但在本基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动超过前述 50%比例的除外。

10、基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

11、基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书所载内容截止日为 2019 年 7 月 31 日, 有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 6 月 30 日(财务数据未经审计)。

本基金本次更新的招募说明书主要根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和修订后的基金合同对相关信息进行更新。

## 第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况
名称:华泰证券(上海)资产管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区基隆路 6 号 1222 室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区东方路 18 号 21 层
法定代表人:崔春
成立时间:2014 年 10 月 16 日
注册资本:26 亿元
存续期间:持续经营
联系人: 周维佳
联系电话:4008895597

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。

二、主要成员情况
1、基金管理人董事会成员

崔春女士,董事长,毕业于中国人民银行总行金融研究所货币银行学专业,获硕士学位。曾任中国光大国际信托投资公司证券部经理,光大证券有限公司总裁办高级经理,中国建设银行总行计划财务部副处长 、金融机构部副处长,嘉实基金管理有限公司固定收益部总监,中国国际金融股份有限公司资产管理部副总经理、执行总经理、董事总经理,兼任中金香港资产管理有限公司董事。2015 年 5 月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司,现任华泰证券(上海)资产管理有限公司董事长。

孟庆林先生,董事,毕业于东北财经大学工业经济专业,获学士学位。曾在徐州工程机械集团任职,1998 年 5 月加入华泰证券,曾任徐州营业部总经理助理、徐州中山南路营业部副总经理、广州机场路营业部总经理、南京解放路营业部总经理、机构业务部总经理、上海分公司总经理。现任华泰证券股份有限公司经纪及财富管理部(原经纪业务总部)总经理、职工监事,兼任江苏股权交易中心有限责任公司董事。

费雷先生,董事,毕业于北方交通大学财务会计专业,获学士学位。曾任南京铁路分局浦口车辆段财务科会计、江苏省农业投资公司财务部主管会计、江苏省国际信托投资公司财务部副科长、江苏省国际信托投资公司隆信置业有限公司财务部副总经理、信泰证券有限责任公司财务部副总经理。2009 年 9 月加入华泰证券,现任华泰证券股份有限公司计划财务部总经理。

陈天翔先生,董事,毕业于武汉理工大学通信工程专业,获学士学位。曾任东方通信股份有限公司工程师、南京欣网视讯科技股份有限公司项目经理。2007 年加入华泰证券,现任华泰证券股份有限公司网络金融部总经理。

2、基金管理人监事会成员

戴斐斐女士,监事,毕业于南京理工大学会计学专业,获学士学位。曾在南京金笔厂、中外合资南京荣华公司任职,1994 年 12 月加入华泰证券,曾任稽查监察总部高级经理、计划财务部高级经理、独立存管部副总经理、上海管理总部财务清算中心主任、计划财务部副总经理兼清算中心主任等职务。现任华泰证券股份有限公司运营中心总经理,兼任江苏股权交易中心有限责任公司董事,兼任证通股份有限公司董事。

3、高级管理人员

崔春女士,董事长。(简历请参照上述董事会成员介绍)

朱前女士,副总经理(主持工作),毕业于复旦大学经济学院世界经济专业,获硕士学位。曾在东方证券有限责任公司、富通基金管理公司、海富通基金管理有限公司任职,曾任中国国际金融有限公司资产管理部机构事业部负责人、执行总经理。2015 年 3 月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司,现任华泰证券(上海)资产管理有限公司副总经理(主持工作)。

刘玉生先生,首席风险官、合规总监、督察长,毕业于武汉大学政治经济学专业,获博士学位。曾任建设银行总行清算中心副主任科员、主任科员、副处长,中国证券登记结算有限责任公司业务发展部副总监、基金业务部主持工作副总监、总监,长安基金管理有限公司督察长。2016 年 4 月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司,现任华泰证券(上海)资产管理有限公司首席风险官、合规总监、督察长。

席晓峰先生,副总经理,毕业于北京航空航天大学计算机应用专业,获硕士学位。曾任华夏证券研究所金融工程分析师,上投摩根基金管理有限公司风险管理部风险经理,国泰基金管理有限公司稽核监察部总监助理,中国国际金融有限公司资产管理部高级经理、副总经理,兼任风险管理委员会主席。2015 年 1 月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司,现任华泰证券(上海)资产管理有限公司副总经理。

4、本基金基金经理

毛甜,武汉大学金融工程硕士研究生,曾任中国航天工程咨询中心分析师、国信证券经济研究所金融工程部助理分析师、光大富尊投资有限公司研究员、投资经理。2017 年 7 月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司,现任华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金基金经理、华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金经理。

张璐,上海交通大学硕士研究生,曾任上海东方证券资产管理有限公司量化投资部研究员,2017 年 4 月加入华泰证券 (上海)资产管理有限公司,现任华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金、华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金经理。

5、公募权益类基金投资决策委员会成员:
主席:俞天甲(代,现任基金权益部权益投资岗)
成员:陈曦女士(代交易部负责人)
毛甜女士(华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金基金经理、华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金经理)
张璐先生(华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金基金经理、华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金经理)

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责
1、依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
2、办理基金备案手续;
3、自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度, 保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
6、除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
7、依法接受基金托管人的监督;
8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金净值信息,确定基金份额申购、赎回的价格;
9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
10、编制季度报告、中期报告和年度报告;
11、严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
12、保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;
13、按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;
14、按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
15、依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上;
17、确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资人能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;
18、组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
20、因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
21、监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;
23、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;
24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人;
25、执行生效的基金份额持有人大会的决议;
26、建立并保存基金份额持有人名册;
27、法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

四、基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生;

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为,并承诺建立健全内部风险控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生:
(1)将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;
(2)不公平地对待管理的不同基金财产;
(3)利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;
(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
(5)侵占、挪用基金财产;
(6)泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;
(7)玩忽职守,不按照规定履行职责;
(8)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反基金合同行为的发生;

4、基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责;

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

五、基金经理承诺
1、依照有关法律法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;
2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益;
3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密,尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;
4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

六、基金管理人的内部控制制度
1、内部控制制度概述

为保障公司及其所开展的资产管理业务规范运作, 有效防范、规避和化解各类风险,最大限度地保护利益相关者及公司的合法权益,本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是对公司章程规定的内控原则的细化和展开,是公司各项基本管理制度的纲要和总揽,贯穿公司运营的所有环节,其内容包括公司内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等。

2、内部控制目标
(1)确保公司经营运作严格遵守国家有关法律、法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。
(2)防范和化解经营风险,提高经营管理效益,实现公司资产管理业务的持续、稳定、健康发展。
(3)建立行之有效的风险控制系统,保障公司资产及客户资产的安全完整,维护公司股东的合法权益,并最大限度地保护投资人的合法权益。
(4)确保公司业务记录、财务信息和其它信息真实、准确、完整、及时。
(5)保证公司内部规章制度的贯彻执行,提高公司经营效益。

3、内部控制原则
(1)健全性原则。内部控制机制应当做到事前、事中、事后控制相统一;覆盖公司各个部门和各级岗位,渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。
(2)有效性原则。通过科学的内控手段和方法,建立合理的内部控制程序,维护内控制度的有效执行。
(3)独立性原则。公司各部门和岗位职责应当保持相对独立,公司对受托资产、自有资产、其他资产的管理运作必须分离;公司设立合规风控部,承担内部控制监督检查职能,对各部门、岗位进行流程监控和风险管理。
(4)相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡;前台业务运作与后台管理支持适当分离。
(5)成本效益原则。公司内部控制与公司业务范围、经营规模、风险状况相适应,运用科学化的经营管理方法,以合理的成本实现内部控制目标。

4、控制环境
内部控制环境主要包括公司所有权结构、经营理念与风险意识、治理结构、组织架构与决策程序、内部控制体系、员工的诚信和道德价值观、人力资源政策等。

5、内控措施
公司建立科学严密的风险控制评估体系,通过定期与不定期风险评估,对公司内外部风险进行识别、评估和分析,发现风险来源和类型, 针对不同的风险由相关部门提出相应的风险控制方案,及时防范和化解风险。

控制活动主要包括:授权控制、内幕交易控制、关联交易控制和法律风险控制等。

内部控制的主要内容包括:市场开发业务控制、投资管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制和人力资源控制等。

## 第二部分 基金托管人

一、基本情况
名称:中国银行股份有限公司(简称"中国银行")
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街 1 号
首次注册登记日期:1983 年 10 月 31 日
注册资本:人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人:刘连舸
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号
托管部门信息披露联系人:王永民
传真:(010)66594942
中国银行客服电话:95566

二、基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于 1998 年, 现有员工 110 余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具有海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金、基金(一对多、一对一)、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

三、证券投资基金托管情况

截至 2019 年 6 月 30 日, 中国银行已托管 716 只证券投资基金,其中境内基金 676 只,QDII 基金 40 只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF 等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

四、托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分,秉承中国银行风险控制理念,坚持"规范运作、稳健经营"的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节,通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007 年起,中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于 "SAS70"、"AAF01/06" "ISAE3402"和"SSAE16"等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2017 年, 中国银行继续获得了基于 "ISAE3402"和"SSAE16"双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善,内控措施严密,能够有效保证托管资产的安全。

五、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当拒绝执行,及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当及时通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

## 第三部分 相关服务机构

一、基金销售机构
1、直销机构
名称:华泰证券(上海)资产管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区基隆路 6 号 1222 室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区东方路 18 号 21 层
法定代表人:崔春
电话:(025)83387046
传真:(025)83387074
联系人:孙晶晶
网站:http://htamc.htsc.com.cn/

2、其他销售机构
(1)华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市江东中路 228 号
办公地址:江苏省南京市江东中路 228 号
法定代表人:周易
联系人:夏璐
客服电话:95597
网址:www.htsc.com
(2)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址:北京市东城区朝内大街 188 号
法定代表人:王常青
联系人:许梦园
客服电话:95587
网址:www.csc108.com
(3)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层
办公地址:北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层
法定代表人:陈共炎
联系人:辛国政
客服电话:4008888888
网址: www.chinastock.com.cn
(4)中国银行股份有限公司
注册地址:北京市复兴门内大街 1 号
办公地址:北京市复兴门内大街 1 号
法定代表人:刘连舸
联系人:郭文霞
客服电话:95566
网址: www.boc.cn
(5)交通银行股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号
法定代表人:彭纯
联系人:张作伟
客服电话:95559
网址: www.bankcomm.com
(6) 珠海盈米基金销售有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室 -3491
办公地址:珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室 -3491
法定代表人:肖雯
联系人:邱湘湘
客服电话:020-89629066
网址: www.yingmi.cn
(7)泰诚财富基金销售(大连)有限公司
注册地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号
法定代表人:李春光
联系人:王潇
客服电话:4006411999
公司网址:www.taichengcaifu.com
(8)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号
办公地址:上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室
法定代表人:杨文斌
联系人:陆敏
客服电话:400-700-9665
公司网址: www.howbuy.com
(9) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司
注册地址: 北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室
办公地址: 北京市朝阳区东三环北路 38 号院泰康金融大厦 38 层
法定代表人:张冠宇
联系人:王国庄
客服电话:4008199868
公司网址: www.tdyhfund.com
(10)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层
办公地址:上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦
法定代表人:其实
联系人:何薇
客服电话:95021
网址:fund.eastmoney.com
(11)北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区显龙山路 19 号 1 幢 4 层 1 座 401
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座
法定代表人:江卉
联系人:韩锦星
客服电话:400-098-8511
网址:kenterui.jd.com
(12)上海陆金所基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
法定代表人:王之光
联系人:程晨
客服电话:400-821-9031
网址:www.lufunds.com
(13)嘉实财富管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层
办公地址:北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层
法定代表人:赵学军
联系人:余永键
客服电话:400-021-8850
网址: www.harvestwm.cn
(14)北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
办公地址: 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院望京 SOHO 塔 3A 座 19 层
法定代表人:钟斐斐
联系人:王悦
客服电话:4000-618-518
网址:danjuanapp.com
(15)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
办公地址:上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层
法定代表人:张跃伟
联系人:党敏
客服电话:400-820-2899
网址:www.erichfund.com
(16)奕丰金融服务(深圳)有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室
办公地址: 深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室
法定代表人:TEO WEE HOWE
联系人:叶健
客服电话:400-684-0500
网址:www.ifastps.com.cn
(17)济安财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307
办公地址: 北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼冠捷大厦 307
法定代表人:杨健
联系人:李海燕
客服电话:400-673-7010
网址:www.jianfortune.com
(18)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室
办公地址:杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室
法定代表人:陈柏青
联系人:傅强
客服电话:95188
网址:www.antfortune.com
(19)深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801
办公地址:深圳市罗湖区梨园路 Halo 广场 4 楼
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
客服电话:4006-788-887
网址:www.zlfund.cn
(20)阳光人寿保险股份有限公司
注册地址:海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层
办公地址:北京朝阳区朝外大街乙 12 号昆泰国际大厦 1 号楼 12 层
法定代表人:李科
联系人:杨超
客服电话:95510
网址:life.sinosig.com
(21)华泰期货有限公司
注册地址:广东省广州市越秀区东风东路 761 号丽丰大厦 20 层
办公地址:广东省广州市越秀区东风东路 761 号丽丰大厦 20 层
法定代表人:吴祖芳
联系人:马丹
客服电话:4006280888
网址:www.htfc.com
(22)深圳新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704
办公地址:北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层
法定代表人:洪弘
联系人:文雯
客服电话:400-166-1188
网址:http://8.jrj.com.cn/
(23)北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 号
办公地址:北京市海淀区中关村 e 世界 A 座 1108 室
法定代表人:王伟刚
联系人:于伟
客服电话: 400-619-9059
网址:www.hcjijin.com
(24)诺亚正行基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室
办公地址: 上海市杨浦区长阳路 1687 号 2 号楼
法定代表人: 汪静波
联系人:李娟
客服电话: 400-821-5399
网址:https://www.noah-fund.com/
(25)江苏天鼎证券投资咨询有限公司
注册地址:南京市秦淮区太平南路 389 号 1002 室
办公地址:江苏省南京市鼓楼区平安里 74 号
法定代表人:金婷婷
联系人:黄丹昀
客服电话:025-962155
网址:www.tdtz888.com
(26)上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发展区)
办公地址: 上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室
法定代表人:王翔
联系人:李关洲
客服电话:4008205369
公司网址: www.jiyufund.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构销售本基金,并在管理人网站公示。

二、登记机构
名称:华泰证券(上海)资产管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区基隆路 6 号 1222 室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区东方路 18 号 21 层
法定代表人:崔春
电话:(021)68984368
传真:(021)28972120
联系人: 白海燕

三、出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
办公地址:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
负责人:俞卫锋
电话: 021- 31358666
传真: 021- 31358600
联系人:丁媛
经办律师:黎明、丁媛

四、审计基金财产的会计师事务所
名称:毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
办公地址:中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
执行事务合伙人:邹俊
联系电话: (010)85085000
传真: (010)85185111
联系人:钱茹雯
经办注册会计师:张楠 钱茹雯

## 第四部分 基金的简介

基金名称:华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金
基金类型:股票型证券投资基金
运作方式:契约型开放式、发起式

## 第五部分 基金的投资

一、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。

二、投资范围

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)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为: 股票资产占基金资产的 80%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,本基金的投资比例会做相应调整。

三、投资策略

本基金是一只采取主动管理投资模式的股票基金。在投资策略上, 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。

1、资产配置策略

本基金通过定性与定量研究相结合的方法,确定投资组合中股票类资产和债券类资产的配置比例。

本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标, 以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标,确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势,对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果,运用资产配置优化模型,在目标收益条件下,追求风险最小化目标,最终确定大类资产 投资权重,实现资产合理配置。

2、股票投资策略

本基金主要采用多种量化模型进行股票的选择。基于模型结果,基金管理人结合市场环境和股票特性,精选个股构建投资组合,以追求超越业绩比较基准表 现的业绩水平。在实际运行过程中,将定期或不定期的进行修正,优化股票投资 组合。本基金采用的量化投资策略主要有:

(1)多因子选股模型:多因子选股模型由本基金管理人根据中国资本市场的实际情况开发的具有针对性和实用性的数量化选股模型。模型首先综合考虑经济因素、流动性因素、行业发展轨迹等大的市场环境,其次细致评估个股的估值情况、成长情况、动量 情况、交易行为情况等进行多维度的筛选。模型按照多维因子,并经过数量量化 模型进行筛选,选出符合模型的个股组成一篮子投资组合,并定期更新投资组合。

(2)事件驱动模型:通过研究发现,有较多事件驱动策略在中国 A 股市场有效或阶段性有效。如一致预期变动策略、上市公司业绩超市场预期策略、管理层增持策略、大股东减持策略、指数成份股调整策略等。我们将在适当的时机选用合适的策略,用于捕捉阶段性的超额收益或绝对收益。

(3)行业轮动模型:本基金通过把握经济周期变化,依据对宏观经济、产业政策、行业景气度及市场波动、市场情绪轮动等因素的综合判断, 识别出当阶段影响行业股价收益率的关键因素,判断行业是否在估值修复、触底回升等阶段,并计算各行业的绝对、相对上涨趋势强度,以实现各行业的合理和优化的配置。

(4)评级反转策略:评级反转策略综合利用证券分析师提供的研究报告信息、以及股票的市场交易信息进行选股。该策略倾向于选择具有以下特征的股票:在一段时期内,某个股票的多个研究报告均给出较正面的信息,即大部分的证券分析师看好该股的后市走势,然而在二级市场上,该股票的表现却滞后于行业指数的表现。当分析师已获取的信息和预测被市场进一步验证时,该类股票有望获得超额收益。

3、债券类资产投资策略

本基金的债券类投资品种主要有国债、企业债等中国证监会认可的,具有良好流动性的金融工具。债券类资产投资主要用于提高非股票资产的收益率,管理人将坚持价值投资的理念,严格控制风险,追求合理的回报。

在债券投资方面, 管理人将以宏观形势及利率分析为基础,依据国家经济发 展规划量化核心基准参照指标和辅助参考指标,结合货币政策、财政政策的实施情况,以及国际金融市场基准利率水平及变化情况, 预测未来基准利率水平变化趋势与幅度,进行定量评价。

4、中小企业私募债券投资策略

由于中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。 本基金将运用基本面研究, 结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。在进行投资时,将采取分散投资、锁定收益策略。在遴选债券时,将只投资有担保或者国有控股企业发行的中小企业私募债,以降低信用风险。

5、资产支持证券投资策略

本基金资产支持证券的投资配置策略主要从信用风险、流动性、收益率几方面来考虑,采用自下而上的项目精选策略,以资产支持证券的优先级或次优级为投资标的,精选违约或逾期风险可控、收益率较高的资产支持证券项目。根据不同资产支持证券的基础资产采取适度分散的地区配置策略和行业配置策略,在有效分散风险的前提下为投资人谋求较高的投资组合回报率。资产支持证券的信用风险分析采取内外结合的方法,以基金管理人的内部信用风险评估为主, 并结合外部信用评级机构的分析报告,最终得出对每个资产支持证券项目的总体风险判断。另外,鉴于资产支持证券的流动性较差,本基金更倾向于久期较短的品种, 即使持有到期压力也不会太大。

6、衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束,按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的,在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上,谨慎地进行投资。本基金将合理利用股指期货、国债期货、权证等衍生工具发掘可能的投资机会,稳健投资,实现基金资产的保值增值。

四、投资限制
1、组合限制
基金的投资组合应遵循以下限制:
(1)本基金股票投资占基金资产的 80%-95%;
(2)每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;
(3)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的 10%;
(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的 10%;
(5)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的 3%;
(6)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;
(7)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;
(8)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的 10%;
(9)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;
(10)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;
(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;
(12)本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;
(13)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;
(15)本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的 10%;
(16)本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%;
(17)本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的 10%;本基金在任何交易日日终,持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的 80%-95%;
(18) 基金在任何交易日日终, 持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的 15%;基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%;
(19)基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%;其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;
(20)本基金投资流通受限证券,基金管理人应事先根据中国证监会相关规定,与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例,根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险;
(21)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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 %;
(22) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 15% ;
因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
(23) 基金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的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;
(24)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除第(2)、(12)、(22)、(23)项外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行,无需召开基金份额持有人大会,但须提前公告。

2、禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:
(1)承销证券;
(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
(5)向其基金管理人、基金托管人出资;
(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准:中证 800 指数收益率 *90%+ 上证国债指数收益率 *10%

若今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是未来市场发生变化导致业绩比较基准不再适用或者有更加适合的业绩比较基准,经基金管理人和基金托管人协商一致,根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略,调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更应履行适当的程序后调整,无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应在调整前在指定媒介上予以公告。

六、风险收益特征

本基金为股票型基金,是证券投资基金中的高预期风险和高预期收益的产品。基金的预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。

七、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人根据本基金合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至 2019 年 6 月 30 日(未经审计)。

1.报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元 ) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 96,440,017.30 | 90.60 |
| | 其中:股票 | 96,440,017.30 | 90.60 |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | – | – |
| | 其中:债券 | – | – |
| | 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 | 9,971,998.48 | 9.37 |
| 8 | 其他资产 | 28,937.34 | 0.03 |
| 9 | 合计 | 106,440,953.12 | 100.00 |

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

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 | 354,480.00 | 0.33 |
| B | 采矿业 | 5,882,285.00 | 5.55 |
| C | 制造业 | 34,654,710.52 | 32.69 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 3,575,109.00 | 3.37 |
| E | 建筑业 | 7,557,678.00 | 7.13 |
| F | 批发和零售业 | 968,827.20 | 0.91 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 4,604,216.00 | 4.34 |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,514,670.45 | 2.37 |
| J | 金融业 | 30,342,216.13 | 28.62 |
| K | 房地产业 | 5,060,225.00 | 4.77 |
| L | 租赁和商务服务业 | – | – |
| M | 科学研究和技术服务业 | – | – |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | – | – |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | – | – |
| P | 教育 | – | – |
| Q | 卫生和社会工作 | – | – |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 925,600.00 | 0.87 |
| S | 综合 | – | – |
| | 合计 | 96,440,017.30 | 90.98 |

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票组合
本基金本报告期末未持有港股通投资股票投资。

3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000651 | 格力电器 | 69,200 | 3,806,000.00 | 3.59 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 40,600 | 3,597,566.00 | 3.39 |
| 3 | 000858 | 五 粮 液 | 30,200 | 3,562,090.00 | 3.36 |
| 4 | 600837 | 海通证券 | 217,300 | 3,083,487.00 | 2.91 |
| 5 | 600030 | 中信证券 | 119,300 | 2,840,533.00 | 2.68 |
| 6 | 600036 | 招商银行 | 78,000 | 2,806,440.00 | 2.65 |
| 7 | 600887 | 伊利股份 | 83,700 | 2,796,417.00 | 2.64 |
| 8 | 601186 | 中国铁建 | 280,400 | 2,789,980.00 | 2.63 |
| 9 | 600009 | 上海机场 | 31,800 | 2,664,204.00 | 2.51 |
| 10 | 000001 | 平安银行 | 189,400 | 2,609,932.00 | 2.46 |

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前五名债券明细
本基金本报告期末未持有债券。

6.按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.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。

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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

11.投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

11.2 基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 26,294.91 |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 2,047.04 |
| 5 | 应收申购款 | 595.39 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 28,937.34 |

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

11.6 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。

## 第六部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为 2018 年 2 月 1 日, 基金业绩数据截至 2019 年 6 月 30 日。

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值收益率(1) | 份额净值收益率标准差(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) |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2019.1.1-2019.6.30 | 25.68% | 1.42% | 22.69% | 1.41% | 2.99% | 0.01% |
| 2018.2.1-2018.12.31 | –27.09% | 0.97% | -27.24% | 1.25% | 0.15% | -0.28% |
| 基金成立至今 | -8.37% | 1.16% | -10.73% | 1.31% | 2.36% | -0.15% |

图示自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动的比较

注:本基金合同于 2018 年 2 月 1 日生效,截止本报告期末基金成立已满一年;自基金成立日起 6 个月为建仓期,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## 第七部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类
1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券、期货交易或结算费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、基金的开户费用、账户维护费用;
9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1、基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×1.5%÷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。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费
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。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 2-5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

上述"一、基金费用的种类"中第 3-9 项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:
1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 第八部分 招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求, 我公司已对《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》进行了如下更新:

1、根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和修订后的基金合同,更新了"一、绪言"、"二、释义"、"三、基金管理人"、"五、相关服务机构"、"八、基金份额的申购与赎回"、"十五、基金的会计与审计"、"十六、基金的信息披露"、"十九、基金合同的内容摘要"、"二十、基金托管协议的内容摘要"的相关内容。
2、"三、基金管理人"更新基金管理人相关信息。
3、"五、相关服务机构"更新登记机构相关信息。