金元顺安金通宝货币市场基金

2019年第二季度报告

基金管理人:金元顺安基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2019年07月17日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年07月16日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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年04月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	金元顺安金通宝货币
基金主代码	004072
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年01月20日
报告期末基金份额总额	1,938,526,083.73份
投资目标	在严格控制基金资产风险、保持基金资产流动性的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金结合自上而下和自下而上的分析,在保证资产的安全性和流动性的前提下,进行积极的投资组合管理,通过利率分析策略、类属配置策略、个券选择策略、回购策略、无风险套利操作策略等多种投资策略,追求基金的长期,稳定增值。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	金通宝货币A类	金通宝货币B类
下属分级基金的交易代码	004072	004073
报告期末下属分级基金的份额总额	2,335,142.32份	1,936,190,941.41份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年04月01日-2019年06月30日)	
	金通宝货币A类	金通宝货币B类
1.本期已实现收益	11,173.27	12,640,846.28
2.本期利润	11,173.27	12,640,846.28
3.期末基金资产净值	2,335,142.32	1,936,190,941.41

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,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(为期末余额,不是当期发生数);

3、表中的"期末"均指报告期最后一日,即06月30日;

4、上述基金业绩指标不包括持有人认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本报告期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

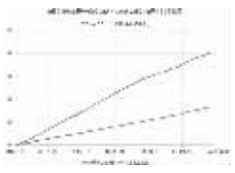
金通宝A类净值表现

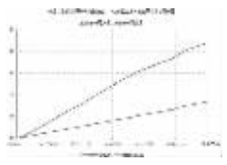
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5619%	0.0004%	0.3371%	0.0000%	0.2148%	0.0004%

金通宝B类净值表现

阶段	净值收益率①	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
过去三个月	0.6118%	0.0004%	0.3371%	0.0000%	0.2747%	0.0004%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:

1、本基金合同生效日为2017年01月20日,业绩基准收益率以2017年01月19日为基准;

2、本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券,以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具;

3、本基金业绩比较基准为"同期七天通知存款利率(税后)"。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郭建新	本基金基金经理	2017-01-24	-	9年	金元顺安金通宝货币市场基金、金元顺安权盛债券型证券投资基金和金元顺安权泰债券型证券投资基金的基金经理,西南财经大学经济学硕士。曾任河北银行股份有限公司资金运营中心债券交易经理。2016年9月加入金元顺安基金管理有限公司。9年证券、基金等金融行业从业经历,具有基金从业资格。

注:

1、此处的任职日期、离任日期均指公司做出决定之日,若该基金经理自基金合同生效日起固任职,则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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金销售管理办法》、《金元顺安金通宝货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,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,为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。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 公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护。本报告期内,本基金管理人严格遵守公司投资交易业务流程及公平交易制度。公司投资交易行为监控体系由稽核监察部和交易室监督,确保公平交易制度的执行和实现。

本报告期内,本基金管理人对旗下开放式基金与其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析,未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本基金管理人《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《金元顺安基金管理有限公司公平交易管理制度》及其他相关法律法规和公司内部规章制度,制定了《金元顺安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》,涵盖了所有可投资证券的一级市场申购、二级市场交易所公开竞价交易、交易所大宗交易、银行间债券交易以及非公开发行股票申购、以公司名义进行的一级市场债券交易等可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

本基金管理人采用定量分析和定性分析相结合的方式,建立并严格执行有效的异常交易日常监控制度,形成定期交易监控报告,按照报告路线实行及时报告的机制。

本报告期内,未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年二季度宏观经济增长整体趋缓。固定资产投资增速降低,但地产仍然保持坚挺,外贸和消费增速小幅向下,CPI增速略有上升。M2和社融经过一季度的快速增长后相对保持平稳。资金面整体宽松,资金价格较一季末逐步下行,但流动性出现分层现象,部分资质较弱的主体融资成本提高。债券收益率先上后下,低等级债券的信用利差有所扩大。股票市场经过一季度的大幅上涨后二季度出现较大幅度回调。

报告期内本基金资产配置以利率债、高等级存单和逆回购为主,整体久期偏短,资产流动性良好。严格控制信用风险,产品运作整体平稳。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安金通宝A类基金份额净值为1.000元;本报告期内,基金份额净值增长率为0.5519%,同期业绩比较基准收益率为0.2148%。

截至报告期末金元顺安金通宝B类基金份额净值为1.000元;本报告期内,基金份额净值增长率为0.6118%,同期业绩比较基准收益率为0.2747%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形。

本报告期内,本基金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。

§5 投资组合报告

5.1 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	固定收益投资	1,178,996,836.39	60.80
	其中:债券	1,178,996,836.39	60.80
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	731,738,657.60	37.73
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	19,989,569.70	1.03
4	其他资产	8,484,942.25	0.44
5	合计	1,939,210,005.94	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	1.12
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	47
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	54
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过120天的情况。

5.3.2报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	53.73	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	23.14	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	12.83	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	9.89	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.60	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	321,850,203.29	16.60
	其中:政策性金融债	321,850,203.29	16.60
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	857,146,633.10	44.22
8	其他	-	-
9	合计	1,178,996,836.39	60.82
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111810477	18兴业银行CD477	1,000,000	99,918,951.77	5.15
2	111817209	18光大银行CD209	1,000,000	99,834,842.63	5.15
1	111815374	18民生银行CD374	1,000,000	99,781,705.55	5.15
4	111915153	19民生银行CD153	1,000,000	99,764,928.46	5.15
5	111915159	19民生银行CD159	1,000,000	99,690,155.14	5.14
6	111909154	19浦发银行CD154	1,000,000	99,538,969.50	5.13
7	111810601	18兴业银行CD601	1,000,000	99,451,574.77	5.13
8	111909174	19浦发银行CD174	1,000,000	99,405,621.10	5.13
9	140441	14农发41	900,000	90,086,991.79	4.65
10	040225	04国开25	500,000	50,752,917.07	2.62

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0471%
报告期内偏离度的最低值	-0.0142%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0178%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1基金计价方法说明

本基金估值采用"摊余成本法",即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。

5.9.2本基金投资的前十名证券的发行主体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。

5.9.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	8,484,942.25
4	应收申购款	100.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	8,484,942.25

5.9.4投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	金通宝货币A类	金通宝货币B类
报告期期初基金份额总额	1,293,489.55	1,937,819,211.63
报告期期间基金总申购份额	1,210,639.94	1,127,150,846.28
减:报告期期间基金总赎回份额	168,987.17	1,128,779,116.50
报告期期末基金份额总额	2,335,142.32	1,936,190,941.41

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,本基金管理人未进行本基金的申购、赎回及红利再投资等交易。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
			期初份额	申购份额	赎回份额		持有份额	份额占比
机构	1	2019年04月01日-2019年06月30日	589,743,092.41	3,626,525.93	0.00		593,369,618.34	30.61%
	2	2019年04月01日-2019年06月26日;2019年06月12日-2019年06月30日	458,718,419.73	2,820,811.80	0.00		461,539,231.53	23.81%
	3	2019年06月05日-2019年06月11日	0.00	500,495,431.37	500,495,431.37		0.00	0%

产品特有风险

?持有份额比例较高的投资者(""高比例投资者")大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回,中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险,赎回款项延期获得。

?基金净值大幅波动的风险

高比例投资者大额赎回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动;若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费,相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产,可能对基金资产净值造成较大波动。

?基金规模较小导致的风险

高比例投资者赎回后,可能导致基金规模较小,从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责,执行相关投资策略,力争实现投资目标。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、2019年04月02日,在《中国证券报》和www.jysa99.com公布金元顺安金通宝货币市场基金关于清明节假期前两个工作日基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务公告;

2、2019年04月02日,在《中国证券报》和www.jysa99.com公布金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加嘉实财富管理有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告;

3、2019年04月19日,在《中国证券报》和www.jysa99.com公布金元顺安基金管理有限公司旗下基金增加中信证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告;

4、2019年04月20日,在《中国证券报》和www.jysa99.com公布金元顺安基金管理有限公司旗下基金2019第一季度报告;

5、2019年04月26日,在《中国证券报》和www.jysa99.com公布金元顺安金通宝货币市场基金关于劳动节假期前两个工作日基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务公告;

6、2019年04月27日,在《中国证券报》和www.jysa99.com公布金元顺安基金管理有限公司关于手工披露旗下基金04月26日行情的公告;

7、2019年05月18日,在《中国证券报》和www.jysa99.com公布金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金参加北京恒天明泽基金销售有限公司费率优惠活动的公告;

8、2019年06月4日,在《中国证券报》和www.jysa99.com公布金元顺安金通宝货币市场基金关于端午节假期前两个工作日基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予金元顺安金通宝货币市场基金募集注册的文件;

2、《金元顺安金通宝货币市场基金基金合同》;

3、《金元顺安金通宝货币市场基金基金招募说明书》;

4、《金元顺安金通宝货币市场基金托管协议》;

5、关于申请募集注册金元顺安金通宝货币市场基金的法律意见书;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照;

7、基金托管人业务资格批件、营业执照;

8、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

金元顺安基金管理有限公司

中国(上海)自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间至办公地点进行查询,或登录本基金管理人网站www.jysa99.com查阅。投资者对本报告书存有疑问,可咨询本基金管理人金元顺安基金管理有限公司,本公司客服电话400-666-0666,021-68881898。

金元顺安基金管理有限公司
2019年07月17日

金元顺安沣顺定期开放债券型发起式证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:金元顺安基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年07月17日

§1 重要提示

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年07月16日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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年04月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	金元顺安沣顺定开债发起式
基金主代码	005817
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年04月23日
报告期末基金份额总额	1,275,750,666.15份
投资目标	在严格控制风险的前提下,追求持续、稳定的收益。
投资策略	(一)封闭期投资策略 1、信用债投资策略 本基金将重点投资信用类债券,以提高组合收益能力。信用债券和对央票、国债等利率产品的信用利差是本基金获取较高投资收益的来源,本基金将在公司内部信用评级的基础上和内部信用风险控制的框架下,积极投资信用债券,获取信用利差带来的高投资收益。 本基金不得投资煤炭、钢铁、有色金属、化工等国家限制的高耗能等过剩产业的信用债,不得投资公司债。 2、收益率曲线策略 收益率曲线形状变化代表长、中、短期债券收益率差异变化,相同久期债券组合在收益率曲线发生变化时差异较大,通过对同一类属下的收益率曲线形态和期限结构变动进行分析,首先可以确定债券组合的目标久期配置区域并确定采取子弹型策略,哑铃型策略或梯形策略;其次,通过不同期限间债券当前利差与历史利差的比较,可以进行增陡、减斜和凸度变化的交易。 3、资产支持证券投资策略 资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析,本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,采用基本面分析和数量化模型相结合,对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。 (二)开放期投资策略 本基金以定期开放方式运作,即采取在封闭期内封闭运作,封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。开放期内,基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化,因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性,以应付当时市场条件下的赎回要求,并降低资产的流动性风险,做好流动性管理。 今后,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后,将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金系债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,属于中低风险的证券投资基金品种。
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年04月01日-2019年06月30日)
1.本期已实现收益	18,283,918.98
2.本期利润	10,324,140.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0088
4.期末基金资产净值	1,382,649,733.13
5.期末基金份额净值	1.0838

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

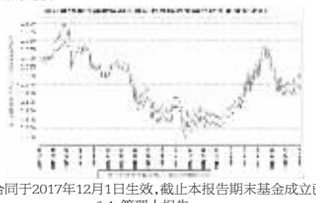
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.90%	1.22%	-6.10%	1.27%	2.20%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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:本基金合同于2017年12月1日生效,截止本报告期末基金成立已满一年。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
熊志勇	本基金的基金经理、基金量化部负责人	2017-12-01	-	13年	熊志勇先生,英国考文垂大学博士。曾任华安基金管理有限公司高级金融工程师、基金经理助理,国投瑞银基金管理有限公司基金经理、量化及衍生品负责人,鹏华基金管理有限公司量化投资部总经理,上投摩根基金管理有限公司量化投资部总监,上海申"怀资产管理有限公司投资总监,2016年11月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司。2010年11月27日至2011年8月17日任国投瑞银瑞福和沪深300指数分级证券投资基金基金经理。2017年12月起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。2018年2月起任华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金经理。
毛尉	本基金的基金经理	2017-12-12	-	8年	毛尉女士,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年任阳光私募投资有限公司,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月起担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。2018年3月起担任华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金基金经理。

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的生效日期。

2. 证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

4.2 管理人对报告期内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》等有关法律法规、中国证监会和《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 公平交易专项说明

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,规范各岗位职责上的关系,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度初大盘冲高回落,兑现调整预期,回归基本面验证,随后在基本面数据不及预期以及中美贸易战再度升温的影响下继续震荡回调。截至本报告期末,上证综指下跌3.62%,深证成分指数下跌7.35%,沪深300指数下跌1.21%,中证800指数下跌3.60%。

在操作上,本基金为保证对业绩基准的紧密跟踪,本着勤勉尽责的态度,我们严格遵守基金合同,坚持既定的指数化投资策略,以控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标,应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金份额净值增长率为-3.90%,同期业绩比较基准收益率为-6.10%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

1、本基金本报告期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、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	83,968,631.50	94.16
	其中:股票	83,968,631.50	94.16
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	5,115,056.38	5.74
-	-	-	-
8	其他资产	88,633.67	0.10
9	合计	89,172,321.55	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

报告期末按行业分类的境内股票投资组合(指数投资部分)

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	25,886,134.09	29.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,059,747.07	9.09
E	建筑业	889,870.00	1.00
F	批发和零售业	1,145,473.64	1.29
G	交通运输、仓储和邮政业	15,631,221.83	17.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	15,684,996.61	17.69
K	房地产业	15,136,692.26	17.08
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	1,534,496.00	1.73
S	综合	-	-
	合计	83,968,631.50	94.72

报告期末按行业分类的境内股票投资组合(积极投资部分)

注:本基金本报告期末未持有积极投资类股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

5.4 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投资贵金属。

5.5 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投资权证。

5.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.6.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.6.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.7.1本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.7.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.7.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1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。

5.8.2基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	16,007.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,324.03
5	应收申购款	70,302.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	88,633.67

5.8.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中未持有流通受限的股票。

期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末积极投资前五名股票中未持有流通受限的股票。

5.8.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	996,473,995.14
报告期期间基金总申购份额	279,276,671.01
减:报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,275,750,666.15

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.78

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,本基金管理人未进行本基金的申购、赎回及红利再投资等交易。

§8 报告期末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	10,000,000.00	0.78%	10,000,000.00	0.78%	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	10,000,000.00	0.78%	10,000,000.00	0.78%	不少于3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
			期初份额	申购份额	赎回份额		持有份额	份额占比
机构	1	2019年04月01日-2019年06月30日	996,473,995.14	279,276,671.01	0.00		1,275,750,666.15	99.22%

产品特有风险

?持有份额比例较高的投资者("高比例投资者")大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回,中小投资者可能面临