

华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金
2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰保兴基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年三月二十六日

§ 1 重要提示

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 22 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。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰保兴吉年丰	
基金主代码	004374	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 3 月 24 日	
基金管理人	华泰保兴基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	365,623,038.26 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰保兴吉年丰 A	华泰保兴吉年丰 C
下属分级基金的交易代码:	004374	004375
报告期末下属分级基金的份额总额	196,000,713.87 份	169,622,324.39 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极主动的分散化投资策略，把握不同时期股票市场和债券市场的投资机会，力争在严格控制风险的前提下满足投资人实现资产增值的投资需求。
投资策略	本基金根据资本市场实际情况对大类资产比例进行动态调整，力求有效地回

	避证券市场的系统性风险。同时，以专业的研究分析为根本，挖掘市场中有潜力的投资标的和被低估的投资品种，获得基金的长期稳定增值。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*70%+中债总指数（全价）收益率*30%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。	
	华泰保兴吉年丰 A	华泰保兴吉年丰 C
下属分级基金的风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。	本基金为混合型基金，其风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰保兴基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	尤小刚	王永民
	联系电话	021-80299000	010-66594896
	电子邮箱	fund_xxpl@ehuatai.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-632-9090	95566
传真		021-60963566	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ehuataifund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018 年		2017 年 3 月 24 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日	
	华泰保兴吉年丰 A	华泰保兴吉年丰 C	华泰保兴吉年丰 A	华泰保兴吉年丰 C
本期已实现收益	-44,084,780.77	-33,780,093.72	8,162,512.05	6,919,181.12
本期利润	-58,374,039.77	-42,405,212.32	16,763,003.31	12,814,375.06
加权平均基金份额本期利润	-0.3160	-0.3328	0.1916	0.2112
本期基金份额净值增长率	-24.99%	-25.22%	18.81%	18.63%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末		2017 年末	

期末可供分配基金份额利润	-0.2266	-0.2305	0.0042	0.0024
期末基金资产净值	160,696,456.57	138,409,224.36	169,232,474.08	91,503,203.98
期末基金份额净值	0.8199	0.8160	1.0930	1.0912

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰保兴吉年丰 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-11.32%	1.49%	-7.93%	1.14%	-3.39%	0.35%
过去六个月	-16.15%	1.44%	-9.10%	1.04%	-7.05%	0.40%
过去一年	-24.99%	1.55%	-16.59%	0.93%	-8.40%	0.62%
自基金合同生效起至今	-10.88%	1.38%	-7.86%	0.76%	-3.02%	0.62%

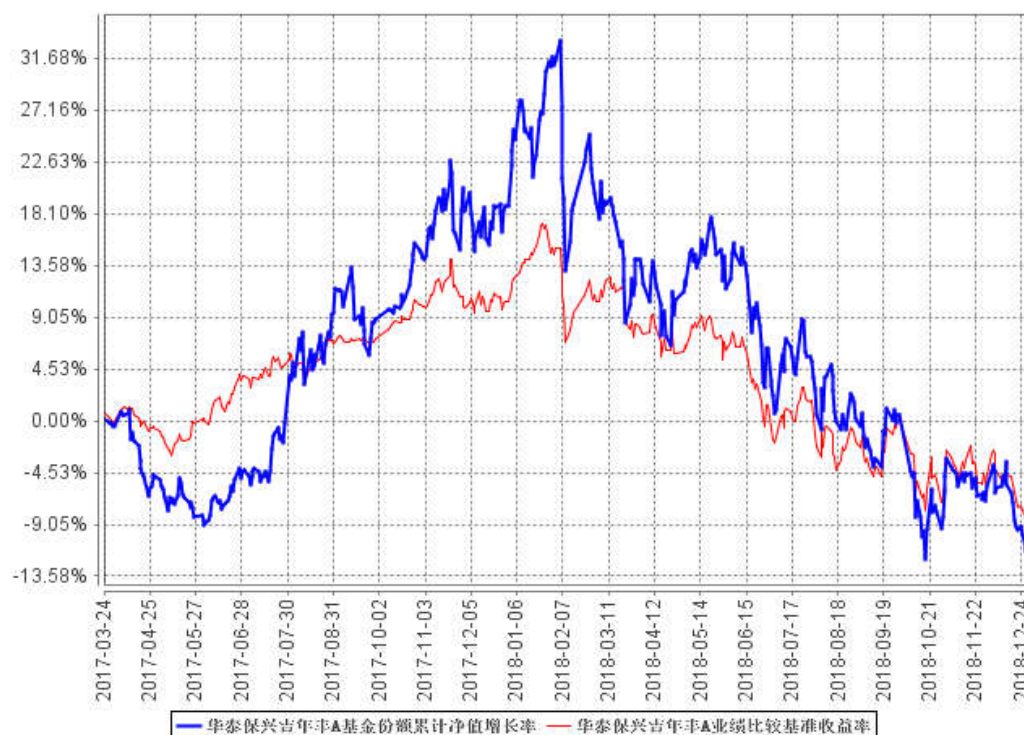
华泰保兴吉年丰 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-11.37%	1.49%	-7.93%	1.14%	-3.44%	0.35%
过去六个月	-16.26%	1.44%	-9.10%	1.04%	-7.16%	0.40%
过去一年	-25.22%	1.55%	-16.59%	0.93%	-8.63%	0.62%
自基金合同生效起至今	-11.29%	1.38%	-7.86%	0.76%	-3.43%	0.62%

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

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

华泰保兴吉年丰A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



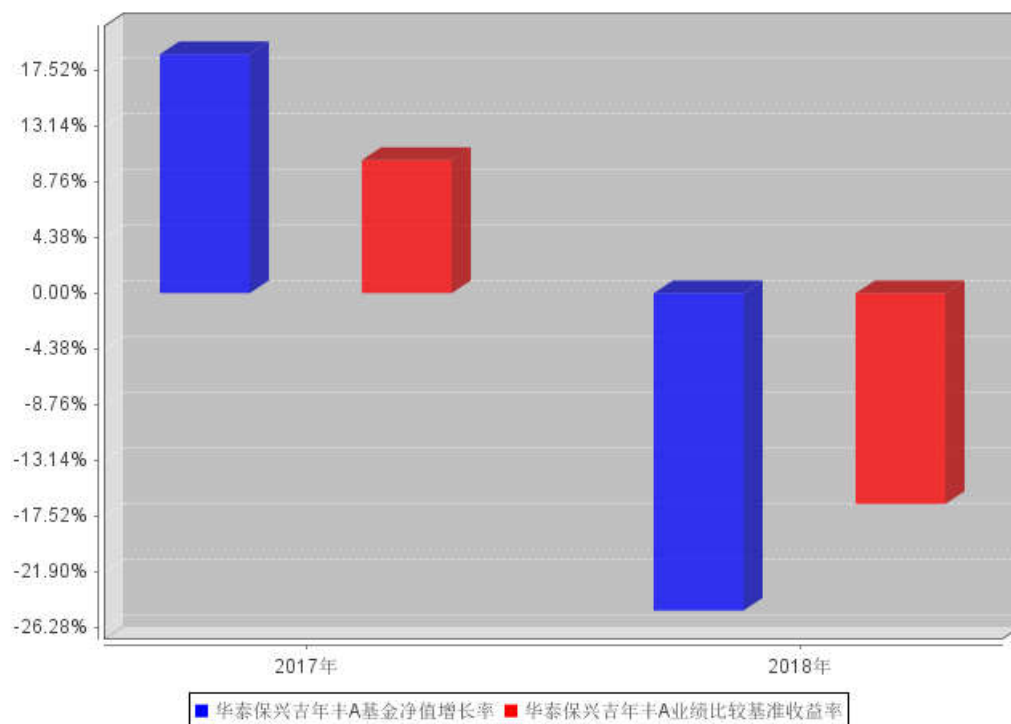
华泰保兴吉年丰C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



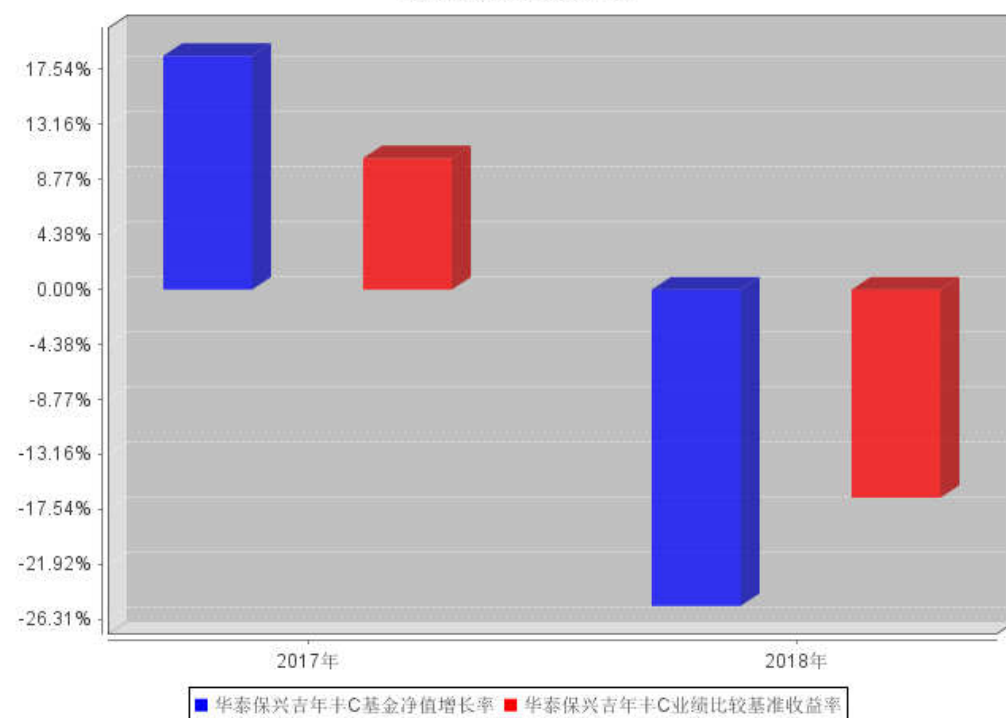
注：截至报告期末，本基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰保兴吉年丰A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



华泰保兴吉年丰C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2017 年 3 月 24 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

华泰保兴吉年丰 A					
年度	每 10 份基金 份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放 总额	年度利润分配合 计	备注
2018	-	-	-	-	
2017	0.9500	3,853,359.67	9,983,420.25	13,836,779.92	
合计	0.9500	3,853,359.67	9,983,420.25	13,836,779.92	

单位：人民币元

华泰保兴吉年丰 C					
年度	每 10 份基金 份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放 总额	年度利润分配合 计	备注
2018	-	-	-	-	
2017	0.9500	2,436,977.85	5,496,220.76	7,933,198.61	
合计	0.9500	2,436,977.85	5,496,220.76	7,933,198.61	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2018 年 12 月 31 日，公司公募证券投资基金管理规模为人民币 101.05 亿元，包括华泰保兴尊诚一年定期开放债券型证券投资基金、华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金、华泰保兴货币市场基金、华泰保兴策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、华泰保兴尊合债券型证券投资基金、华泰保兴吉年福定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、华泰保兴尊信定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、华泰保兴成长优选混合型证券投资基金、华泰保兴尊利债券型证券投资基金、华泰保兴尊颐定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰保兴研究智选灵活配置混合型证券投资基金、华泰保兴吉年利定期开放混合型发起式证券投资基金等 12 只产

品。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尚烁徽	基金经理	2017 年 3 月 24 日	-	8 年	上海交通大学硕士，CFA。历任华泰资产管理有限公司权益组合部研究员、投资经理、高级投资经理。在华泰资产管理有限公司任职期间，曾管理华泰人寿保险股份有限公司投连险产品、保险机构相对收益型委托账户、绝对收益型委托账户、组合类保险资产管理产品和企业年金计划等。2016 年 8 月加入华泰保兴基金管理有限公司。
傅奕翔	基金经理	2017 年 3 月 24 日	2018 年 6 月 20 日	6 年	上海财经大学经济学硕士。历任华泰资产管理有限公司固定收益部研究员、投资助理，权益投资部投资助理，投资研究曾覆盖电子、传媒、计算机等行业。2016 年 8 月加入华泰保兴基金管理有限公司。

注：1、首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、规范性文件要求和本基金基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资

产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作无违法违规、未履行基金合同或其他损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（证监会公告[2011]18 号），公司制定了《华泰保兴基金管理有限公司公平交易制度》，该制度及控制方法适用公司管理所有投资组合（包括封闭式基金、开放式基金、社保组合、企业年金、特定客户资产管理组合等），对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资和交易管理活动相关的各个业务环节。

研究分析方面，公司研究部全面负责公司各投资组合投资业务的研究工作，研究部公平地为各投资组合管理部门提供研究服务，其研究报告在不同的投资组合之间均可共享，且在研究报告内容、质量、数量及提供时间上均保持公平性。公司所有研究报告均在公司内部研究报告系统上统一发布。

授权和投资决策方面，对于证券投资基金业务，分别明确基金投资决策委员会、基金投资部负责人、基金经理的职责和权限划分，并合理确定基金经理的投资权限，基金投资决策委员会、基金投资部负责人等管理机构和人员不得对基金经理在授权范围内的投资活动进行干预。基金经理在授权范围内可以自主决策，但超过投资权限的操作需要经过严格的审批；对于特定客户资产管理业务，分别明确专户投资决策委员会、专户投资部负责人、专户投资经理等各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定专户投资部负责人及投资经理的投资权限。专户投资决策委员会和专户投资部负责人等管理机构和人员不得对专户投资经理在授权范围内的投资活动进行干预。专户投资经理在授权范围内可以自主决策，但超过投资权限的操作需要经过严格的审批。公司建立严格的投资组合投资信息管理及保密制度。在投资交易管理系统中设置基金经理/投资经理的查询和操作权限，并进行定期检查系统中的权限设置情况，确保不同基金经理/投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息均做到相互隔离。

交易执行方面，公司实行集中交易制度，设立独立交易室，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。所有投资对象的投资指令必须经由交易室负责人或其授权人审核分配至交易员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待，原则上应保证不同投资组合在同一时点就同一投资对象下达的相同方向的投资指令分配给同一交易员完成。交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相

同方向的投资指令时，除需经过公平性审核的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关：（一）对于同一时间段的不同交易价格，投资交易系统对于不同投资组合一律按价格优先的顺序成交；（二）对于同一时间段的相同交易价格，投资交易系统对于不同投资组合自动按比例分配成交量，即按照不同投资组合平均分配的原则。

事后监督，风险管理部负责对不同投资组合公平交易行为进行交易价差等数量化分析，并通过定量分析结果对公平交易的过程、结果实施监督：每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析；每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行 1 日、3 日、5 日同向交易价差分析。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年 A 股出现较大幅度的下跌，沪深 300 全年下跌 25.31%，创业板指下跌 28.65%。主要原因是宏观经济在年中的走弱以及始于年初的外贸环境的突变。具备一定防御性的银行、餐饮旅游、食品饮料等板块下跌相对较少。

本基金 2018 年年初布局了较多的地产、化工和交运等弹性较大的板块，但在出现系统性风险的情况下，并未及时止损。全年来看，板块进攻机会较少，本基金也并未把握住有限的几个板块的防御机会，因此产生了较大的亏损。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰保兴吉年丰 A 基金份额净值为 0.8199 元，本报告期基金份额净值增长率为-24.99%；截至本报告期末华泰保兴吉年丰 C 基金份额净值为 0.8160 元，本报告期基金份额净值增长率为-25.22%；同期业绩比较基准收益率为-16.59%。

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 2019 年，宏观纬度存在较大变数，始于 2016 年的房地产货币化安置暂告段落，货币政策的调整以及信用的扩张将对未来 1-2 年宏观经济产生持续且较为深远的影响。

证券市场在经历了 2018 年的大幅调整后，主要指数的估值在历史及全球横向可比的范围内都处于较低水平分位，估值已经反映了市场整体较差的预期。但是由于宏观的下滑对企业盈利的负面作用仍然需要几个季度的体现，指数整体空间有限。考虑信用扩张的节奏，我们认为上半年成长股投资机会较好，下半年如果信用可以有效的扩张至实体，地产及周期板块可能存在较好的投资机会。行业纬度，从景气度纬度出发，我们认为非银、新能源、有色、基建存在较好的投资价值，首选行业中治理较好、过去 1-2 年调整幅度较大、估值合理的个股。

风险主要来自经济超预期的回落、上市退市制度对壳价值的破坏以及海外市场调整对 A 股的负面影响。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理、科学和一致性，保护基金份额持有人的合法权益，成立了估值委员会。估值委员

会负责制订、评估和修订公司的估值管理办法，定期评估估值程序和估值技术，对估值技术进行最终决策，指导和监督整个估值流程。估值委员会委员由分管运营的副总经理、研究部、风险管理部、监察稽核部和运营保障部的指定人员担任。估值委员会委员在基金估值研究或运作方面具有丰富经验，熟悉相关法规、估值原则和估值技术，在估值工作中保持判断的专业性和客观性。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律

法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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 托管人对本年度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 审计报告

本报告经江苏苏亚金诚会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具的是标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	23,260,904.81	22,491,784.44
结算备付金	7,832,427.07	3,220,712.95
存出保证金	341,963.93	256,035.35
交易性金融资产	244,486,564.33	236,497,157.66
其中：股票投资	243,896,564.33	236,494,157.66
基金投资	-	-

债券投资	590,000.00	3,000.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	28,896,736.98	-
应收利息	5,043.86	7,728.23
应收股利	-	-
应收申购款	534,201.41	29,231.99
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	305,357,842.39	262,502,650.62
负债和所有者权益	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	2,850,704.61	-
应付赎回款	24,844.85	43,985.79
应付管理人报酬	211,656.77	176,273.43
应付托管费	66,142.72	55,085.47
应付销售服务费	24,422.82	15,864.00
应付交易费用	2,924,324.60	1,385,751.49
应交税费	35.68	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	150,029.41	90,012.38
负债合计	6,252,161.46	1,766,972.56
所有者权益:		
实收基金	365,623,038.26	238,694,928.19
未分配利润	-66,517,357.33	22,040,749.87
所有者权益合计	299,105,680.93	260,735,678.06
负债和所有者权益总计	305,357,842.39	262,502,650.62

注：1.报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额 365,623,038.26 份，其中 A 类基金份额总额 196,000,713.87 份，基金份额净值 0.8199 元；C 类基金份额总额 169,622,324.39 份，基金份额净值 0.8160 元。

2.本财务报表的实际编制期间为 2018 年度，比较财务报表的实际编制期间为 2017 年 3 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 3 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	-84,706,478.75	35,183,085.73
1.利息收入	591,610.95	362,821.29
其中：存款利息收入	373,378.92	196,489.72
债券利息收入	1,249.46	1,199.42
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	216,982.57	165,132.15
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-62,837,713.44	20,174,444.71
其中：股票投资收益	-66,019,668.43	19,654,257.93
基金投资收益	-	-
债券投资收益	264,850.74	175,682.71
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,917,104.25	344,504.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-22,914,377.60	14,495,685.20
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	454,001.34	150,134.53
减：二、费用	16,072,773.34	5,605,707.36
1. 管理人报酬	2,432,738.15	968,798.80
2. 托管费	760,230.52	302,749.66
3. 销售服务费	245,695.01	99,507.19
4. 交易费用	12,471,303.83	4,135,624.32
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	3.85	-
7. 其他费用	162,801.98	99,027.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-100,779,252.09	29,577,378.37
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-100,779,252.09	29,577,378.37

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	238,694,928.19	22,040,749.87	260,735,678.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-100,779,252.09	-100,779,252.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	126,928,110.07	12,221,144.89	139,149,254.96
其中：1.基金申购款	351,138,121.99	12,791,883.51	363,930,005.50
2.基金赎回款	-224,210,011.92	-570,738.62	-224,780,750.54
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	365,623,038.26	-66,517,357.33	299,105,680.93
项目	上年度可比期间 2017 年 3 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	115,857,615.14	-	115,857,615.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	29,577,378.37	29,577,378.37
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	122,837,313.05	14,233,350.03	137,070,663.08
其中：1.基金申购款	197,215,892.47	26,456,638.65	223,672,531.12
2.基金赎回款	-74,378,579.42	-12,223,288.62	-86,601,868.04
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金	-	-21,769,978.53	-21,769,978.53

净值变动(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	238,694,928.19	22,040,749.87	260,735,678.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]116 号《关于准予华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由华泰保兴基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 115,848,123.50 元，业经江苏苏亚金诚会计师事务所（特殊普通合伙）苏亚审验[2017]22 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 115,857,615.14 份，其中认购资金利息折合基金份额 9,491.64 份。本基金的基金管理人为华泰保兴基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

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

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,200.00 A 类基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金基

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

本财务报表由本基金的基金管理人华泰保兴基金管理有限公司于 2019 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰保兴吉年丰混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

7.4.7 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 3 月 24 日(基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,432,738.15	968,798.80
其中：支付销售机构的客户维护费	101,350.45	25,598.98

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

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 3 月 24 日(基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	760,230.52	302,749.66

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

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.8.2.3 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰保兴吉年丰 A	华泰保兴吉年丰 C	合计
华泰保兴基金管理有限公司	0.00	214,254.34	214,254.34
中国银行股份有限公司	0.00	588.05	588.05
合计	0.00	214,842.39	214,842.39
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 3 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰保兴吉年丰 A	华泰保兴吉年丰 C	合计
华泰保兴基金管理有限公司	0.00	89,197.91	89,197.91
中国银行股份有限公司	0.00	795.35	795.35
合计	0.00	89,993.26	89,993.26

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

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	华泰保兴吉年丰 A	华泰保兴吉年丰 C
基金合同生效日（2017 年 3 月 24 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10,870,738.81	-
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	10,870,738.81	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.97%	-

份额单位：份

项目	上年度可比期间 2017 年 3 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	华泰保兴吉年丰 A	华泰保兴吉年丰 C
基金合同生效日（2017 年 3 月 24 日）持有的基金份额	10,000,200.00	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	870,538.81	-
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	10,870,738.81	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	4.55%	-

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

2. 基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

华泰保兴吉年丰 A

关联方名称	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
华泰财产保险 有限公司	30,256,177.51	8.2752%	32,089,859.84	13.4439%
华泰人寿保险 股份有限公司	21,902,310.81	5.9904%	-	-

份额单位：份

华泰保兴吉年丰 C				
关联方名称	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
华泰人寿保险 股份有限公司	20,664,025.84	5.6517%	21,746,734.18	9.1107%

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

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 3 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 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	23,260,904.81	282,573.26	22,491,784.44	156,903.69

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

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601860	紫金银行	2018 年 12 月 20 日	2019 年 1 月 3 日	未上市	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-
601138	工业富联	2018 年 5 月 28 日	2019 年 6 月 10 日	首发机构配售	13.77	10.97	49,214	677,676.78	539,877.58	-
603156	养元饮品	2018 年 2 月 2 日	2019 年 2 月 12 日	首发老股转让	56.24	40.68	52,804	2,969,459.41	2,148,066.72	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
110049	海尔转债	2018 年 12 月 20 日	2019 年 1 月 18 日	新债未上市	100.00	100.00	5,900	590,000.00	590,000.00	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 241,158,474.23 元，属于第二层次的余额为 3,328,090.10 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 226,726,035.20 元，第二层次 9,771,122.46 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2)其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	243,896,564.33	79.87
	其中：股票	243,896,564.33	79.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	590,000.00	0.19

	其中：债券	590,000.00	0.19
	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	31,093,331.88	10.18
8	其他各项资产	29,777,946.18	9.75
9	合计	305,357,842.39	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	10,780,000.00	3.60
C	制造业	117,154,684.21	39.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	35,326,300.00	11.81
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,356,982.25	4.80
J	金融业	50,145.80	0.02
K	房地产业	21,342,000.00	7.14
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	38,906,452.07	13.01
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	5,980,000.00	2.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	243,896,564.33	81.54

8.3 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

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	603357	设计总院	984,697	19,644,705.15	6.57

2	603018	中设集团	1,105,726	19,261,746.92	6.44
3	601186	中国铁建	1,690,000	18,370,300.00	6.14
4	300595	欧普康视	380,000	14,721,200.00	4.92
5	000403	振兴生化	550,000	13,849,000.00	4.63
6	002366	台海核电	1,400,000	13,132,000.00	4.39
7	000002	万科 A	500,000	11,910,000.00	3.98
8	600161	天坛生物	549,971	11,686,883.75	3.91
9	300294	博雅生物	419,915	11,333,505.85	3.79
10	600583	海油工程	2,200,000	10,780,000.00	3.60

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600048	保利地产	113,955,477.84	43.71
2	601155	新城控股	102,576,334.78	39.34
3	600188	兖州煤业	74,673,470.98	28.64
4	601318	中国平安	73,334,234.50	28.13
5	000932	华菱钢铁	69,843,531.34	26.79
6	600585	海螺水泥	65,514,667.49	25.13
7	600519	贵州茅台	64,758,807.51	24.84
8	600740	山西焦化	62,367,676.99	23.92
9	600426	华鲁恒升	59,796,406.00	22.93
10	603885	吉祥航空	58,123,386.02	22.29
11	600583	海油工程	57,822,330.79	22.18
12	600028	中国石化	57,779,615.30	22.16
13	600068	葛洲坝	56,752,058.82	21.77
14	000977	浪潮信息	56,159,473.72	21.54
15	600029	南方航空	55,623,661.12	21.33
16	000002	万科 A	55,603,878.59	21.33
17	600036	招商银行	54,199,063.52	20.79
18	600801	华新水泥	53,266,361.20	20.43
19	603690	至纯科技	51,649,663.40	19.81
20	600115	东方航空	49,902,605.83	19.14

21	601233	桐昆股份	49,170,453.22	18.86
22	002262	恩华药业	49,110,677.48	18.84
23	601111	中国国航	47,626,435.70	18.27
24	603678	火炬电子	47,605,004.57	18.26
25	300284	苏交科	45,453,678.46	17.43
26	002384	东山精密	45,440,573.71	17.43
27	601186	中国铁建	44,942,216.52	17.24
28	000651	格力电器	42,391,399.74	16.26
29	002912	中新赛克	42,017,519.09	16.11
30	600276	恒瑞医药	41,708,657.23	16.00
31	600282	南钢股份	41,692,991.36	15.99
32	600352	浙江龙盛	41,574,503.68	15.95
33	603018	中设集团	39,975,110.15	15.33
34	000671	阳光城	38,802,731.04	14.88
35	000858	五粮液	38,022,971.48	14.58
36	601166	兴业银行	37,759,139.00	14.48
37	000768	中航飞机	37,733,762.60	14.47
38	601601	中国太保	37,525,025.55	14.39
39	002773	康弘药业	37,216,416.00	14.27
40	601898	中煤能源	36,631,209.84	14.05
41	600498	烽火通信	36,376,581.44	13.95
42	002456	欧菲科技	35,732,633.80	13.70
43	601398	工商银行	34,938,098.00	13.40
44	600340	华夏幸福	33,406,017.91	12.81
45	601699	潞安环能	32,371,227.92	12.42
46	000063	中兴通讯	32,256,441.56	12.37
47	600997	开滦股份	32,244,291.56	12.37
48	002582	好想你	31,669,850.98	12.15
49	300059	东方财富	31,076,033.72	11.92
50	002415	海康威视	31,058,659.82	11.91
51	601225	陕西煤业	30,637,345.20	11.75
52	601899	紫金矿业	30,571,385.00	11.73
53	000717	韶钢松山	30,447,788.83	11.68
54	600312	平高电气	30,102,523.80	11.55
55	601766	中国中车	29,598,905.38	11.35
56	600711	盛屯矿业	29,292,447.67	11.23

57	600690	青岛海尔	27,761,663.78	10.65
58	601288	农业银行	27,582,979.00	10.58
59	000830	鲁西化工	27,514,434.33	10.55
60	600477	杭萧钢构	27,464,271.57	10.53
61	002475	立讯精密	27,462,004.48	10.53
62	600547	山东黄金	27,456,778.00	10.53
63	600502	安徽水利	27,084,391.68	10.39
64	300532	今天国际	27,027,246.40	10.37
65	601939	建设银行	26,455,900.00	10.15
66	603357	设计总院	25,353,842.48	9.72
67	603799	华友钴业	24,979,937.20	9.58
68	600887	伊利股份	24,915,780.70	9.56
69	300170	汉得信息	24,673,631.45	9.46
70	600406	国电南瑞	24,542,778.26	9.41
71	300398	飞凯材料	23,836,339.45	9.14
72	002366	台海核电	23,818,130.10	9.13
73	300294	博雅生物	23,801,384.39	9.13
74	002463	沪电股份	23,590,815.70	9.05
75	600486	扬农化工	23,170,900.25	8.89
76	600967	内蒙一机	22,960,668.36	8.81
77	600161	天坛生物	22,872,247.18	8.77
78	002279	久其软件	22,420,172.00	8.60
79	601229	上海银行	22,337,802.52	8.57
80	002233	塔牌集团	22,277,299.51	8.54
81	600867	通化东宝	22,079,298.00	8.47
82	603043	广州酒家	21,539,645.08	8.26
83	300316	晶盛机电	21,486,877.04	8.24
84	603113	金能科技	21,289,548.00	8.17
85	000066	中国长城	20,764,698.04	7.96
86	600875	东方电气	20,616,241.56	7.91
87	300595	欧普康视	20,534,985.00	7.88
88	000596	古井贡酒	20,285,937.00	7.78
89	002007	华兰生物	19,885,873.36	7.63
90	600985	淮北矿业	19,878,734.74	7.62
91	002460	赣锋锂业	19,809,505.46	7.60
92	601636	旗滨集团	19,627,633.28	7.53

93	300122	智飞生物	19,379,832.84	7.43
94	000963	华东医药	19,318,050.40	7.41
95	600337	美克家居	19,113,204.80	7.33
96	300036	超图软件	19,048,445.10	7.31
97	600466	蓝光发展	18,865,619.00	7.24
98	300285	国瓷材料	18,671,761.00	7.16
99	600332	白云山	18,526,733.25	7.11
100	601088	中国神华	18,209,237.73	6.98
101	600596	新安股份	18,155,564.72	6.96
102	600305	恒顺醋业	18,051,493.70	6.92
103	002024	苏宁易购	18,020,658.00	6.91
104	300308	中际旭创	17,698,214.73	6.79
105	601611	中国核建	17,399,795.00	6.67
106	000538	云南白药	16,939,705.00	6.50
107	600062	华润双鹤	16,925,266.74	6.49
108	002092	中泰化学	16,694,137.00	6.40
109	002410	广联达	16,131,587.75	6.19
110	002497	雅化集团	15,942,982.00	6.11
111	603883	老百姓	15,771,111.00	6.05
112	600030	中信证券	15,728,532.00	6.03
113	300287	飞利信	15,292,754.98	5.87
114	600491	龙元建设	15,157,443.52	5.81
115	600872	中炬高新	15,021,780.89	5.76
116	603986	兆易创新	15,009,771.60	5.76
117	300146	汤臣倍健	14,903,061.00	5.72
118	600114	东睦股份	14,718,132.96	5.64
119	600409	三友化工	14,483,654.50	5.55
120	300642	透景生命	14,352,950.00	5.50
121	603367	辰欣药业	14,334,731.00	5.50
122	000403	振兴生化	14,224,971.04	5.46
123	000333	美的集团	14,032,222.47	5.38
124	002304	洋河股份	13,939,855.30	5.35
125	600104	上汽集团	13,869,019.09	5.32
126	000998	隆平高科	13,728,763.00	5.27
127	000661	长春高新	13,075,255.32	5.01
128	603808	歌力思	12,982,230.62	4.98

129	002709	天赐材料	12,893,627.24	4.95
130	000069	华侨城 A	12,830,297.44	4.92
131	300233	金城医药	12,823,850.00	4.92
132	300003	乐普医疗	12,820,314.84	4.92
133	002332	仙琚制药	12,724,981.37	4.88
134	002195	二三四五	12,640,314.50	4.85
135	002088	鲁阳节能	12,357,505.12	4.74
136	600837	海通证券	12,244,203.00	4.70
137	002078	太阳纸业	12,111,052.00	4.64
138	300054	鼎龙股份	11,761,020.40	4.51
139	601688	华泰证券	11,759,803.18	4.51
140	000513	丽珠集团	11,539,488.60	4.43
141	603508	思维列控	11,351,132.64	4.35
142	600141	兴发集团	11,213,378.65	4.30
143	300230	永利股份	11,198,378.70	4.29
144	000426	兴业矿业	11,130,946.17	4.27
145	300529	健帆生物	11,084,483.87	4.25
146	002044	美年健康	10,911,398.80	4.18
147	300014	亿纬锂能	10,906,550.00	4.18
148	002110	三钢闽光	10,810,446.26	4.15
149	002925	盈趣科技	10,639,623.00	4.08
150	000983	西山煤电	10,496,058.46	4.03
151	002068	黑猫股份	10,433,873.85	4.00
152	002916	深南电路	10,413,182.92	3.99
153	600019	宝钢股份	10,185,702.16	3.91
154	000807	云铝股份	10,068,532.00	3.86
155	000960	锡业股份	10,051,420.00	3.86
156	300383	光环新网	10,036,407.75	3.85
157	603444	吉比特	9,859,006.00	3.78
158	601919	中远海控	9,803,458.00	3.76
159	300427	红相股份	9,745,075.59	3.74
160	002449	国星光电	9,575,639.94	3.67
161	600038	中直股份	9,372,209.00	3.59
162	002624	完美世界	9,223,454.40	3.54
163	600926	杭州银行	9,198,151.36	3.53
164	300451	创业软件	9,140,837.00	3.51

165	601668	中国建筑	8,950,616.00	3.43
166	601211	国泰君安	8,924,899.00	3.42
167	600196	复星医药	8,798,897.43	3.37
168	603826	坤彩科技	8,741,751.60	3.35
169	601666	平煤股份	8,588,356.00	3.29
170	300408	三环集团	8,536,613.38	3.27
171	601888	中国国旅	8,250,085.00	3.16
172	601222	林洋能源	8,243,642.81	3.16
173	601003	柳钢股份	8,222,941.00	3.15
174	300502	新易盛	8,213,482.00	3.15
175	603156	养元饮品	8,112,828.41	3.11
176	603078	江化微	8,098,792.00	3.11
177	000818	航锦科技	7,583,452.00	2.91
178	603387	基蛋生物	7,535,157.60	2.89
179	002258	利尔化学	7,523,742.00	2.89
180	601377	兴业证券	7,360,510.00	2.82
181	600507	方大特钢	7,351,009.00	2.82
182	603368	柳药股份	7,261,261.96	2.78
183	001979	招商蛇口	7,210,466.00	2.77
184	002572	索菲亚	7,153,012.20	2.74
185	002234	民和股份	7,147,560.00	2.74
186	601021	春秋航空	6,945,484.46	2.66
187	002583	海能达	6,785,771.98	2.60
188	002179	中航光电	6,690,044.56	2.57
189	002202	金风科技	6,689,757.60	2.57
190	002025	航天电器	6,689,138.00	2.57
191	600810	神马股份	6,688,908.60	2.57
192	600782	新钢股份	6,649,796.00	2.55
193	601857	中国石油	6,625,807.00	2.54
194	603609	禾丰牧业	6,248,030.72	2.40
195	300274	阳光电源	6,110,745.88	2.34
196	600720	祁连山	6,106,973.00	2.34
197	603466	风语筑	6,041,305.00	2.32
198	600570	恒生电子	6,031,681.00	2.31
199	002065	东华软件	5,614,244.00	2.15
200	600703	三安光电	5,541,111.00	2.13

201	603788	宁波高发	5,327,235.80	2.04
202	300604	长川科技	5,223,664.20	2.00

8.4.2 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	601155	新城控股	100,081,523.58	38.38
2	600048	保利地产	98,842,588.20	37.91
3	601318	中国平安	88,177,427.40	33.82
4	600519	贵州茅台	77,307,779.45	29.65
5	600188	兖州煤业	75,509,212.04	28.96
6	601233	桐昆股份	69,626,167.00	26.70
7	000932	华菱钢铁	68,576,850.34	26.30
8	600029	南方航空	67,750,146.18	25.98
9	600585	海螺水泥	64,663,560.52	24.80
10	600740	山西焦化	63,432,812.91	24.33
11	600426	华鲁恒升	59,814,073.77	22.94
12	600028	中国石化	54,750,586.95	21.00
13	600801	华新水泥	54,528,135.85	20.91
14	000977	浪潮信息	54,394,588.46	20.86
15	603885	吉祥航空	54,256,152.56	20.81
16	600068	葛洲坝	54,179,627.13	20.78
17	600036	招商银行	53,465,580.02	20.51
18	603690	至纯科技	52,875,085.66	20.28
19	601111	中国国航	52,727,030.14	20.22
20	000651	格力电器	50,896,028.94	19.52
21	600115	东方航空	49,334,119.30	18.92
22	002262	恩华药业	49,144,825.24	18.85
23	600583	海油工程	47,478,678.65	18.21
24	300284	苏交科	46,248,758.84	17.74
25	002384	东山精密	43,482,240.92	16.68
26	000830	鲁西化工	43,156,733.97	16.55
27	600276	恒瑞医药	43,105,525.33	16.53
28	000002	万科 A	42,992,521.12	16.49
29	600282	南钢股份	41,427,199.97	15.89
30	002912	中新赛克	41,346,690.51	15.86
31	600352	浙江龙盛	39,546,913.40	15.17

32	600887	伊利股份	38,806,407.04	14.88
33	601601	中国太保	37,968,346.29	14.56
34	603678	火炬电子	37,692,005.41	14.46
35	002773	康弘药业	37,351,226.38	14.33
36	601166	兴业银行	37,310,852.50	14.31
37	000858	五粮液	37,150,760.02	14.25
38	000768	中航飞机	36,862,009.94	14.14
39	000671	阳光城	36,245,710.07	13.90
40	601898	中煤能源	35,516,018.05	13.62
41	600498	烽火通信	35,257,742.28	13.52
42	002456	欧菲科技	34,024,776.36	13.05
43	601398	工商银行	33,549,810.53	12.87
44	601699	潞安环能	33,184,289.66	12.73
45	600340	华夏幸福	31,946,884.66	12.25
46	600312	平高电气	31,746,770.29	12.18
47	601899	紫金矿业	31,584,106.67	12.11
48	601225	陕西煤业	31,453,799.97	12.06
49	600997	开滦股份	31,355,458.48	12.03
50	300059	东方财富	31,112,560.64	11.93
51	000717	韶钢松山	30,103,627.95	11.55
52	600711	盛屯矿业	29,312,573.31	11.24
53	002475	立讯精密	28,973,827.45	11.11
54	601766	中国中车	28,784,210.98	11.04
55	300532	今天国际	28,457,719.51	10.91
56	600547	山东黄金	27,417,080.76	10.52
57	600690	青岛海尔	27,112,596.66	10.40
58	002463	沪电股份	26,279,825.52	10.08
59	601186	中国铁建	26,269,836.43	10.08
60	002415	海康威视	26,254,555.36	10.07
61	002304	洋河股份	26,198,210.09	10.05
62	601288	农业银行	25,950,102.00	9.95
63	600502	安徽水利	25,607,493.90	9.82
64	600477	杭萧钢构	25,537,313.19	9.79
65	600406	国电南瑞	24,652,169.14	9.45
66	603799	华友钴业	24,515,867.17	9.40
67	002582	好想你	24,345,397.35	9.34
68	601939	建设银行	24,334,983.70	9.33
69	000063	中兴通讯	23,758,664.12	9.11

70	600967	内蒙一机	23,513,728.11	9.02
71	600486	扬农化工	23,458,364.20	9.00
72	300170	汉得信息	23,314,454.84	8.94
73	300398	飞凯材料	22,801,575.92	8.75
74	600332	白云山	22,007,409.15	8.44
75	601636	旗滨集团	21,920,648.27	8.41
76	603043	广州酒家	21,775,361.39	8.35
77	002233	塔牌集团	21,764,942.80	8.35
78	002279	久其软件	21,519,582.28	8.25
79	603018	中设集团	21,222,262.97	8.14
80	600867	通化东宝	21,171,275.06	8.12
81	601229	上海银行	21,045,719.07	8.07
82	002202	金风科技	20,964,377.97	8.04
83	000066	中国长城	20,923,769.22	8.02
84	600985	淮北矿业	20,570,621.36	7.89
85	600875	东方电气	20,443,270.08	7.84
86	300316	晶盛机电	20,409,127.86	7.83
87	000596	古井贡酒	19,658,019.39	7.54
88	002007	华兰生物	19,591,979.84	7.51
89	603113	金能科技	19,537,022.99	7.49
90	600305	恒顺醋业	19,000,824.87	7.29
91	300122	智飞生物	18,805,536.38	7.21
92	000963	华东医药	18,800,770.00	7.21
93	300036	超图软件	18,663,358.13	7.16
94	600337	美克家居	18,543,708.55	7.11
95	300285	国瓷材料	18,367,480.78	7.04
96	002460	赣锋锂业	18,107,207.39	6.94
97	600019	宝钢股份	17,960,382.18	6.89
98	002024	苏宁易购	17,663,833.24	6.77
99	600596	新安股份	17,644,668.62	6.77
100	601088	中国神华	17,436,586.12	6.69
101	600062	华润双鹤	17,083,013.42	6.55
102	000538	云南白药	17,075,804.85	6.55
103	000703	恒逸石化	16,481,779.71	6.32
104	002001	新和成	16,448,892.00	6.31
105	002092	中泰化学	16,078,261.89	6.17
106	600872	中炬高新	15,756,043.31	6.04
107	002410	广联达	15,536,873.37	5.96

108	600466	蓝光发展	15,171,679.96	5.82
109	600030	中信证券	15,129,486.13	5.80
110	600491	龙元建设	14,926,486.09	5.72
111	603883	老百姓	14,568,815.39	5.59
112	600409	三友化工	14,504,762.91	5.56
113	300287	飞利信	14,437,965.60	5.54
114	601336	新华保险	14,421,099.92	5.53
115	600114	东睦股份	14,228,326.24	5.46
116	300308	中际旭创	14,189,430.44	5.44
117	600104	上汽集团	14,139,001.72	5.42
118	002497	雅化集团	14,012,818.48	5.37
119	000333	美的集团	13,593,208.55	5.21
120	603367	辰欣药业	13,463,235.05	5.16
121	000998	隆平高科	13,449,735.00	5.16
122	603986	兆易创新	13,405,515.27	5.14
123	002332	仙琚制药	13,347,062.60	5.12
124	300642	透景生命	13,036,383.00	5.00
125	002195	二三四五	12,948,965.16	4.97
126	300146	汤臣倍健	12,913,178.05	4.95
127	000661	长春高新	12,895,833.60	4.95
128	600837	海通证券	12,870,728.00	4.94
129	601600	中国铝业	12,745,506.29	4.89
130	002709	天赐材料	12,713,708.00	4.88
131	601688	华泰证券	12,687,460.00	4.87
132	300003	乐普医疗	12,657,274.34	4.85
133	300233	金城医药	12,531,593.84	4.81
134	002110	三钢闽光	12,490,631.11	4.79
135	603808	歌力思	12,320,947.03	4.73
136	000069	华侨城 A	11,988,895.72	4.60
137	000513	丽珠集团	11,906,127.20	4.57
138	600581	八一钢铁	11,863,263.64	4.55
139	300529	健帆生物	11,684,065.50	4.48
140	002088	鲁阳节能	11,514,168.00	4.42
141	002916	深南电路	11,319,672.24	4.34
142	600141	兴发集团	10,903,632.99	4.18
143	002078	太阳纸业	10,888,921.10	4.18
144	300230	永利股份	10,869,369.40	4.17
145	000983	西山煤电	10,805,306.68	4.14

146	603444	吉比特	10,727,633.00	4.11
147	300054	鼎龙股份	10,455,098.60	4.01
148	002068	黑猫股份	10,256,020.26	3.93
149	300294	博雅生物	10,214,551.22	3.92
150	600038	中直股份	10,145,783.00	3.89
151	600161	天坛生物	10,084,034.36	3.87
152	002624	完美世界	9,941,410.20	3.81
153	300014	亿纬锂能	9,931,281.42	3.81
154	002531	天顺风能	9,930,485.04	3.81
155	603826	坤彩科技	9,882,900.41	3.79
156	000960	锡业股份	9,830,955.13	3.77
157	002366	台海核电	9,570,553.00	3.67
158	601211	国泰君安	9,486,971.00	3.64
159	300383	光环新网	9,413,902.00	3.61
160	000426	兴业矿业	9,372,881.62	3.59
161	000807	云铝股份	9,317,040.04	3.57
162	300427	红相股份	9,183,198.50	3.52
163	601919	中远海控	9,060,929.48	3.48
164	601666	平煤股份	8,990,850.16	3.45
165	600926	杭州银行	8,937,523.60	3.43
166	600196	复星医药	8,925,498.60	3.42
167	002449	国星光电	8,840,079.00	3.39
168	601003	柳钢股份	8,774,756.53	3.37
169	603387	基蛋生物	8,670,049.10	3.33
170	601222	林洋能源	8,203,638.76	3.15
171	601888	中国国旅	8,113,980.00	3.11
172	000818	航锦科技	8,006,013.34	3.07
173	300408	三环集团	7,947,388.78	3.05
174	002271	东方雨虹	7,924,395.00	3.04
175	300502	新易盛	7,823,906.00	3.00
176	002572	索菲亚	7,704,297.36	2.95
177	601611	中国核建	7,661,226.20	2.94
178	603078	江化微	7,629,153.00	2.93
179	600507	方大特钢	7,344,040.61	2.82
180	001979	招商蛇口	7,118,009.90	2.73
181	603368	柳药股份	7,074,157.16	2.71
182	601377	兴业证券	6,993,599.10	2.68
183	002583	海能达	6,896,766.00	2.65

184	603357	设计总院	6,861,460.39	2.63
185	002234	民和股份	6,801,168.90	2.61
186	600570	恒生电子	6,795,549.00	2.61
187	601021	春秋航空	6,790,881.00	2.60
188	600720	祁连山	6,755,549.94	2.59
189	600782	新钢股份	6,734,569.00	2.58
190	002258	利尔化学	6,677,422.00	2.56
191	600810	神马股份	6,595,076.66	2.53
192	601857	中国石油	6,248,000.00	2.40
193	002179	中航光电	6,138,673.40	2.35
194	300274	阳光电源	6,107,575.00	2.34
195	603609	禾丰牧业	6,076,837.00	2.33
196	002025	航天电器	5,841,224.00	2.24
197	002065	东华软件	5,644,000.00	2.16
198	600703	三安光电	5,572,214.31	2.14
199	603589	口子窖	5,436,088.00	2.08
200	300604	长川科技	5,377,899.00	2.06
201	600011	华能国际	5,219,432.18	2.00

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,865,603,878.93
卖出股票收入（成交）总额	4,769,267,426.23

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

8.5 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）	590,000.00	0.20

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	590,000.00	0.20

8.6 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	110049	海尔转债	5,900	590,000.00	0.20

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，无基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	341,963.93
2	应收证券清算款	28,896,736.98
3	应收股利	-
4	应收利息	5,043.86
5	应收申购款	534,201.41

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,777,946.18

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中未持有流通受限的股票。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华 泰 保 兴 吉 年 丰 A	1,393	140,704.03	178,985,043.00	91.32%	17,015,670.87	8.68%
华 泰 保 兴 吉 年 丰 C	1,492	113,687.88	154,436,851.25	91.05%	15,185,473.14	8.95%
合计	2,742	133,341.74	333,421,894.25	91.19%	32,201,144.01	8.81%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华泰保兴吉年丰 A	2,835,692.79	1.45%
	华泰保兴吉年丰 C	1,050,915.04	0.62%
	合计	3,886,607.83	1.06%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9.4 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	10,870,738.81	2.97	10,000,200.00	2.74	自基金合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,870,738.81	2.97	10,000,200.00	2.74	-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰保兴吉年丰 A	华泰保兴吉年丰 C
基金合同生效日（2017 年 3 月 24 日）基金份额总额	70,763,045.37	45,094,569.77
本报告期期初基金份额总额	154,836,284.09	83,858,644.10
本报告期间基金总申购份额	164,116,320.36	187,021,801.63
减:本报告期间基金总赎回份额	122,951,890.58	101,258,121.34
本报告期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	196,000,713.87	169,622,324.39

注：总申购份额含红利再投、转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内，2018 年 3 月，基金管理人副总经理邓航先生离任；2018 年 5 月，基金管理人副总经理姜光明先生离任。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2、报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请江苏苏亚金诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告年度本基金应支付审计费人民币 50,000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚等情况。

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	2,232,372,479.30	23.19%	1,587,891.84	23.19%	-

兴业证券	2	1,960,200,920.72	20.36%	1,394,283.43	20.36%	-
广发证券	2	1,835,206,413.99	19.06%	1,305,386.13	19.06%	-
天风证券	2	1,212,732,287.00	12.60%	862,611.92	12.60%	本报告期新增
东方证券	2	737,901,884.16	7.66%	524,870.15	7.66%	本报告期新增
国泰君安	2	722,073,603.89	7.50%	513,608.29	7.50%	本报告期新增
长江证券	2	601,166,152.74	6.24%	427,607.39	6.24%	本报告期新增
申万证券	2	325,707,912.83	3.38%	231,675.29	3.38%	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	本报告期新增

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

1、专用交易单元的选择标准：

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

2、专用交易单元的选择程序：

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	2,870.25	0.04%	387,400,000.00	23.54%	-	-
兴业证券	-	-	80,000,000.00	4.86%	-	-
广发证券	665,582.40	9.90%	180,000,000.00	10.94%	-	-
天风证券	-	-	165,000,000.00	10.03%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	683,000,000.00	41.51%	-	-

长江证券	6,051,646.81	90.05%	150,000,000.00	9.12%	-	-
申万证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2018.10.30-12.31	0.00	85,621,675.08	0.00	85,621,675.08	23.42%
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险,以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

注：申购份额含红利再投、转换入份额。赎回份额含转换出份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华泰保兴基金管理有限公司

2019 年 3 月 26 日