

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

基金产品资料概要

编制日期：2020年8月28日

送出日期：2020年9月1日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

| | | | |
|-------------|--------------------------|--------------------|---|
| 基金简称 | 华泰紫金周周购 12 个月滚动 债发起 | 基金代码 | 009638 |
| 下属基金简称 | 华泰紫金周周购 12 个月滚动 债发起 A | 下属基金代码 | 009638 |
| | 华泰紫金周周购 12 个月滚动 债发起 C | | 009639 |
| 基金管理人 | 华泰证券（上海）资产管理 有限公司 | 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 基金合同生效 日 | 2020-06-18 | | |
| 基金类型 | 债券型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 其他开放式 | 开放频率 | 每周开放申购，认购/申 购份额持有每满 12 个月 可以根据合同约定在规 定的时限内进行赎回 |
| 基金经理 | 陈晨 | 开始担任本基金 基金经理的日期 | 2020/6/18 |
| | | 证券从业日期 | 2009/7/1 |
| 基金经理 | 陈利 | 开始担任本基金 基金经理的日期 | 2020/8/5 |
| | | 证券从业日期 | 2011/7/1 |

二、基金投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值，为投资者实现超越业绩比较基准的收益。 |
| 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债券（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、公开发行的次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分））、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货、股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上 |

市的股票)、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

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

| | |
|---------------|---|
| 主要投资策略 | 1、资产配置策略:在基金合同约定的投资范围内,本基金将通过宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究,积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平,结合定量分析方法,确定资产在利率债和信用债之间的配置比例。同时,根据市场利率的水平和本基金距下一运作期到期日剩余期限,确定采取持有到期投资策略的债券配置比例。 |
| | 2、久期策略:本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化,对引起利率变化的相关因素进行跟踪和分析,进而对债券组合的久期和持仓结构制定相应的调整方案,以降低利率变动对组合带来的影响。 |
| | 3、类属配置策略:本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析,研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势,制定债券类属配置策略,以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。 |
| | 4、信用债投资策略:本基金将主要投资于信用评级为AA以上(含AA)的信用债。本基金将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面考量信用利差的整体变化趋势还将以内部信用评级为主、外部信用评级为辅,即采用内外结合的信用研究和评级制度,研究债券发行主体企业的基本面,以确定企业主体的实际信用状况。 |
| | 5、杠杆投资策略:本基金将在考虑债券投资的风险收益情况,以及回购成本等因素的情况下,在风险可控以及法律法规允许的范围内,通过债券回购,放大杠杆进行投资操作。 |
| | 6、再投资策略:本基金因持有的债券获得的利息收入,将再投资于其他合适的投资标的。如果付息日距离下一运作期到期日较近,本基金将对该部分利息进行流动性管理。 |
| | 7、资产支持证券的投资策略:本基金将在利率基本面分析、市场流动性分析和信用评级支持的基础上,辅以与国债、企业债等债券品种的相对价值比较,审慎投资资产支持证券类资产。 |
| | 8、国债期货投资策略:本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系,选择定价合理的国债期货合约,其次,考虑国债期货各合约的流动性情况,最终确定与现货组合的合适匹配,以达到风险管理的目标。 |
| | 9、可转换债券投资策略 |
| | 10、股票投资策略 |

| | |
|---------------|--|
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为:中债综合财富(总值)指数收益率 \times 95%+沪深300指数收益率 \times 5%。 |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型基金,其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。 |

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表(若有)

注:本基金成立于2020年6月18日。

(三) 自基金合同生效以来/最近十年基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

注:本基金成立于2020年6月18日。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在申购/赎回基金过程中收取：

华泰紫金周周购12个月滚动持有A

| 费用类型 | 金额 (M) /持有期限 (N) | 收费方式/费率 |
|-----------|---------------------|---------|
| 申购费 (前收费) | M<100 万 | 0.5% |
| | 100 万≤M<1000 万 | 0.3% |
| | M≥1000 万 | 500 元/笔 |
| 赎回费 | N<7 日 | 1.5% |
| | N≥7 日 | 0 |

华泰紫金周周购12个月滚动持有C

| 费用类型 | 金额 (M) /持有期限 (N) | 收费方式/费率 |
|-----------|---------------------|---------|
| 申购费 (前收费) | - | 不收取申购费 |
| 赎回费 | N<7 日 | 1.5% |
| | N≥7 日 | 0 |

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

| 费用类别 | 收费方式/年费率 |
|-----------------------------|----------|
| 管理费 | 0.5% |
| 托管费 | 0.1% |
| 销售服务费 (华泰紫金周周购 12 个月滚动持有 A) | 不收取销售服务费 |
| 销售服务费 (华泰紫金周周购 12 个月滚动持有 C) | 0.3% |

注：本基金交易证券、基金（如有）等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

四、风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。投资于本基金的主要风险有：

- 1、市场风险，主要包括：（1）政策风险；（2）经济周期风险；（3）利率风险；（4）通

货膨胀风险；（5）再投资风险；（6）杠杆风险；（7）债券收益率曲线风险；2、信用风险；3、流动性风险；4、操作风险；5、管理风险；6、合规风险；

7、本基金的特有风险：（1）债券市场的系统性风险；（2）国债期货投资风险；（3）资产支持证券投资风险；（4）运作期间到期日前无法赎回的风险；（5）运作期期限或有变化的风险；（6）《基金合同》终止的风险。

（二）重要提示

中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站 <https://htamc.htsc.com.cn/>，客服电话：4008895597

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料